

目論見書補完書面

この書面は、金融商品取引法第37条の3の規定に基づき、お客様が当投資信託（ファンド）をご購入するにあたり、ご理解していただく必要のある重要事項の情報を、あらかじめ提供するものです。お取引にあたっては、この書面及び目論見書の内容をよくお読みいただき、ご不明な点は、お取引開始前にご確認ください。

※この書面は、投資信託説明書（目論見書）の一部ではなく、マネックス証券の責任の下で作成しているものです。

手数料等の諸経費について

- ・当ファンドの手数料など諸経費の詳細は目論見書をご覧ください。
- ・お客様にご負担いただくお申込手数料、信託報酬など諸経費の種類ごとの金額及びその合計額等については、実際のお申込み金額、保有期間等に応じて異なる場合があります。

当社における申込手数料は、購入金額（購入口数×1口あたりの購入価額）に、ファンドごとの申込手数料率を乗じて計算します。

＜口数指定でご購入する場合（例）＞

申込手数料率3.0%（税抜）のファンドを購入価額10,000円（1万口あたり）で100万口ご購入いただく場合は、

申込手数料（税抜）＝100万口×10,000円÷10,000口×3.0%＝30,000円となり、合計1,030,000円（税抜）お支払いいただくことになります。

＜金額指定でご購入する場合（例）＞

100万円の金額指定でご購入いただく場合、お支払いいただく100万円の中から申込手数料（税込）をいただきますので、100万円全額がファンドの購入金額となるものではありません。

クーリング・オフの適用について

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の規定の適用はなく、クーリング・オフの対象とはなりませんので、ご注意ください。

1. 当ファンドに係る金融商品取引契約の概要

当社は、ファンドの販売会社として、募集の取扱い及び販売等に関する事務を行います。

2. 当社が行う金融商品取引業の内容及び方法の概要

当社が行う金融商品取引業は、主に金融商品取引法第 28 条第 1 項の規定に基づく第一種金融商品取引業であり、当社においてファンドのお取引や保護預けを行われる場合は、以下によります。

- ・お取引にあたっては、保護預り口座、振替決済口座又は外国証券取引口座の開設が必要となります。
- ・お取引のご注文をいただいたときは、原則として、あらかじめ当該ご注文に係る代金又は有価証券の全部（前受金等）をお預けいただいた上で、ご注文をお受けいたします。
- ・ご注文いただいたお取引が成立した場合（法令に定める場合を除きます。）には、契約締結時交付書面（取引報告書）をお客様にお渡しいたします（郵送又は電磁的方法による場合を含みます）。万一、記載内容が相違しているときは、速やかに当社お問合せ窓口へ直接ご連絡ください。

3. 当社の概要

- ・ 商号等 : マネックス証券株式会社
 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第 165 号
- ・ 本店所在地 : 〒107-6025 東京都港区赤坂一丁目 12 番 32 号
- ・ 設立 : 1999 年 5 月
- ・ 資本金 : 12,200 百万円
- ・ 主な事業 : 金融商品取引業
- ・ 加入協会 : 日本証券業協会、一般社団法人 金融先物取引業協会、
 一般社団法人 日本投資顧問業協会
- ・ 指定紛争 : 特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター
 解決機関
- ・ 連絡先 : ご不明な点がございましたら、下記までお問合せください。
 お客様ダイヤル : 0120-846-365（通話料無料）
 03-6737-1666（携帯電話・PHS・一部 IP 電話）
 ログイン ID と暗証番号をご用意ください。
 当社ウェブサイト : ログイン後の「ヘルプ・お問合せ」の入力
 フォームからお問合せいただけます。

以 上
(平成 29 年 2 月)
KTM_TOUSHIN_1.2

当資料は全ての投資信託の「目論見書補完書面」「投資信託説明書（交付目論見書）」に添付しているものです
申込手数料や解約手数料がかからない投資信託につきましては、以下の説明は該当しません。

申込手数料に関するご説明

■ 投資信託の申込手数料は購入時に負担いただくものですが、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率ははしだいに減っていきます。

例えば、申込手数料が3%（税抜き）の場合

【保有期間】 【1年あたりのご負担率（税抜き）】



※投資信託によっては、申込手数料をいただくず、解約時に保有期間に応じた解約手数料をお支払いいただく場合があります。その場合も、保有期間が長期に及ぶほど、1年あたりの負担率ははしだいに減っていきます。

※上記の図の手数料率や保有期間は例示です。実際にお買付いただく投資信託の手数料率や残存期間については、当社ウェブサイトや「投資信託説明書（交付目論見書）」にてご確認ください。

※投資信託をご購入いただいた場合には、上記の申込手数料のほか、信託報酬やその他費用等をご負担いただきます。また、投資信託の種類に応じて、信託財産留保額等をご負担いただく場合があります。実際の手数料率等の詳細は、当社ウェブサイトや「投資信託説明書（交付目論見書）」にてご確認ください。

（2017年10月）

使用開始日
2021年8月11日

マネックス資産設計ファンド ＜隔月分配型＞

追加型投信／内外／資産複合

商品分類			属性区分				
単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ ^{※2}
追加型	内外	資産複合	その他資産 (投資信託証券 ^{※1})	年6回 (隔月)	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	なし

※1 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、不動産投信)資産配分変更型」です。

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

◆上記の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

この目論見書により行う「マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞」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2021年8月10日に関東財務局長に提出しており、2021年8月11日にその効力が生じております。

- 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。
- ファンドに関する金融商品取引法第15条第3項に規定する目論見書(以下、「請求目論見書」といいます。)は、委託会社のホームページで閲覧できます。
本書には約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。
なお、販売会社に請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようにしてください。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ファンドの販売会社、基準価額等については委託会社の照会先までお問い合わせください。

〈委託会社〉[ファンドの運用の指図を行う者]

アセットマネジメントOne 株式会社

金融商品取引業者登録番号:関東財務局長(金商)第324号
設立年月日:1985年7月1日
資本金:20億円(2021年5月末現在)
運用する投資信託財産の合計純資産総額:18兆4,542億円
(2021年5月末現在)

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】

<http://www.am-one.co.jp/>

〈受託会社〉[ファンドの財産の保管および管理を行う者]

みずほ信託銀行株式会社

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。



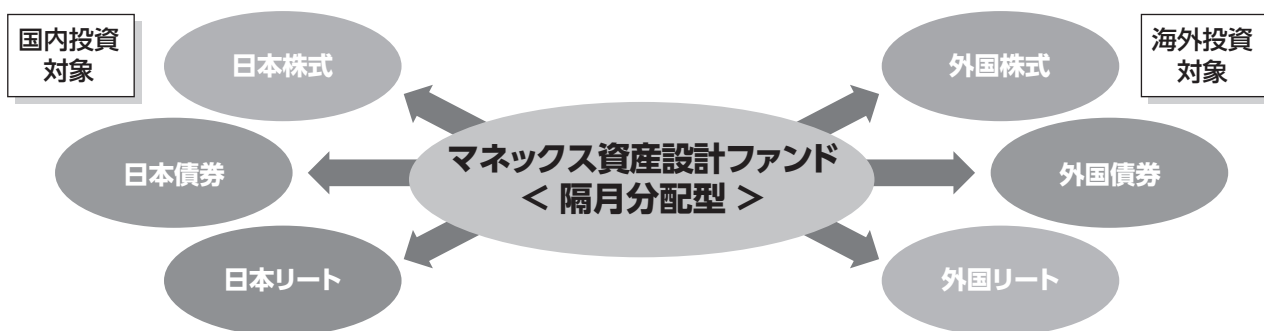
ファンドの目的・特色

ファンドの目的

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

ファンドの特色

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



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

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

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

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

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



ファンドの目的・特色

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

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

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

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

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

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

*2021年5月末時点

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

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

4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

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

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

●将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

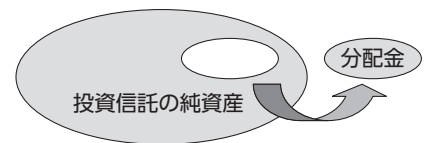


ファンドの目的・特色

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



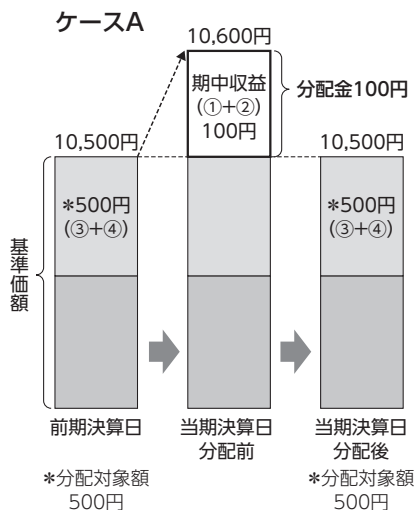
◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係(イメージ)

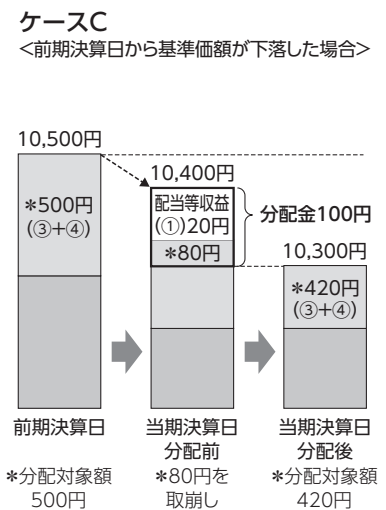
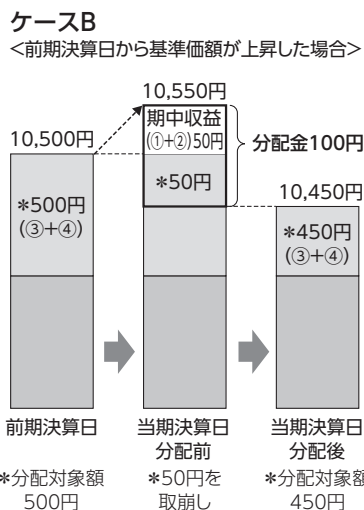
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



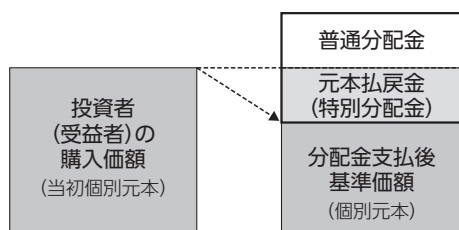
上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

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

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

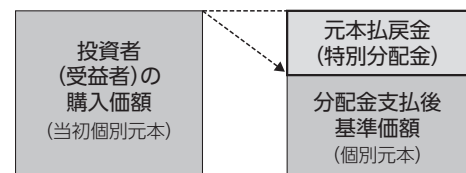
◆投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金: 個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
 元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。
 (注) 普通分配金に対する課税については、後掲「手続・手数料等」の「ファンドの費用・税金」をご参照ください。



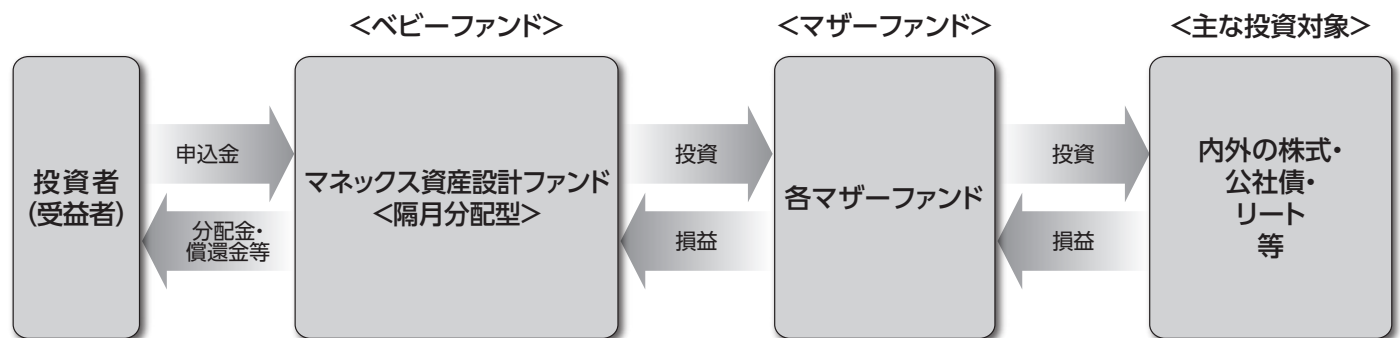
ファンドの目的・特色

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

■ ファンドの仕組み

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



■ 主な投資制限

- ① マザーファンドへの投資割合には、制限を設けません。
- ② 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。
- ③ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ④ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ⑤ マザーファンド以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。



ファンドの目的・特色

■マザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
主要投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式	海外の株式
投資態度	<p>①主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>①主に海外の株式に投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
主要投資対象	わが国の公社債	海外の公社債
投資態度	<p>①主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>①主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
ファンド名	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
主要投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。)	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券* ※海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券
投資態度	<p>①東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>②不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p>	<p>①主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>②不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>③外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</p>

○各マザーファンドの主な投資制限については、請求目論見書または約款に記載しております。

指数の著作権等

●東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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TOPIXの商標に関するすべての権利は、(株東京証券取引所)が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

●MSCI コクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

●東証REIT指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は、(株東京証券取引所)が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

●S&P 先進国 REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社([SPDJ])の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシズLLC([S&PJ])の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングスLLC([Dow Jones])の登録商標です。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P 先進国 REITインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。



投資リスク

基準価額の変動要因

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

資産配分 リスク

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

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

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

株価変動 リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利 リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

リーートの 価格変動 リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

為替 リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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



投資リスク

信用 リスク

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

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

流動性 リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

リスクの管理体制

委託会社では、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。また、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。リスク管理に関する委員会等はこれらの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、総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

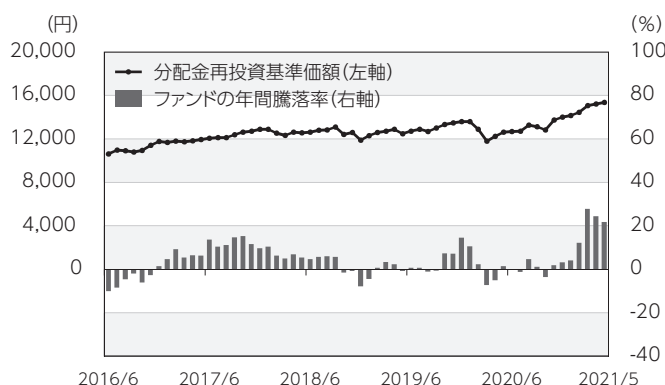
※リスク管理体制は、今後変更になることがあります。



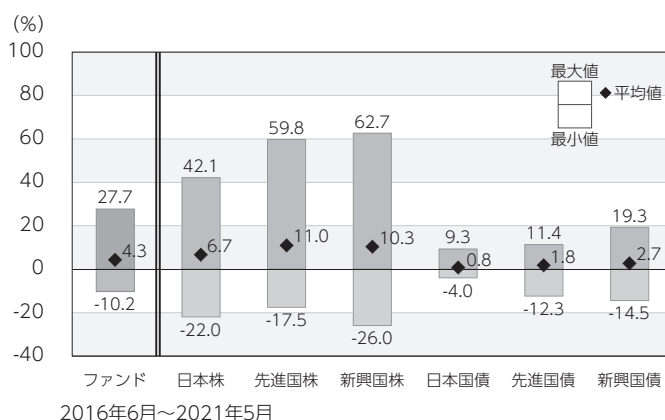
投資リスク

<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、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所 (株)東京証券取引所)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は、(株)東京証券取引所が有しています。
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、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

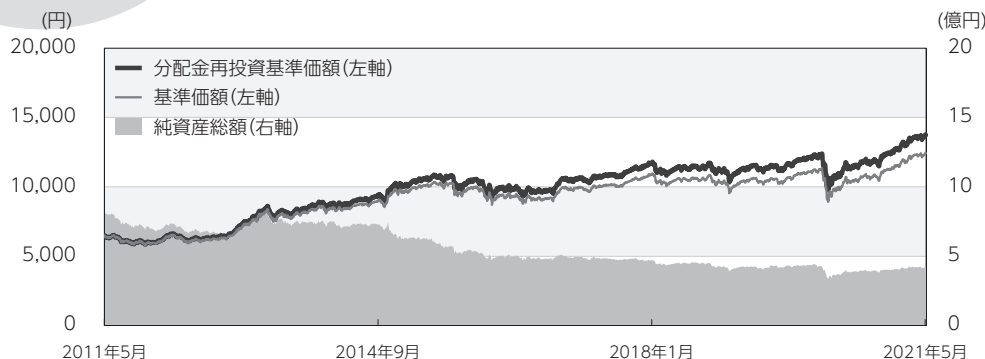
(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



運用実績

データの基準日:2021年5月31日

基準価額・純資産の推移 《2011年5月31日～2021年5月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

分配の推移(税引前)

2020年 9月	15円
2020年11月	15円
2021年 1月	15円
2021年 3月	15円
2021年 5月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	1,785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	28.25
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.56
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	23.54
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.01
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.99
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.50

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.38
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.47
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.35
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.94
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.53

■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	3.85
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.30
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.54
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.46
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.31

○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。



運用実績

データの基準日:2021年5月31日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.38
2	420回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2023/1/1	1.23
3	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.09
4	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	1.06
5	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.06

■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 2.0 11/30/22	国債証券	アメリカ	2	2022/11/30	0.53
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.52
3	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.47
4	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.46
5	US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	アメリカ	1.625	2022/11/15	0.45

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.82
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.77
3	GLP投資法人	投資証券	日本	5.10
4	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.90
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.82

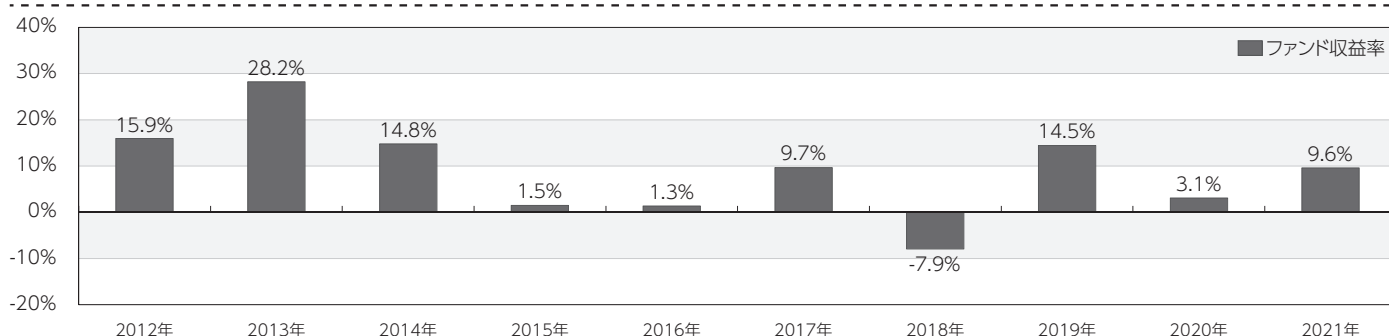
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	5.98
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.51
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.94
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.92
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.89

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。

※2021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。



手続・手数料等

お申込みメモ

購入単位	販売会社が定める単位(当初元本1口=1円)
購入価額	購入申込受付日の翌営業日の基準価額(基準価額は1万口当たりで表示しています。)
購入代金	販売会社が定める期日までにお支払いください。
換金単位	販売会社が定める単位
換金価額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額
換金代金	原則として換金申込受付日から起算して6営業日目からお支払いします。
申込締切時間	原則として営業日の午後3時までに販売会社が受付けたものを当日分のお申込みとします。
購入の申込期間	2021年8月11日から2022年2月10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り更新されます。
購入・換金 申込不可日	以下のいずれかに該当する日には、購入・換金のお申込みの受付を行いません。 <ul style="list-style-type: none"> ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ニューヨーク証券取引所の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日 ・ロンドン証券取引所の休業日 ・フランクフルトの銀行の休業日 ・オランダの銀行の休業日 ・フランスの銀行の休業日 ・オーストラリア証券取引所の休業日
換金制限	信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。
購入・換金 申込受付の 中止および取消し	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。
信託期間	無期限(2007年1月26日設定)
繰上償還	次のいずれかに該当する場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了(繰上償還)することがあります。 <ul style="list-style-type: none"> ・信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合。 ・受益者のために有利であると認めるとき。 ・やむを得ない事情が発生したとき。
決算日	毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各11日(休業日の場合は翌営業日)
収益分配	年6回の毎決算日に、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。
信託金の限度額	3,000億円
公 告	原則として、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ(http://www.am-one.co.jp/)に掲載します。
運用報告書	5月、11月のファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて交付します。
課 税 関 係	課税上は株式投資信託として取り扱われます。 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。 配当控除および益金不算入制度の適用はありません。



手続・手数料等

ファンドの費用・税金

■ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用		
購 入 時 手 数 料	ありません。	
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に <u>0.3%</u> の率を乗じて得た額を、換金時にご負担いただきます。	
投資者が信託財産で間接的に負担する費用		
運 用 管 理 費 用 (信 託 報 酬)	ファンドの日々の純資産総額に対して <u>年率0.55%(税抜0.50%)</u> 信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率 ※運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。	
	支払先	内訳(税抜)
	委託会社	年率0.26%
	販売会社	年率0.20%
	受託会社	年率0.04%
	主な役務	
		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
		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
		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
	※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社(イボットソン・アソシエーツ・ジャパン)に対する投資顧問報酬が含まれます。	
そ の 他 の 費 用 ・ 手 数 料	その他の費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。 ・組入価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料 ・信託事務の処理に要する諸費用 ・外国での資産の保管等に要する費用 ・監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 等 監査費用は毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のとき、その他の費用等はその都度ファンドから支払われます。 ※これらの費用等は、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。	

※上記手数料等の合計額、その上限額については、購入金額や保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。

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



手続・手数料等

■税金

- 税金は表に記載の時期に適用されます。
- 以下の表は、個人投資者の源泉徴収時の税率であり、課税方法等により異なる場合があります。

時期	項目	税金
分配時	所得税および地方税	配当所得として課税 普通分配金に対して20.315%
換金（解約）時 および償還時	所得税および地方税	譲渡所得として課税 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して20.315%

※上記は2021年5月末現在のものです。

※少額投資非課税制度「愛称:NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称:ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※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。

※法人の場合は上記とは異なります。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金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。

MEMO



マネックス資産設計ファンド ＜隔月分配型＞

追加型投信／内外／資産複合

■この目論見書により行う「マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞」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2021年8月10日に関東財務局長に提出しており、2021年8月11日にその効力が生じております。

■「マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞」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】 <http://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 菅野 暁
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】	69
第3【ファンドの経理状況】	75
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	251
第三部【委託会社等の情報】	253
第1【委託会社等の概況】	253
約款	282

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下、「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2021年8月11日から2022年2月10日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、販売会社を買付代金を支払うものとします。

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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

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

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

○振替受益権について

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

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

(参考)

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

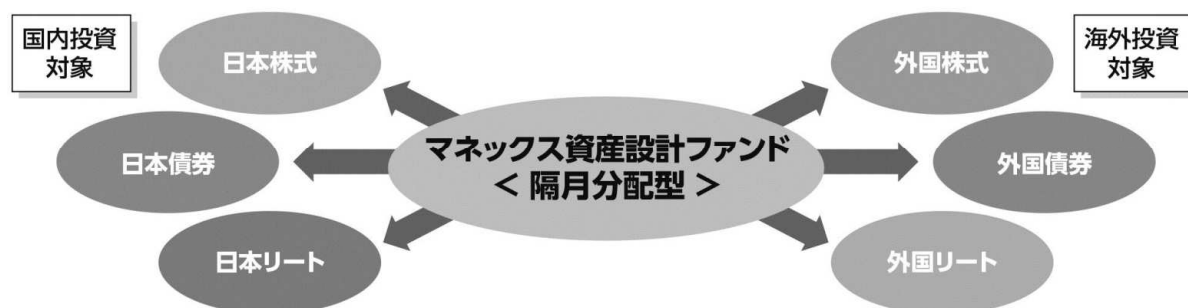
1【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。
- ②当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

* 2021年5月末時点

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

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

4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

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

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

●将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

収益分配金に関する留意事項

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

投資信託から分配金が支払われるイメージ



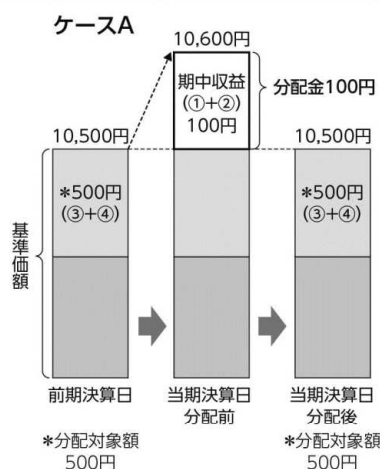
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配金額と基準価額の関係(イメージ)

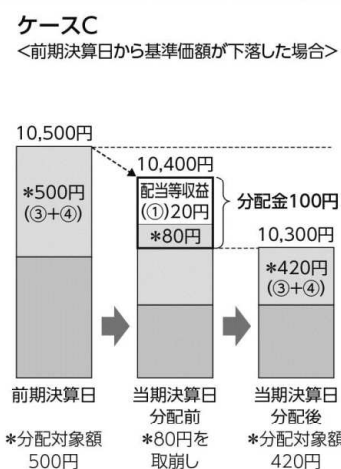
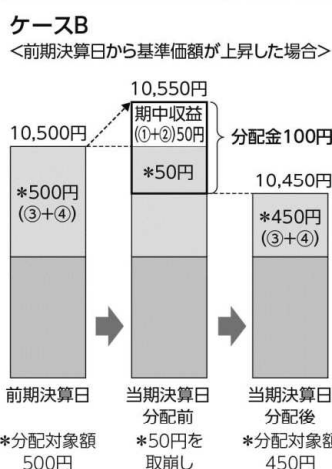
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



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

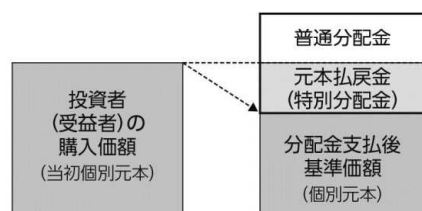
ケースA : 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
ケースB : 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
ケースC : 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

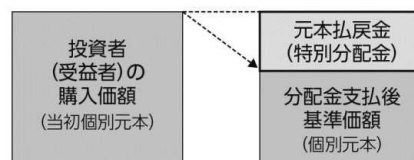
- ◆投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

○商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

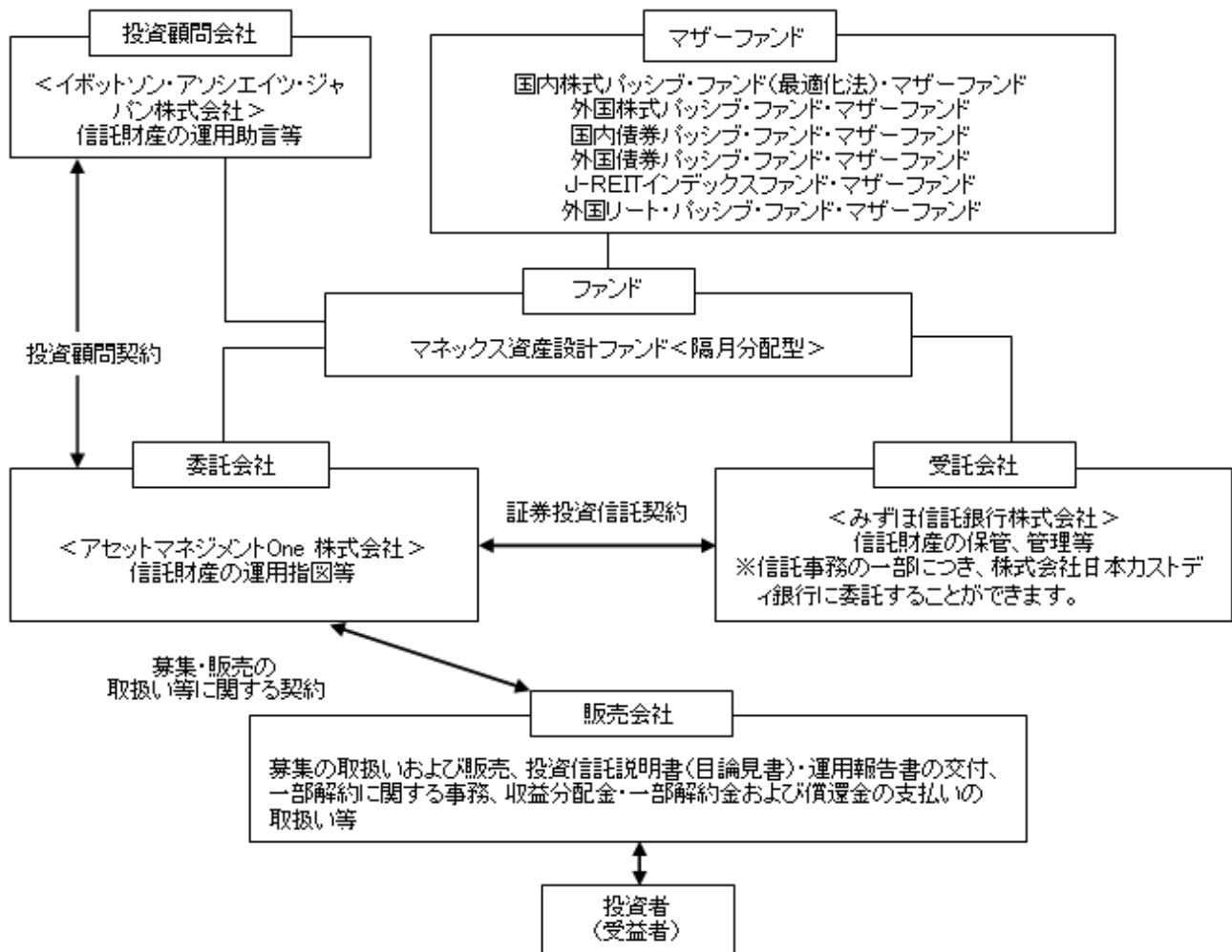
<p>その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券、不動産投信) 資産配分変更型))</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(株式、債券、不動産投信)を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。</p> <p>(注) 商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分変更型))に分類されます。</p>
<p>年6回(隔月)</p>	<p>目論見書または投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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

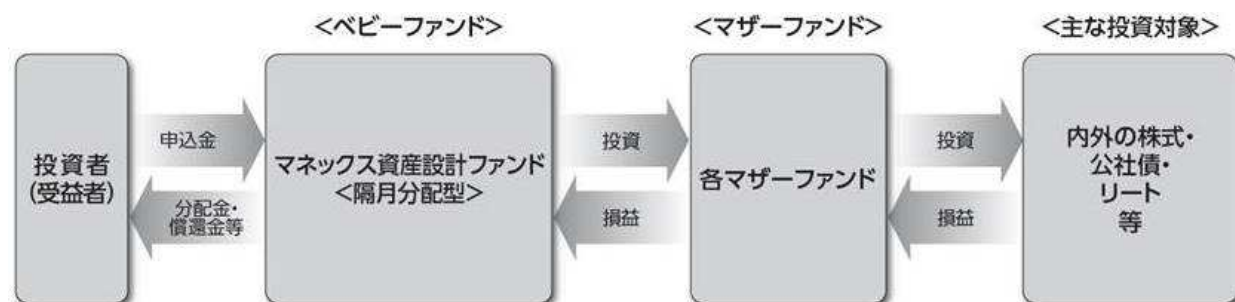
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目 8 番 2 号

資本金の額

20億円（2021年5月31日現在）

委託会社の沿革

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

（2021年5月31日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

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

<投資態度>

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

※リート（REIT）とは

- ・リート（REIT）とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。（以下同じ。）
- ・REIT（リート）とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT（Listed Property Trust）と呼ばれる場合があります。
- ・リート（REIT）は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くの

リート（REIT）は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート（REIT）は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート（REIT）に投資する投資家が、配当金（もしくは分配金）として享受する仕組みになっています。

※投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

<運用プロセス>

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

（２）【投資対象】

1. 投資の対象とする資産（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

- 1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- 2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

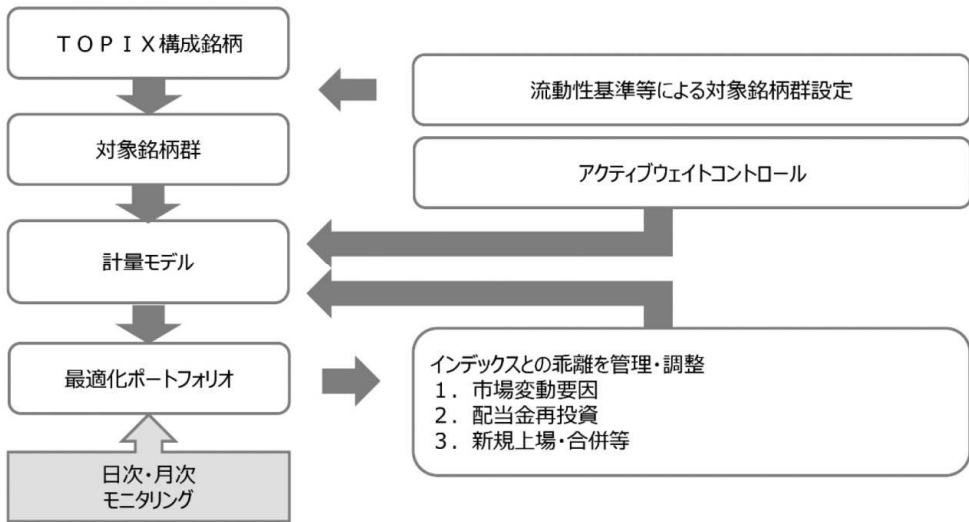
委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で上記5)の権利の性質を有するもの

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）^{（注）}に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注）①東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）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TOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。</p> <p>②㈱東京証券取引所は、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TOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>③㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>④㈱東京証券取引所は、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、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>⑤当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>⑥㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マ</p>

	<p>ザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>⑦(株)東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（T O P I X）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>⑧以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（T O P I X）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
運用プロセス	 <pre> graph TD A[T O P I X 構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] E --> D F[流動性基準等による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C G --> D H[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 市場変動要因 2. 配当金再投資 3. 新規上場・合併等] --> D </pre> <p>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、T O P I X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。</p> <p>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。</p>

	<p>③インデックスとの乖離を管理</p> <p>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れ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。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>③外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主に海外の株式に投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）^(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>（注）本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であることを問わず、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、</p> </div>

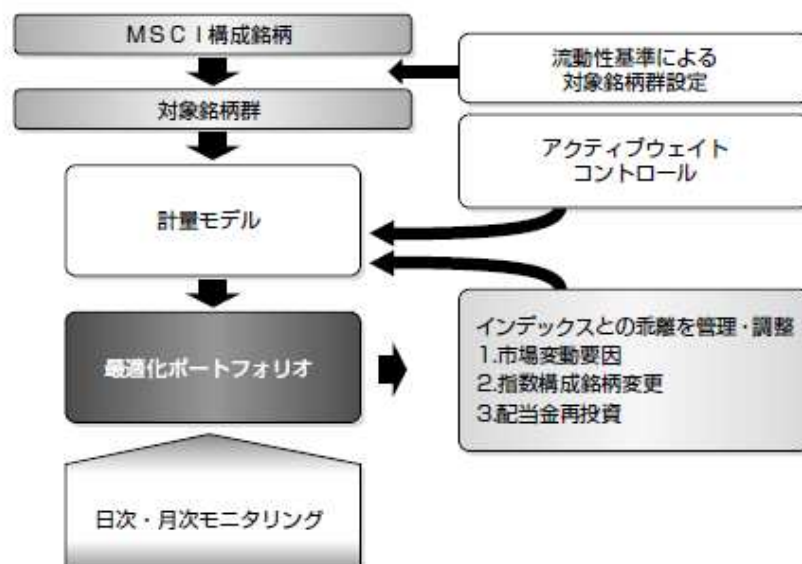
ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に限りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に對して、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獨創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害（逸失利益を含む。）については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。

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

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

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



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、MSC I コクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

②最適化法によるポートフォリオの構築

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

③インデックスとの乖離を管理

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

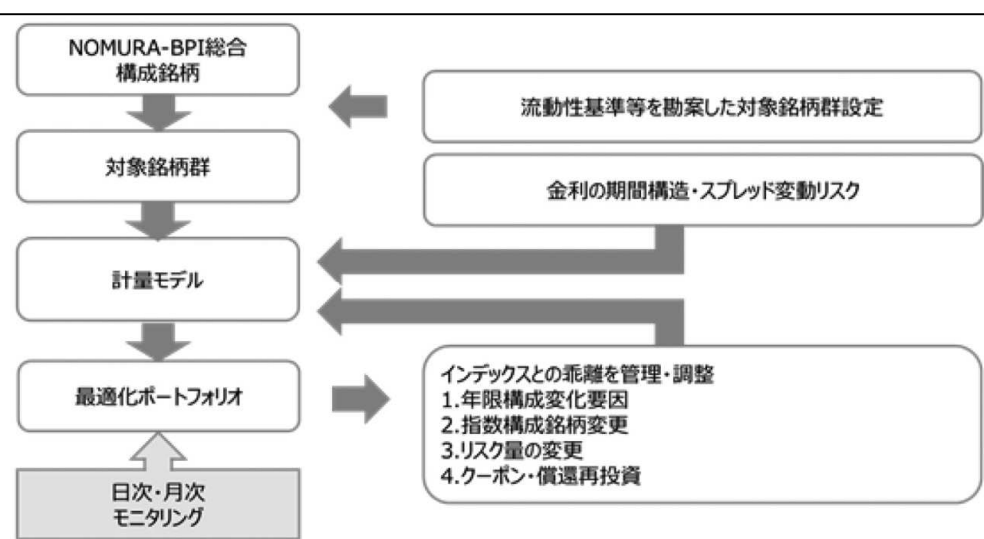
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

主な投資制限

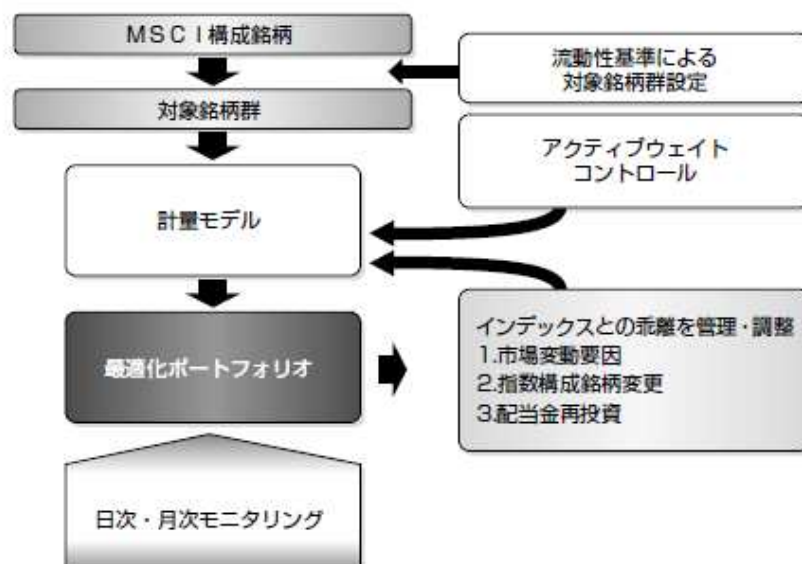
- ①株式への投資割合には、制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対

	<p>象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--	--

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、NOMURA-BPI総合^(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>(注) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
運用プロセス	 <pre> graph TD A[NOMURA-BPI総合 構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次 モニタリング] E --> D E --> C E --> B E --> A F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利の期間構造・スプレッド変動リスク] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] --> D </pre> <p>①流動性基準等による対象銘柄群設定</p> <p>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。</p> <p>②最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>1. 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因</p>

	<p>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</p> <p>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。</p> <p>③インデックスとの乖離を管理</p> <p>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。</p> <p>組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資
主な投資制限	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑥デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>⑦外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）^(注)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>(注) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポ</p> </div>



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、MSC I コクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

②最適化法によるポートフォリオの構築

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

③インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

主な投資制限

①株式への投資割合には、制限を設けません。

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。

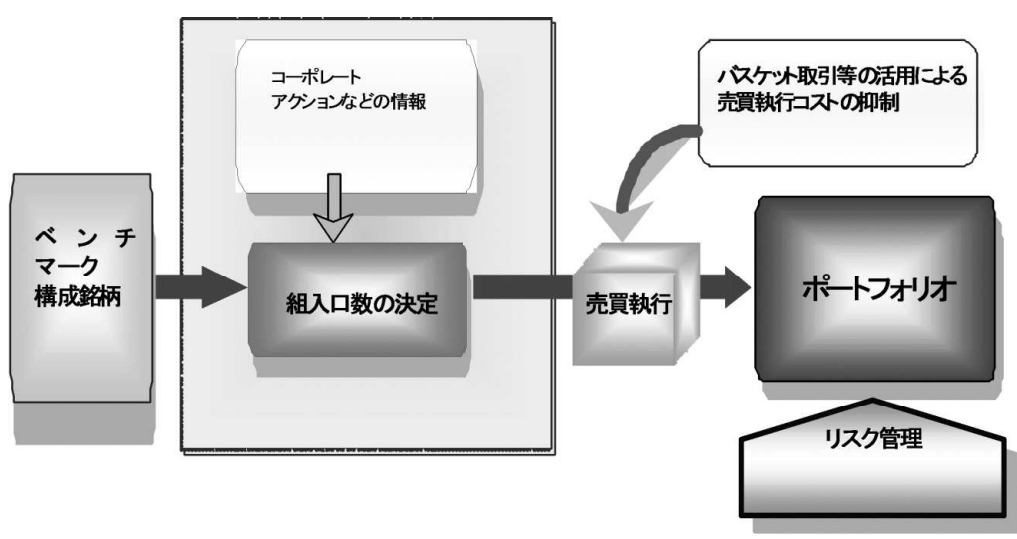
③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④外貨建資産への投資には、制限を設けません。

⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対

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

ファンド名	J－REITインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）^(注)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注) ①東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。</p> <p>②㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>③㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>④㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>⑤当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>⑥㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p>

	<p>⑦(株)東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>⑧以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>②不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>③但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
運用プロセス	<p>①原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>②新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</p> <p>③配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</p>  <pre> graph LR BM[ベンチマーク構成銘柄] --> D[組入口数の決定] subgraph Box [] C[コーポレートアクションなどの情報] --> D end D --> S[売買執行] S --> P[ポートフォリオ] P --> R[リスク管理] B[バスケット取引等の活用による 売買執行コストの抑制] -.-> S </pre>
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

	<p>②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>③株式への投資は行いません。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--	--

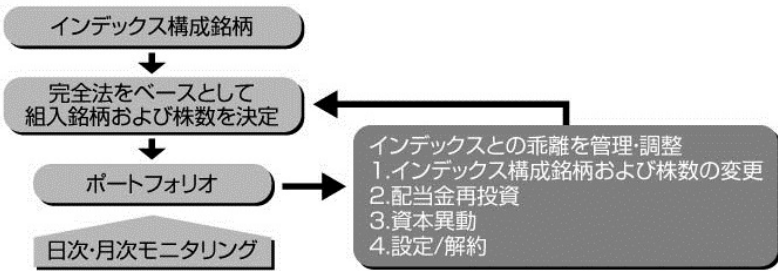
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）^(注)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-top: 10px;"> <p>（注）S & P 先進国 REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 REITインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 REITインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび／または特定の商標、サービスマーク、および／または商標名のライセンス供</p> </div>

与です。S & P 先進国 R E I T インデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I T インデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 R E I T インデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

主な投資対象

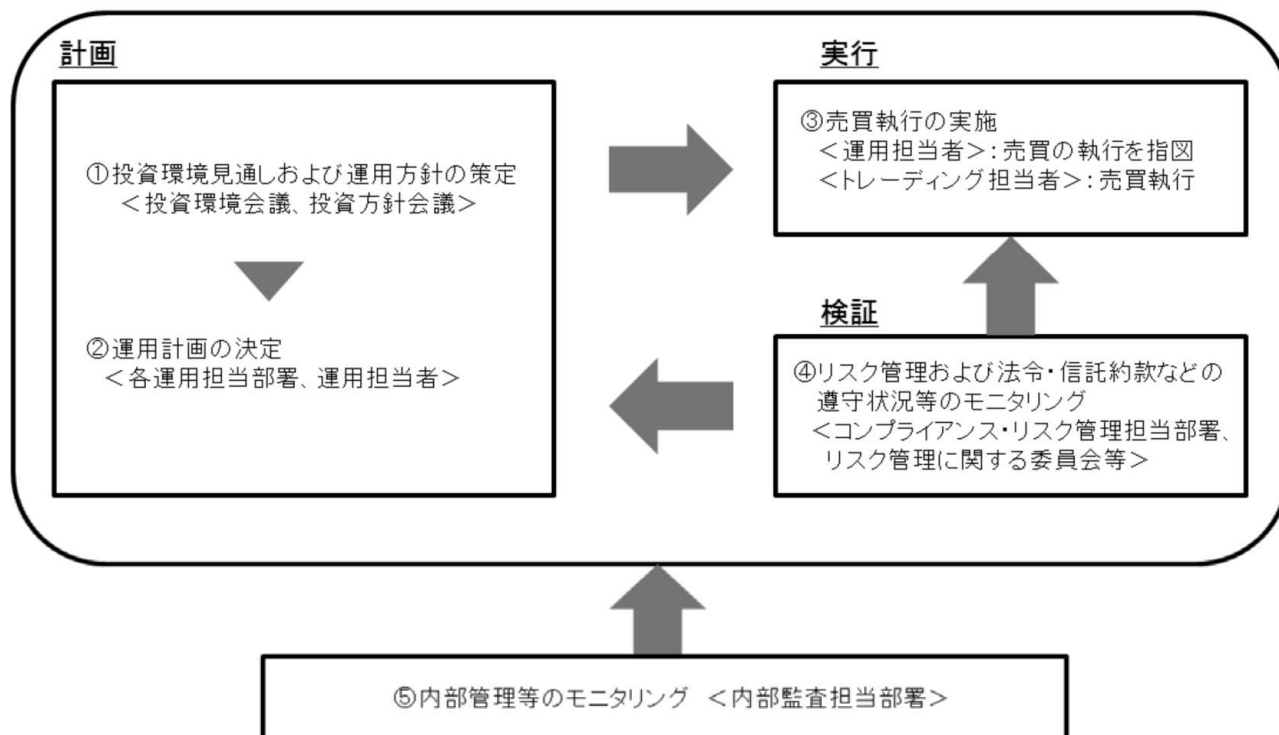
日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。
 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日次・月次モニタリング] D --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

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

定期的に行わ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

当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2021年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

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

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

1) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することが

できます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」 2. 運用方法 (3)投資制限）

⑨投資する株式等の範囲（約款第19条）

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

⑩信用取引の指図および範囲（約款第22条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑪先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

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

⑫スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

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

- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑬金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

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

⑭デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条の2）

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

⑮有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2. の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1) 1. 2. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑯公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

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

⑰公社債の借入れ（約款第28条）

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

⑱特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29条）

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

⑲外国為替予約の指図および範囲（約款第30条）

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

⑳資金の借入れ（約款第37条）

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

における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

②同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

○資産配分リスク

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

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

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

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

○リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

○為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

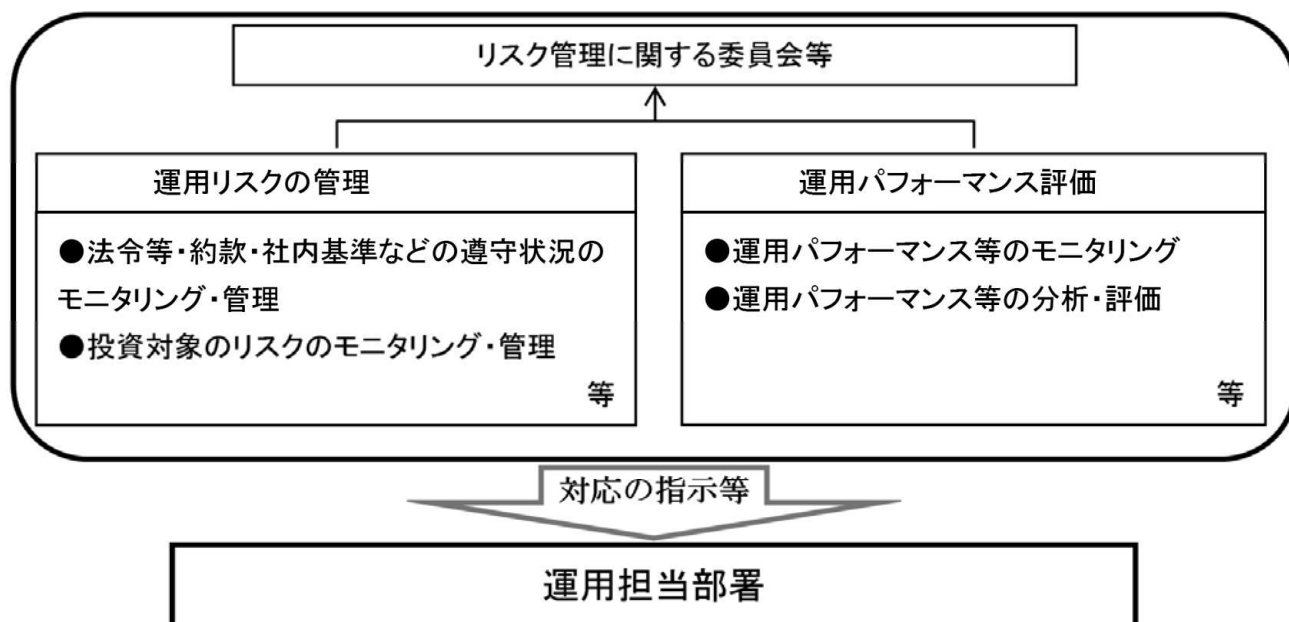
○注意事項

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

<リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：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、リスク管理に関する委員会等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。



※リスク管理体制は2021年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

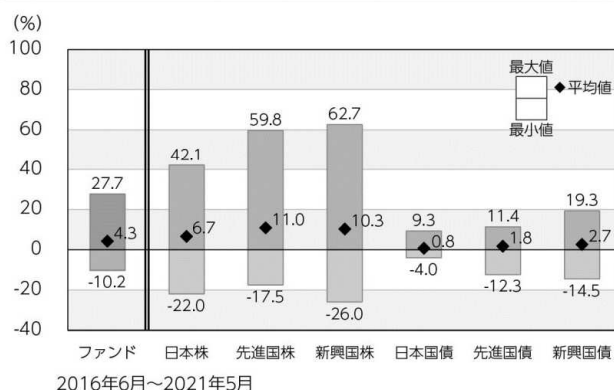
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数 (TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) 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は、(株東京証券取引所) 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、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

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

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

○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、2021年5月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

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

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の<収益分配金の課税について>を参照。）

<収益分配金の課税について>

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		415,868,038	98.85
	内 日本	415,868,038	98.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,838,076	1.15
純資産総額		420,706,114	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		344,410,376,370	96.65
	内 日本	344,410,376,370	96.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,950,801,476	3.35
純資産総額		356,361,177,846	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）		12,245,975,000	3.44
	内 日本	12,245,975,000	3.44

（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

2021年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		510,307,502,257	95.82
	内 アメリカ	349,113,888,500	65.55
	内 イギリス	23,184,146,146	4.35
	内 カナダ	19,364,872,685	3.64
	内 フランス	17,982,697,222	3.38
	内 スイス	17,519,016,505	3.29
	内 ドイツ	15,784,850,395	2.96
	内 オーストラリア	11,090,373,377	2.08
	内 オランダ	10,207,777,895	1.92
	内 アイルランド	9,638,476,563	1.81
	内 スウェーデン	6,005,301,435	1.13
	内 スペイン	4,464,295,152	0.84
	内 デンマーク	4,252,622,333	0.80
	内 香港	4,198,598,666	0.79
	内 イタリア	3,181,305,802	0.60

	内 ジェーシー	2,148,790,330	0.40
	内 フィンランド	2,095,831,249	0.39
	内 シンガポール	1,572,786,911	0.30
	内 ベルギー	1,468,185,226	0.28
	内 バミューダ	1,276,035,848	0.24
	内 ケイマン諸島	1,061,985,985	0.20
	内 ノルウェー	1,052,456,674	0.20
	内 イスラエル	971,103,300	0.18
	内 ルクセンブルグ	518,099,941	0.10
	内 ニュージーランド	514,944,210	0.10
	内 オランダ領キュラソー	425,755,450	0.08
	内 オーストリア	333,580,439	0.06
	内 ポルトガル	249,059,896	0.05
	内 パナマ	245,933,524	0.05
	内 リベリア	210,550,861	0.04
	内 マン島	127,350,650	0.02
	内 パプアニューギニア	46,829,087	0.01
投資信託受益証券		935,939,506	0.18
	内 オーストラリア	725,174,307	0.14
	内 シンガポール	210,765,199	0.04
投資証券		10,719,274,933	2.01
	内 アメリカ	9,887,285,456	1.86
	内 フランス	291,885,038	0.05
	内 イギリス	279,181,665	0.05
	内 香港	193,683,357	0.04
	内 カナダ	67,239,417	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,628,071,604	2.00
純資産総額		532,590,788,300	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	11,699,107,627	2.20
内 アメリカ	8,602,413,657	1.62
内 ドイツ	1,876,064,598	0.35
内 イギリス	546,428,300	0.10
内 カナダ	431,456,472	0.08
内 オーストラリア	242,744,600	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	300,544,994,500	85.53
内 日本	300,544,994,500	85.53

地方債証券		18,944,008,700	5.39
	内 日本	18,944,008,700	5.39
特殊債券		18,350,074,648	5.22
	内 日本	18,350,074,648	5.22
社債券		13,288,124,750	3.78
	内 日本	12,884,086,750	3.67
	内 フランス	404,038,000	0.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		281,111,955	0.08
純資産総額		351,408,314,553	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

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	137,979,457,506	98.90
内 アメリカ	61,022,402,560	43.74
内 フランス	14,350,019,834	10.29
内 イタリア	13,147,018,926	9.42
内 ドイツ	10,438,635,643	7.48
内 イギリス	9,106,172,847	6.53
内 スペイン	8,413,249,434	6.03
内 ベルギー	3,328,126,745	2.39
内 オーストラリア	3,044,325,008	2.18
内 カナダ	2,860,295,109	2.05
内 オランダ	2,725,424,025	1.95
内 オーストリア	2,105,375,231	1.51
内 アイルランド	1,170,636,810	0.84
内 メキシコ	1,090,368,498	0.78
内 ポーランド	886,589,315	0.64
内 フィンランド	863,871,580	0.62
内 デンマーク	697,863,028	0.50
内 マレーシア	637,806,032	0.46
内 イスラエル	624,609,615	0.45
内 シンガポール	612,013,044	0.44
内 スウェーデン	505,591,564	0.36
内 ノルウェー	349,062,658	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,531,235,086	1.10
純資産総額	139,510,692,592	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J－REITインデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	84,719,897,830	97.74
内 日本	84,719,897,830	97.74
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,959,591,740	2.26

純資産総額	86,679,489,570	100.00
-------	----------------	--------

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	1,938,722,500	2.24
内 日本	1,938,722,500	2.24

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	7,784,239,357	10.69
内 オーストラリア	5,093,804,410	7.00
内 シンガポール	2,690,434,947	3.70
投資証券	64,799,499,086	89.01
内 アメリカ	53,862,780,794	73.99
内 イギリス	4,108,108,644	5.64
内 フランス	1,803,293,930	2.48
内 カナダ	1,439,452,126	1.98
内 香港	1,150,087,279	1.58
内 ベルギー	980,237,783	1.35
内 スペイン	352,022,752	0.48
内 ニュージーランド	302,793,796	0.42
内 ドイツ	200,744,314	0.28
内 ガーンジー	192,979,552	0.27
内 オランダ	153,490,803	0.21
内 韓国	103,534,434	0.14
内 アイルランド	88,607,585	0.12
内 イスラエル	47,634,848	0.07
内 イタリア	13,730,446	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	216,871,013	0.30
純資産総額	72,800,609,456	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	91,048,387	1.3067 118,982,032	1.3054 118,854,564	— —	28.25

2	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	21, 200, 412	5. 1859 109, 943, 217	5. 2709 111, 745, 251	— —	26. 56
3	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	31, 447, 514	3. 1199 98, 113, 099	3. 1493 99, 037, 655	— —	23. 54
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14, 398, 368	2. 0268 29, 184, 052	2. 0477 29, 483, 538	— —	7. 01
5	J－R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12, 109, 534	2. 4191 29, 295, 384	2. 4284 29, 406, 792	— —	6. 99
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	18, 528, 218	1. 4521 26, 904, 826	1. 4756 27, 340, 238	— —	6. 50

（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

2021年5月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98. 85
合計	98. 85

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1, 322, 600	8, 189. 03 10, 830, 818, 210	9, 115. 00 12, 055, 499, 000	— —	3. 38
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	817, 700	11, 860. 35 9, 698, 211, 775	10, 785. 00 8, 818, 894, 500	— —	2. 47
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1, 016, 400	9, 473. 89 9, 629, 267, 579	8, 256. 00 8, 391, 398, 400	— —	2. 35
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	128, 100	55, 226. 12 7, 074, 466, 164	53, 870. 00 6, 900, 747, 000	— —	1. 94
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8, 807, 600	550. 81 4, 851, 375, 606	620. 00 5, 460, 712, 000	— —	1. 53
	任天堂	株式		63, 191. 68	67, 700. 00	—	

6	日本	その他製品	74,700	4,720,419,045	5,057,190,000	—	1.42
7	日本	株式会社 リクルートホールディングス サービス業	893,600	5,049.35 4,512,100,763	5,555.00 4,963,948,000	— —	1.39
8	日本	株式会社 信越化学工業 化学	236,400	18,243.13 4,312,677,523	18,855.00 4,457,322,000	— —	1.25
9	日本	株式会社 日本電信電話 情報・通信業	1,498,400	2,813.35 4,215,532,545	2,931.50 4,392,559,600	— —	1.23
10	日本	株式会社 武田薬品工業 医薬品	1,086,000	3,730.57 4,051,401,692	3,719.00 4,038,834,000	— —	1.13
11	日本	株式会社 日本電産 電気機器	314,300	13,816.57 4,342,549,449	12,530.00 3,938,179,000	— —	1.11
12	日本	株式会社 KDDI 情報・通信業	1,027,400	3,416.21 3,509,820,411	3,717.00 3,818,845,800	— —	1.07
13	日本	株式会社 東京エレクトロン 電気機器	76,500	42,787.18 3,273,219,400	48,660.00 3,722,490,000	— —	1.04
14	日本	株式会社 HOYA 精密機器	256,900	13,253.24 3,404,757,828	14,350.00 3,686,515,000	— —	1.03
15	日本	株式会社 日立製作所 電気機器	627,400	5,065.80 3,178,287,051	5,736.00 3,598,766,400	— —	1.01
16	日本	株式会社 ダイキン工業 機械	166,200	22,894.43 3,805,055,863	21,605.00 3,590,751,000	— —	1.01
17	日本	株式会社 三井住友フィナンシャルグループ 銀行業	891,100	3,715.74 3,311,098,913	3,951.00 3,520,736,100	— —	0.99
18	日本	株式会社 本田技研工業 輸送用機器	1,027,700	3,106.24 3,192,283,640	3,353.00 3,445,878,100	— —	0.97
19	日本	株式会社 村田製作所 電気機器	383,700	9,236.79 3,544,158,123	8,279.00 3,176,652,300	— —	0.89
20	日本	株式会社 ファナック 電気機器	114,600	27,706.29 3,175,141,542	26,300.00 3,013,980,000	— —	0.85
21	日本	株式会社 みずほフィナンシャルグループ 銀行業	1,749,500	1,569.18 2,745,282,853	1,673.00 2,926,913,500	— —	0.82
22	日本	株式会社 伊藤忠商事 卸売業	899,500	3,204.13 2,882,121,940	3,249.00 2,922,475,500	— —	0.82
23	日本	株式会社 第一三共 医薬品	1,025,500	3,138.32 3,218,356,057	2,530.00 2,594,515,000	— —	0.73
24	日本	株式会社 SMC 機械	38,100	64,680.05 2,464,310,178	65,520.00 2,496,312,000	— —	0.70
25	日本	株式会社 三井物産 卸売業	1,025,300	2,123.03 2,176,747,426	2,414.00 2,475,074,200	— —	0.69
26		株式会社 セブン&アイ・ホールディングス	503,000	4,378.81	4,736.00	—	0.67

	日本	小売業		2,202,541,857	2,382,208,000	—	
27	三菱商事	株式		2,907.85	2,984.00	—	
	日本	卸売業	782,600	2,275,684,605	2,335,278,400	—	0.66
28	三菱電機	株式		1,712.68	1,692.00	—	
	日本	電気機器	1,305,600	2,236,083,202	2,209,075,200	—	0.62
29	東京海上ホールディングス	株式		5,507.70	5,179.00	—	
	日本	保険業	423,900	2,334,715,468	2,195,378,100	—	0.62
30	オリエンタルランド	株式		17,318.30	16,310.00	—	
	日本	サービス業	132,700	2,298,139,088	2,164,337,000	—	0.61

(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

2021年5月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	96.65
合計	96.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	17.19
情報・通信業		8.72
輸送用機器		7.39
化学		7.13
機械		5.44
サービス業		5.42
銀行業		5.01
医薬品		4.91
卸売業		4.56
小売業		4.37
食料品		3.28
陸運業		3.21
精密機器		2.62
その他製品		2.48
建設業		2.25
不動産業		1.93
保険業		1.88
電気・ガス業		1.18
その他金融業		1.09
鉄鋼		0.81
証券、商品先物取引業		0.79
ガラス・土石製品		0.76
非鉄金属		0.74
ゴム製品		0.64
金属製品		0.60
繊維製品		0.47

空運業		0.46
石油・石炭製品		0.40
海運業		0.27
パルプ・紙		0.23
倉庫・運輸関連業		0.17
鉱業		0.16
水産・農林業		0.09
合計		96.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピューター・周辺機器	1,500,929	14,764.43 22,160,365,331	13,677.19 20,528,496,512	— —	3.85
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	640,513	26,880.77 17,217,486,575	27,404.87 17,553,179,853	— —	3.30
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	38,272	358,878.55 13,734,999,867	353,764.16 13,539,262,053	— —	2.54
4	FACEBOOK 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	215,091	29,955.97 6,443,260,784	36,081.40 7,760,785,439	— —	1.46
5	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	26,315	231,843.77 6,100,968,857	264,692.82 6,965,391,705	— —	1.31
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,922	230,693.65 6,210,734,700	258,687.85 6,964,394,459	— —	1.31
	JPMORGAN CHASE & CO	株式		15,677.17	18,026.98	—	

7	アメリカ	銀行	273,052	4,280,683,905	4,922,303,598	—	0.92
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	68,661	87,673.88 6,019,776,938	68,624.14 4,711,802,570	— —	0.88
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	235,044	18,238.14 4,286,767,712	18,576.87 4,366,384,182	— —	0.82
10	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	55,352	65,307.32 3,614,891,009	71,319.85 3,947,696,492	— —	0.74
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	122,504	26,886.38 3,293,690,039	31,768.93 3,891,821,539	— —	0.73
12	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	84,781	36,517.42 3,095,983,705	45,212.33 3,833,147,329	— —	0.72
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	151,655	23,190.03 3,516,884,980	24,948.44 3,783,556,881	— —	0.71
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	257,321	12,317.65 3,169,591,732	13,546.63 3,485,834,745	— —	0.65
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	96,206	30,654.57 2,949,153,978	35,003.56 3,367,552,647	— —	0.63
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	220,223	14,047.53 3,093,589,200	14,801.13 3,259,550,573	— —	0.61
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	695,277	3,725.60 2,590,325,903	4,652.72 3,234,933,653	— —	0.61
18	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	162,376	20,618.47 3,347,945,936	19,608.62 3,183,969,930	— —	0.60
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	79,307	37,780.16 2,996,231,297	39,577.26 3,138,753,822	— —	0.59
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	99,587	32,306.05 3,217,263,316	28,539.79 2,842,192,584	— —	0.53
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	37,580	66,031.38 2,481,459,372	73,864.60 2,775,831,743	— —	0.52
22	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	409,180	5,874.21 2,403,612,188	6,293.63 2,575,230,960	— —	0.48
	EXXON MOBIL CORP	株式		5,642.70	6,406.69	—	

23	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	379,256	2,140,029,967	2,429,776,077	—	0.46
24	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	63,104	38,109.74 2,404,877,647	38,474.79 2,427,913,526	— —	0.46
25	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	42,874	54,467.11 2,335,223,253	55,382.70 2,374,477,914	— —	0.45
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	369,913	5,970.60 2,208,604,193	6,200.34 2,293,587,258	— —	0.43
27	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	363,630	6,791.70 2,469,668,668	6,269.49 2,279,775,085	— —	0.43
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	365,880	5,583.28 2,042,812,930	6,068.63 2,220,390,490	— —	0.42
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	378,673	5,226.52 1,979,143,755	5,806.30 2,198,690,554	— —	0.41
30	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	39,668	60,715.40 2,408,458,644	55,188.42 2,189,214,466	— —	0.41

(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

2021年5月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	95.82
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.01
合計	98.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年5月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	6.90
銀行		6.41
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.54
医薬品		4.47
情報技術サービス		4.44
半導体・半導体製造装置		4.39
コンピュータ・周辺機器		4.16
資本市場		3.22
保険		3.18
石油・ガス・消耗燃料		3.08
インターネット販売・通信販売		3.05

ヘルスケア機器・用品
化学
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
ホテル・レストラン・レジャー
機械
電力
バイオテクノロジー
専門小売り
金属・鉱業
飲料
自動車
食品
航空宇宙・防衛
繊維・アパレル・贅沢品
娯楽
各種電気通信サービス
食品・生活必需品小売り
コングロマリット
メディア
陸運・鉄道
家庭用品
ライフサイエンス・ツール／サービス
各種金融サービス
電気設備
総合公益事業
専門サービス
航空貨物・物流サービス
通信機器
タバコ
パーソナル用品
建設関連製品
電子装置・機器・部品
複合小売り
消費者金融
不動産管理・開発
商業サービス・用品
家庭用耐久財
商社・流通業
無線通信サービス
容器・包装
自動車部品
建設資材
建設・土木
エネルギー設備・サービス
ヘルスケア・テクノロジー
ガス
運送インフラ

2.90
2.18
2.01
1.90
1.79
1.76
1.73
1.70
1.67
1.66
1.64
1.62
1.54
1.52
1.46
1.44
1.33
1.20
1.12
1.11
1.10
1.04
0.98
0.88
0.84
0.78
0.74
0.67
0.67
0.66
0.61
0.53
0.50
0.50
0.43
0.42
0.39
0.33
0.30
0.29
0.29
0.27
0.23
0.16
0.15
0.15
0.14

紙製品・林産品		0.11
水道		0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.10
販売		0.09
海運業		0.08
レジャー用品		0.07
旅客航空輸送業		0.06
合計		95.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	325回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	101.31 4,863,040,000	101.20 4,857,984,000	0.8 2022/9/20	1.38
2	420回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.39 4,317,114,000	100.37 4,316,039,000	0.1 2023/1/1	1.23
3	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.99 3,837,826,000	101.05 3,840,166,000	0.1 2028/3/20	1.09
4	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,650,000,000	102.29 3,733,786,000	102.24 3,732,088,500	0.4 2025/9/20	1.06
5	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,650,000,000	102.18 3,729,859,000	102.06 3,725,372,500	0.6 2024/3/20	1.06
6	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,670,000,000	101.05 3,708,549,000	101.01 3,707,397,300	0.1 2027/3/20	1.06
7	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,570,000,000	102.09 3,644,754,600	101.92 3,638,686,800	0.8 2023/6/20	1.04
8	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,550,000,000	102.28 3,631,016,500	102.16 3,626,715,500	0.8 2023/9/20	1.03
9	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,480,000,000	102.37 3,562,644,000	102.23 3,557,812,800	0.6 2024/6/20	1.01
10	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,430,000,000	102.01 3,499,202,000	102.00 3,498,737,200	0.4 2025/3/20	1.00
11	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,340,000,000	102.18 3,412,987,000	102.13 3,411,409,200	0.4 2025/6/20	0.97

12	3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 310, 000, 000	101. 91 3, 373, 359, 000	101. 87 3, 372, 095, 600	0. 3 2025/12/20	0. 96
13	3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 280, 000, 000	100. 98 3, 312, 177, 000	100. 96 3, 311, 619, 200	0. 1 2026/3/20	0. 94
14	3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 280, 000, 000	100. 96 3, 311, 607, 000	100. 96 3, 311, 619, 200	0. 1 2026/6/20	0. 94
15	3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 140, 000, 000	102. 18 3, 208, 546, 000	102. 07 3, 205, 092, 200	0. 5 2024/9/20	0. 91
16	3 6 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 190, 000, 000	100. 19 3, 196, 073, 700	100. 46 3, 204, 769, 700	0. 1 2030/9/20	0. 91
17	3 5 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 160, 000, 000	100. 38 3, 172, 300, 000	100. 54 3, 177, 095, 600	0. 1 2030/6/20	0. 90
18	3 4 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 110, 000, 000	101. 02 3, 141, 755, 000	101. 00 3, 141, 224, 400	0. 1 2026/12/20	0. 89
19	3 5 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 060, 000, 000	100. 95 3, 089, 114, 000	101. 02 3, 091, 365, 000	0. 1 2028/6/20	0. 88
20	1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証 券	3, 050, 000, 000	100. 88 3, 077, 128, 000	100. 91 3, 077, 938, 000	0. 1 2025/6/20	0. 88
21	3 5 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 020, 000, 000	100. 89 3, 047, 033, 000	100. 98 3, 049, 837, 600	0. 1 2028/9/20	0. 87
22	3 4 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	3, 010, 000, 000	101. 04 3, 041, 392, 200	101. 03 3, 041, 093, 300	0. 1 2027/6/20	0. 87
23	1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証 券	3, 000, 000, 000	100. 89 3, 026, 794, 000	100. 96 3, 028, 830, 000	0. 1 2025/12/20	0. 86
24	4 2 3 回 利付国庫債券 (2 年) 日本	国債証 券	3, 000, 000, 000	100. 26 3, 007, 990, 000	100. 25 3, 007, 710, 000	0. 005 2023/4/1	0. 86
25	3 4 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	2, 960, 000, 000	100. 98 2, 989, 029, 000	101. 05 2, 991, 139, 200	0. 1 2027/12/20	0. 85
26	1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証 券	2, 960, 000, 000	100. 79 2, 983, 433, 800	100. 74 2, 982, 081, 600	0. 1 2024/9/20	0. 85
27	3 5 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	2, 940, 000, 000	100. 87 2, 965, 743, 000	100. 94 2, 967, 783, 000	0. 1 2028/12/20	0. 84

28	1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証 券	2, 920, 000, 000	100. 70 2, 940, 725, 600	100. 66 2, 939, 272, 000	0. 1 2024/3/20	0. 84
29	1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証 券	2, 900, 000, 000	100. 96 2, 927, 963, 000	100. 95 2, 927, 579, 000	0. 1 2025/9/20	0. 83
30	3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	2, 860, 000, 000	102. 02 2, 917, 955, 000	101. 87 2, 913, 482, 000	0. 6 2023/12/20	0. 83

(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

2021年5月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	85. 53
地方債証券	5. 39
特殊債券	5. 22
社債券	3. 78
合計	99. 92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 2. 0 11/30/22 アメリカ	国債証 券	723, 318, 400	103. 34 747, 504, 358	102. 85 744, 000, 785	2 2022/11/30	0. 53
2	US T N/B 1. 125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	752, 953, 600	95. 88 721, 954, 808	95. 96 722, 600, 156	1. 125 2031/2/15	0. 52
3	US T N/B 0. 875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	702, 464, 000	95. 89 673, 651, 995	94. 08 660, 919, 835	0. 875 2030/11/15	0. 47
4	US T N/B 2. 75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	605, 875, 200	107. 02 648, 428, 462	106. 25 643, 789, 730	2. 75 2023/11/15	0. 46
5	US T N/B 1. 625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	616, 851, 200	102. 61 632, 971, 254	102. 21 630, 489, 390	1. 625 2022/11/15	0. 45
6	US T N/B 0. 625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	681, 609, 600	93. 92 640, 233, 763	92. 22 628, 598, 475	0. 625 2030/8/15	0. 45
7	US T N/B 2. 125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	605, 875, 200	103. 73 628, 500, 852	103. 19 625, 234, 802	2. 125 2022/12/31	0. 45
8	US T N/B 2. 75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	583, 923, 200	107. 55 628, 036, 769	106. 78 623, 520, 492	2. 75 2024/2/15	0. 45
9	US T N/B 2. 0 08/15/25 アメリカ	国債証 券	568, 556, 800	106. 80 607, 245, 309	105. 80 601, 581, 949	2 2025/8/15	0. 43
10	US T N/B 1. 75 09/30/22 アメリカ	国債証 券	576, 240, 000	102. 64 591, 456, 337	102. 20 588, 957, 794	1. 75 2022/9/30	0. 42

11	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証 券	586,118,400	100.02 586,278,661	100.03 586,347,349	0.125 2022/11/30	0.42
12	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証 券	546,604,800	103.17 563,985,121	102.71 561,444,261	1.75 2023/1/31	0.40
13	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	514,774,400	108.07 556,357,876	107.00 550,808,608	2.25 2025/11/15	0.39
14	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証 券	548,800,000	100.10 549,397,363	100.29 550,429,250	0.375 2024/4/15	0.39
15	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証 券	523,555,200	105.67 553,250,595	105.06 550,080,631	2 2024/5/31	0.39
16	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証 券	548,800,000	99.57 546,475,349	99.74 547,406,558	0.125 2024/1/15	0.39
17	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	514,774,400	107.10 551,331,422	106.28 547,108,666	2.25 2024/11/15	0.39
18	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	486,236,800	113.13 550,093,363	110.96 539,532,908	2.875 2028/5/15	0.39
19	US T N/B 2.0 11/15/26 アメリカ	国債証 券	509,286,400	106.50 542,418,419	105.80 538,848,880	2 2026/11/15	0.39
20	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	308,939,400	179.14 553,435,060	172.52 533,003,878	4.5 2041/4/25	0.38
21	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証 券	572,947,200	92.50 530,030,996	92.46 529,785,923	0.625 2030/5/15	0.38
22	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	479,651,200	112.14 537,921,321	110.19 528,571,869	2.75 2028/2/15	0.38
23	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証 券	527,945,600	99.75 526,631,015	100.01 528,048,712	0.25 2024/3/15	0.38
24	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証 券	438,667,200	120.87 530,237,239	119.60 524,687,205	2.75 2027/10/25	0.38
25	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証 券	497,212,800	102.75 510,886,152	102.21 508,225,282	2.125 2022/6/30	0.36
26	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証 券	475,260,800	105.81 502,885,334	105.14 499,692,175	2.5 2023/8/15	0.36
27	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証 券	471,968,000	106.45 502,424,095	105.65 498,645,249	2 2025/2/15	0.36
28	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	465,382,400	107.26 499,195,340	106.53 495,777,688	2.5 2024/5/15	0.36
29	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証 券	479,651,200	103.72 497,525,698	103.23 495,146,178	2 2023/2/15	0.35
30	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	451,113,600	111.60 503,449,821	109.36 493,352,632	2.625 2029/2/15	0.35

(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

2021年5月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.90
合計	98.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	8,523	660,077.78 5,625,842,945	694,000.00 5,914,962,000	— —	6.82
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	7,573	629,176.22 4,764,751,525	660,000.00 4,998,180,000	— —	5.77
3	G L P 投資法人 日本	投資証券	23,663	167,867.88 3,972,257,756	186,900.00 4,422,614,700	— —	5.10
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	24,489	159,469.22 3,905,241,855	173,400.00 4,246,392,600	— —	4.90
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	37,719	97,580.13 3,680,625,277	110,800.00 4,179,265,200	— —	4.82
6	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	11,972	329,465.57 3,944,361,866	339,500.00 4,064,494,000	— —	4.69
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	10,805	280,577.93 3,031,644,637	306,000.00 3,306,330,000	— —	3.81
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	15,089	179,695.10 2,711,419,501	203,500.00 3,070,611,500	— —	3.54
9	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	16,195	144,360.05 2,337,911,054	157,000.00 2,542,615,000	— —	2.93
10	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	7,193	329,011.53 2,366,579,994	352,000.00 2,531,936,000	— —	2.92
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	10,704	183,621.81 1,965,487,947	196,000.00 2,097,984,000	— —	2.42
12	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	4,715	383,099.54 1,806,314,374	430,500.00 2,029,807,500	— —	2.34
13	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	22,273	82,387.50 1,835,016,818	90,600.00 2,017,933,800	— —	2.33
14	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証券	2,343	718,838.57 1,684,238,785	812,000.00 1,902,516,000	— —	2.19
15	アクティビア・プロパティ ーズ投資法人 日本	投資証券	3,795	456,819.00 1,733,628,117	498,500.00 1,891,807,500	— —	2.18

16	日本アコモデーションファン ド投資法人 日本	投資証 券	2,610	617,608.21 1,611,957,429	634,000.00 1,654,740,000	— —	1.91
17	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証 券	24,396	59,212.01 1,444,536,258	67,200.00 1,639,411,200	— —	1.89
18	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証 券	9,160	167,521.62 1,534,498,080	178,500.00 1,635,060,000	— —	1.89
19	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証 券	4,948	301,116.36 1,489,923,762	309,000.00 1,528,932,000	— —	1.76
20	三井不動産ロジスティクス パーク投資法人 日本	投資証 券	2,643	518,328.14 1,369,941,282	562,000.00 1,485,366,000	— —	1.71
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証 券	31,664	38,554.92 1,220,803,107	44,600.00 1,412,214,400	— —	1.63
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証 券	8,895	148,903.10 1,324,493,084	157,800.00 1,403,631,000	— —	1.62
23	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証 券	2,513	432,845.41 1,087,740,536	504,000.00 1,266,552,000	— —	1.46
24	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証 券	1,613	705,464.38 1,137,914,052	778,000.00 1,254,914,000	— —	1.45
25	イオンリート投資法人 日本	投資証 券	7,681	137,624.54 1,057,094,127	154,100.00 1,183,642,100	— —	1.37
26	ケネディクス・レジデンシ ャル・ネクスト投資法人 日本	投資証 券	5,161	199,676.92 1,030,532,588	225,200.00 1,162,257,200	— —	1.34
27	コンフォリア・レジデンシ ャル投資法人 日本	投資証 券	3,405	322,297.79 1,097,423,986	339,000.00 1,154,295,000	— —	1.33
28	大和証券リビング投資法人 日本	投資証 券	9,889	104,625.38 1,034,640,455	112,000.00 1,107,568,000	— —	1.28
29	ジャパンエクセレント投資 法人 日本	投資証 券	7,027	139,995.70 983,749,815	157,200.00 1,104,644,400	— —	1.27
30	ヒューリックリート投資法 人 日本	投資証 券	6,278	162,094.38 1,017,628,524	174,900.00 1,098,022,200	— —	1.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.74
合計	97.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	336,380	11,418.17 3,840,844,451	12,934.11 4,350,778,747	— —	5.98
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	40,568	77,749.28 3,154,132,950	80,862.38 3,280,425,323	— —	4.51
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	69,112	26,187.90 1,809,898,538	31,005.00 2,142,817,891	— —	2.94
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	127,766	15,618.49 1,995,512,517	16,635.22 2,125,416,234	— —	2.92
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	149,302	11,065.66 1,652,126,039	14,103.06 2,105,615,422	— —	2.89
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	189,753	7,291.31 1,383,549,252	8,206.75 1,557,256,419	— —	2.14
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	63,440	19,558.95 1,240,819,810	22,713.73 1,440,959,310	— —	1.98
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	155,903	7,350.88 1,146,024,484	8,500.91 1,325,317,683	— —	1.82
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	169,794	6,905.02 1,172,431,484	7,507.58 1,274,742,717	— —	1.75
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	764,516	1,492.78 1,141,257,601	1,634.93 1,249,931,214	— —	1.72
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	57,820	18,389.08 1,063,256,907	19,565.81 1,131,295,573	— —	1.55
12	VENTAS INC アメリカ	投資証券	170,428	5,427.24 924,953,969	6,086.19 1,037,257,530	— —	1.42
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	258,029	3,403.70 878,255,355	3,980.99 1,027,212,210	— —	1.41
14	LINK REIT 香港	投資証券	944,420	993.84 938,606,626	1,058.37 999,554,295	— —	1.37
15	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	60,068	13,616.17 817,896,103	16,443.14 987,706,869	— —	1.36
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	29,609	28,917.91 856,230,678	32,411.03 959,658,199	— —	1.32
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	50,783	16,598.07 842,900,295	18,376.01 933,189,383	— —	1.28
18	MID AMERICA アメリカ	投資証券	52,047	15,040.04 782,789,029	17,638.43 918,027,470	— —	1.26
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	245,111	3,346.88 820,357,766	3,663.78 898,034,936	— —	1.23
	SEGRO PLC			1,479.68	1,623.68	—	

20	イギリス	投資証券	542,212	802,302,493	880,382,033	—	1.21
21	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	170,302	4,484.54 763,726,326	5,099.44 868,446,465	— —	1.19
22	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	244,544	2,997.23 732,955,310	3,416.82 835,564,982	— —	1.15
23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	64,608	11,016.68 711,766,088	12,903.38 833,661,936	— —	1.15
24	UDR INC アメリカ	投資証券	135,309	4,603.10 622,841,961	5,227.86 707,377,699	— —	0.97
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	79,364	7,707.91 611,730,627	8,281.39 657,244,394	— —	0.90
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	130,721	3,787.44 495,098,762	4,778.95 624,709,175	— —	0.86
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	262,880	2,275.64 598,221,843	2,323.61 610,833,015	— —	0.84
28	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD フランス	投資証券	63,071	8,384.95 528,847,535	9,652.01 608,762,288	— —	0.84
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	44,221	11,723.21 518,412,160	13,761.70 608,556,524	— —	0.84
30	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	319,741	1,670.41 534,100,599	1,884.57 602,577,237	— —	0.83

(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

2021年5月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	10.69
投資証券	89.01
合計	99.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先 物取引	大阪取引所	T O P I X 先物 0 3 0 6 月	買建	635	12, 280, 504, 550	12, 245, 975, 000	3. 44

(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

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先 物取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Jun21	買建	373	8, 487, 069, 892	8, 602, 413, 657	1. 62
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun21	買建	345	1, 848, 669, 296	1, 876, 064, 598	0. 35
	I C E－E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun21	買建	50	545, 405, 230	546, 428, 300	0. 10
	モントリオ ール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun21	買建	20	424, 978, 086	431, 456, 472	0. 08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Jun21	買建	16	238, 234, 371	242, 744, 600	0. 05

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信 指数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0306月	買建	935	1,801,652,980	1,938,722,500	2.24

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2021年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第10特定期間末 (2011年11月11日)	712	714	0.5956	0.5971
第11特定期間末 (2012年5月11日)	692	694	0.6202	0.6217
第12特定期間末 (2012年11月12日)	652	653	0.6218	0.6233
第13特定期間末 (2013年5月13日)	824	825	0.8225	0.8240
第14特定期間末 (2013年11月11日)	736	738	0.8118	0.8133
第15特定期間末 (2014年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末 (2014年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383
第17特定期間末 (2015年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末 (2015年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末 (2016年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369
第20特定期間末 (2016年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220
第21特定期間末 (2017年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (2017年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585
第23特定期間末 (2018年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580

第24特定期間末 (2018年11月12日)	428	428	1. 0434	1. 0449
第25特定期間末 (2019年5月13日)	411	411	1. 0361	1. 0376
第26特定期間末 (2019年11月11日)	430	431	1. 0940	1. 0955
第27特定期間末 (2020年5月11日)	370	371	0. 9993	1. 0008
第28特定期間末 (2020年11月11日)	401	401	1. 1046	1. 1061
第29特定期間末 (2021年5月11日)	421	421	1. 2325	1. 2340
2020年5月末日	383	—	1. 0297	—
6月末日	383	—	1. 0341	—
7月末日	383	—	1. 0343	—
8月末日	396	—	1. 0803	—
9月末日	390	—	1. 0673	—
10月末日	380	—	1. 0437	—
11月末日	400	—	1. 1153	—
12月末日	402	—	1. 1380	—
2021年1月末日	402	—	1. 1469	—
2月末日	406	—	1. 1716	—
3月末日	423	—	1. 2200	—
4月末日	420	—	1. 2321	—
5月末日	420	—	1. 2424	—

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第10特定期間	0. 0045
第11特定期間	0. 0045
第12特定期間	0. 0045
第13特定期間	0. 0045
第14特定期間	0. 0045
第15特定期間	0. 0045
第16特定期間	0. 0045
第17特定期間	0. 0045
第18特定期間	0. 0045
第19特定期間	0. 0045
第20特定期間	0. 0045
第21特定期間	0. 0045
第22特定期間	0. 0045
第23特定期間	0. 0045
第24特定期間	0. 0045
第25特定期間	0. 0045
第26特定期間	0. 0045
第27特定期間	0. 0045
第28特定期間	0. 0045

第29特定期間	0.0045
---------	--------

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第10特定期間	△7.5
第11特定期間	4.9
第12特定期間	1.0
第13特定期間	33.0
第14特定期間	△0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	△1.0
第19特定期間	△5.5
第20特定期間	△1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	△0.8
第25特定期間	△0.3
第26特定期間	6.0
第27特定期間	△8.2
第28特定期間	11.0
第29特定期間	12.0

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第10特定期間	7,120,000	79,920,000
第11特定期間	10,800,000	90,460,000
第12特定期間	3,810,000	71,430,000
第13特定期間	22,800,000	69,530,000
第14特定期間	13,700,000	108,500,000
第15特定期間	52,399,738	112,932,769
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662
第25特定期間	6,012,015	19,263,147
第26特定期間	13,077,272	16,654,903
第27特定期間	11,204,748	33,518,095

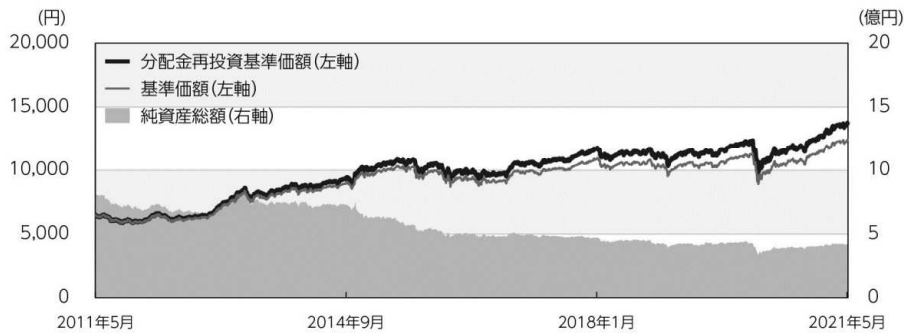
第28特定期間	4, 242, 197	12, 089, 221
第29特定期間	7, 387, 321	28, 854, 017

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2021年5月31日

基準価額・純資産の推移 《2011年5月31日～2021年5月31日》



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

分配の推移(税引前)

2020年 9月	15円
2020年11月	15円
2021年 1月	15円
2021年 3月	15円
2021年 5月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	1,785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	28.25
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.56
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	23.54
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.01
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.99
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.50

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.38
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.47
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.35
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.94
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.53

■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	3.85
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.30
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.54
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.46
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.31

○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	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.38
2	420回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2023/1/1	1.23
3	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.09
4	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	1.06
5	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.06

■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 2.0 11/30/22	国債証券	アメリカ	2	2022/11/30	0.53
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.52
3	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.47
4	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.46
5	US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	アメリカ	1.625	2022/11/15	0.45

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.82
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.77
3	GLP投資法人	投資証券	日本	5.10
4	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.90
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.82

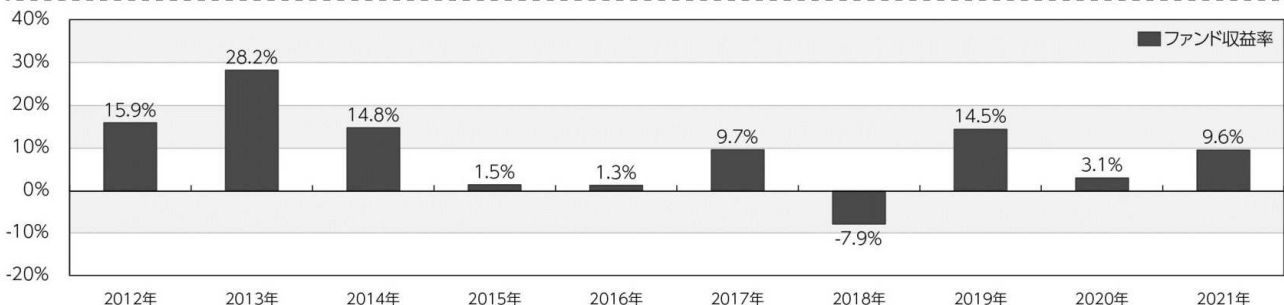
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	5.98
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.51
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.94
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.92
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.89

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。

※2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

- ・お申込手数料

ありません。

- ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

※お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※当初元本は1口当たり1円です。

- ・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

- ・ 解約価額

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

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ

- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は2007年1月26日から無期限です。

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

(4)【計算期間】

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

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

（５）【その他】

イ. 償還規定

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

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

ロ. 信託約款の変更

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

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

ニ. 公告

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

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

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

ホ. 運用報告書

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

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

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

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

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2020年11月12日から2021年5月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2021年6月18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 丘本 正彦 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の2020年11月12日から2021年5月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞の2021年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

1【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2020年11月11日現在	当期 2021年5月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,162,555	5,534,625
親投資信託受益証券	397,556,486	416,708,764
流動資産合計	403,719,041	422,243,389
資産合計	403,719,041	422,243,389
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	544,922	512,722
未払解約金	1,524,895	37,429
未払受託者報酬	28,738	30,917
未払委託者報酬	330,646	355,667
その他未払費用	2,535	2,732
流動負債合計	2,431,736	939,467
負債合計	2,431,736	939,467
純資産の部		
元本等		
元本	363,281,768	341,815,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	38,005,537	79,488,850
（分配準備積立金）	60,046,121	91,414,516
元本等合計	401,287,305	421,303,922
純資産合計	401,287,305	421,303,922
負債純資産合計	403,719,041	422,243,389

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2020年5月12日 至 2020年11月11日	当期 自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
営業収益		
受取利息	—	3
有価証券売買等損益	41,608,279	47,454,278
営業収益合計	41,608,279	47,454,281
営業費用		
支払利息	1,185	449
受託者報酬	86,095	89,465
委託者報酬	990,502	1,029,180
その他費用	7,654	7,889
営業費用合計	1,085,436	1,126,983
営業利益又は営業損失 (△)	40,522,843	46,327,298
経常利益又は経常損失 (△)	40,522,843	46,327,298
当期純利益又は当期純損失 (△)	40,522,843	46,327,298
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 (△)	270,093	496,577
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△248,628	38,005,537
剰余金増加額又は欠損金減少額	183,142	1,444,970
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	183,142	1,444,970
剰余金減少額又は欠損金増加額	531,461	4,231,456
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	531,461	4,231,456
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	1,650,266	1,560,922
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	38,005,537	79,488,850

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2020年11月11日現在	2021年5月11日現在
1. 期首元本額	371,128,792円	363,281,768円
期中追加設定元本額	4,242,197円	7,387,321円
期中一部解約元本額	12,089,221円	28,854,017円
2. 受益権の総数	363,281,768口	341,815,072口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年5月12日 至 2020年11月11日	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年5月12日 至2020年7月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,040,252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(11,126,002円)及び分配準備積立金(59,967,186円)より分配対象収益は72,133,440円(1万口当たり1,943.70円)であり、うち556,669円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自2020年7月14日 至2020年9月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(827,200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(11,225,094円)及び分配準備積立金(59,324,620円)より分配対象収益は71,376,914円(1万口当たり1,951.34円)であり、うち548,675円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2020年11月12日 至2021年1月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(916,550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(8,954,869円)、信託約款に規定される収益調整金(11,068,659円)及び分配準備積立金(58,109,318円)より分配対象収益は79,049,396円(1万口当たり2,243.55円)であり、うち528,510円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年1月13日 至2021年3月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(875,075円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(15,026,128円)、信託約款に規定される収益調整金(11,309,704円)及び分配準備積立金(65,901,838円)より分配対象収益は93,112,745円(1万口当たり2,687.54円)であり、うち519,690円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>

	<p>（自2020年9月12日 至2020年11月11日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,526,414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（11,279,828円）及び分配準備積立金（59,064,629円）より分配対象収益は71,870,871円（1万口当たり1,978.37円）であり、うち544,922円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2021年3月12日 至2021年5月11日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,726,465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（11,020,595円）、信託約款に規定される収益調整金（12,175,430円）及び分配準備積立金（79,180,178円）より分配対象収益は104,102,668円（1万口当たり3,045.58円）であり、うち512,722円（1万口当たり15円）を分配金額としております。</p>
--	---	--

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自 2020年5月12日 至 2020年11月11日	当期 自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 2020年11月11日現在	当期 2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 2020年11月11日現在	当期 2021年5月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	13,696,438	13,246,184
合計	13,696,438	13,246,184

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前期 2020年11月11日現在	当期 2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.1046円	1.2325円

(1万口当たり純資産額)	(11,046円)	(12,325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

2021年5月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	31,789,513	99,180,101	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	92,027,879	120,262,032	
	J－R E I Tインデックスフ ァンド・マザーファンド	12,233,129	29,594,385	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	21,408,640	111,023,066	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	14,546,557	29,484,416	
	外国リート・パッシブ・ファ ンド・マザーファンド	18,707,227	27,164,764	
親投資信託受益証券 合計		190,712,945	416,708,764	
合計			416,708,764	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2021年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,659,903,410
株式	341,151,143,760
派生商品評価勘定	2,873,880
未収配当金	2,828,121,602
前払金	335,000
差入委託証拠金	352,275,000
流動資産合計	353,994,652,652
資産合計	353,994,652,652
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	196,388,650
未払解約金	4,465,011,000
流動負債合計	4,661,399,650
負債合計	4,661,399,650
純資産の部	
元本等	
元本	111,968,253,392
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	237,364,999,610
元本等合計	349,333,253,002
純資産合計	349,333,253,002
負債純資産合計	353,994,652,652

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	95,587,668,609円
同期中追加設定元本額	47,333,477,727円
同期中一部解約元本額	30,952,892,944円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	16,685,631,275円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,385,952,302円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,756,948円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,658,570円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	8,975,037円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	27,556,482円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	22,791,596円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	12,708,930円
たわらノーロード TOPIX	948,335,194円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	714,455,248円
たわらノーロード バランス（堅実型）	26,663,545円
たわらノーロード バランス（標準型）	167,759,957円
たわらノーロード バランス（積極型）	250,324,149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）	1,996,360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）	113,523,812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）	270,126,954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）	185,870,042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）	264,889,583円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	501,107円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,280,673円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	7,109,997円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	3,314,493円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	7, 122, 553円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	34, 390, 315, 581円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	997, 133, 845円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3, 353, 144, 978円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3, 444, 275, 693円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	324, 563, 721円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1, 126, 818, 055円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1, 075, 654, 313円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31, 789, 513円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1, 023, 706, 018円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	21, 497, 518円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	302, 674, 443円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	262, 181, 127円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	467, 717, 921円
投資のソムリエ	19, 624, 569, 285円
クルーズコントロール	428, 526, 113円
投資のソムリエ<DC年金>	1, 043, 917, 762円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	287, 321, 539円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	393, 795, 453円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	5, 013, 149円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	12, 499, 988円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	494, 794, 218円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5, 328, 501, 104円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	21, 678, 429円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	10, 394, 201円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4, 794, 341円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	48, 677, 691円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	114, 868, 204円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2, 943, 353, 338円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	264, 083, 954円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	12, 591, 279円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	6, 283, 207円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	6, 484, 274円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	13, 408, 023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)	46, 165, 729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)	56, 585, 429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)	68, 321, 700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)	28, 675, 749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)	45, 213, 083円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	127, 353, 070円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	435, 951, 476円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	39, 999, 523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)	444, 161, 248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）	75,391,998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）	64,604,481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）	109,119,074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）	7,707,703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）	31,417,463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）	7,683,993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）	2,013,885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）	14,159,837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）	38,931,385円
D I A Mバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	635,524,739円
D I A Mバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	692,558,083円
D I A Mバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,976,912,297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）	99,591,697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）	34,341,063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）	335,002,282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）	90,168,895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）	1,564,848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）	436,200,914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）	23,537,221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）	93,474,376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）	223,662,528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）	296,222,175円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	42,274,657円
D I A M国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	19,209,499円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA（1212）（適格機関投資家限定）	321,266,809円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA（1303）（適格機関投資家限定）	992,662,363円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA（1306）（適格機関投資家限定）	1,314,318,490円
D I A M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）	52,594,563円
MHAMトピックスファンド	637,375,982円
計	111,968,253,392円
2. 受益権の総数	111,968,253,392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 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。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	2021年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△5,098,455,617
合計	△5,098,455,617

（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（2021年2月9日から2021年5月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年5月11日現在			
	契約額等 (円)	うち 1 年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買建	9,144,225,000	—	8,950,865,000	△193,360,000
合計	9,144,225,000	—	8,950,865,000	△193,360,000

(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。

(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)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	3.1199円
(1万口当たり純資産額)	(31,199円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年5月11日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,900	2,984.00	17,605,600	
日本水産	164,200	530.00	87,026,000	
マルハニチロ	27,700	2,674.00	74,069,800	
ハウスイ	800	985.00	788,000	
雪国まいたけ	14,500	1,949.00	28,260,500	
カネコ種苗	5,100	1,560.00	7,956,000	
サカタのタネ	21,100	3,795.00	80,074,500	
ホクト	15,000	2,017.00	30,255,000	
ホクリョウ	2,500	722.00	1,805,000	
ヒノキヤグループ	4,300	2,530.00	10,879,000	
ショーボンドホールディングス	25,300	4,570.00	115,621,000	
ミライト・ホールディングス	61,500	1,774.00	109,101,000	
タマホーム	10,800	2,440.00	26,352,000	
サンヨーホームズ	2,500	742.00	1,855,000	
日本アクア	7,100	607.00	4,309,700	

ファーストコーポレーション	5,500	770.00	4,235,000	
ベステラ	3,200	1,588.00	5,081,600	
R o b o t H o m e	32,800	174.00	5,707,200	
キャンディル	3,000	539.00	1,617,000	
スペースバリューホールディングス	21,600	753.00	16,264,800	
住石ホールディングス	30,500	129.00	3,934,500	
日鉄鉱業	4,200	6,640.00	27,888,000	
三井松島ホールディングス	7,400	970.00	7,178,000	
I N P E X	650,900	806.00	524,625,400	
石油資源開発	23,300	2,214.00	51,586,200	
K&Oエナジーグループ	8,400	1,437.00	12,070,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,300	942.00	3,108,600	
第一カッター興業	4,300	1,379.00	5,929,700	
明豊ファシリティワークス	5,800	785.00	4,553,000	
安藤・間	113,300	850.00	96,305,000	
東急建設	51,900	582.00	30,205,800	
コムシスホールディングス	62,700	3,505.00	219,763,500	
ビーアールホールディングス	20,800	562.00	11,689,600	
高松コンストラクショングループ	11,100	2,050.00	22,755,000	
東建コーポレーション	5,500	9,870.00	54,285,000	
ソネック	1,800	924.00	1,663,200	
ヤマウラ	7,900	903.00	7,133,700	
オリエンタル白石	59,300	299.00	17,730,700	
大成建設	127,200	4,150.00	527,880,000	
大林組	408,800	1,029.00	420,655,200	
清水建設	383,100	910.00	348,621,000	
飛島建設	11,400	1,115.00	12,711,000	
長谷工コーポレーション	133,800	1,520.00	203,376,000	
松井建設	16,500	718.00	11,847,000	
銭高組	1,300	4,500.00	5,850,000	
鹿島建設	299,600	1,559.00	467,076,400	
不動テトラ	9,900	1,871.00	18,522,900	
大末建設	5,500	953.00	5,241,500	
鉄建建設	8,200	1,843.00	15,112,600	
西松建設	29,200	3,190.00	93,148,000	
三井住友建設	98,700	476.00	46,981,200	
大豊建設	9,000	4,090.00	36,810,000	
前田建設工業	102,500	956.00	97,990,000	
佐田建設	7,400	431.00	3,189,400	
ナカノフドー建設	10,700	378.00	4,044,600	
奥村組	22,400	2,731.00	61,174,400	
東鉄工業	17,600	2,579.00	45,390,400	
イチケン	2,800	1,906.00	5,336,800	
富士ピー・エス	5,600	590.00	3,304,000	
浅沼組	4,800	4,500.00	21,600,000	
戸田建設	169,900	785.00	133,371,500	
熊谷組	18,900	3,155.00	59,629,500	

北野建設	2,200	2,413.00	5,308,600	
植木組	3,400	1,519.00	5,164,600	
矢作建設工業	18,300	783.00	14,328,900	
ピーエス三菱	13,400	651.00	8,723,400	
日本ハウスホールディングス	28,100	330.00	9,273,000	
大東建託	44,800	11,260.00	504,448,000	
新日本建設	17,400	845.00	14,703,000	
N I P P O	33,900	2,892.00	98,038,800	
東亜道路工業	2,500	4,480.00	11,200,000	
前田道路	25,300	2,144.00	54,243,200	
日本道路	4,100	8,030.00	32,923,000	
東亜建設工業	10,900	2,455.00	26,759,500	
日本国土開発	40,100	607.00	24,340,700	
若築建設	7,400	1,289.00	9,538,600	
東洋建設	46,000	587.00	27,002,000	
五洋建設	173,800	845.00	146,861,000	
世紀東急工業	19,600	896.00	17,561,600	
福田組	4,700	4,840.00	22,748,000	
日本ドライケミカル	3,200	1,692.00	5,414,400	
住友林業	96,200	2,398.00	230,687,600	
日本基礎技術	12,900	511.00	6,591,900	
巴コーポレーション	18,300	376.00	6,880,800	
大和ハウス工業	377,500	3,371.00	1,272,552,500	
ライト工業	23,600	1,771.00	41,795,600	
積水ハウス	443,300	2,254.50	999,419,850	
日特建設	10,800	792.00	8,553,600	
北陸電気工事	7,300	1,133.00	8,270,900	
ユアテック	23,400	777.00	18,181,800	
日本リーテック	8,400	1,754.00	14,733,600	
四電工	1,800	3,245.00	5,841,000	
中電工	18,900	2,336.00	44,150,400	
関電工	66,700	944.00	62,964,800	
きんでん	83,000	1,852.00	153,716,000	
東京エネシス	13,500	945.00	12,757,500	
トーエネック	4,200	3,835.00	16,107,000	
住友電設	11,500	2,304.00	26,496,000	
日本電設工業	22,400	1,761.00	39,446,400	
協和エクシオ	61,900	2,950.00	182,605,000	
新日本空調	10,800	2,200.00	23,760,000	
日本工営	8,000	3,065.00	24,520,000	
九電工	29,000	3,750.00	108,750,000	
三機工業	29,100	1,402.00	40,798,200	
日揮ホールディングス	136,200	1,271.00	173,110,200	
中外炉工業	4,400	2,130.00	9,372,000	
ヤマト	13,100	674.00	8,829,400	
太平電業	9,200	2,652.00	24,398,400	
高砂熱学工業	37,100	1,684.00	62,476,400	

三晃金属工業	1,700	2,672.00	4,542,400	
NEC ネットエスアイ	42,200	1,842.00	77,732,400	
朝日工業社	2,400	2,881.00	6,914,400	
明星工業	26,600	771.00	20,508,600	
大気社	19,800	2,931.00	58,033,800	
ダイダン	9,200	2,754.00	25,336,800	
日比谷総合設備	13,500	1,896.00	25,596,000	
ニッポン	38,800	1,601.00	62,118,800	
日清製粉グループ本社	147,800	1,815.00	268,257,000	
日東富士製粉	800	7,090.00	5,672,000	
昭和産業	11,100	3,025.00	33,577,500	
鳥越製粉	11,800	806.00	9,510,800	
中部飼料	16,100	1,382.00	22,250,200	
フィード・ワン	18,000	876.00	15,768,000	
東洋精糖	1,800	1,200.00	2,160,000	
日本甜菜製糖	7,200	1,616.00	11,635,200	
DM三井製糖ホールディングス	10,600	1,855.00	19,663,000	
塩水港精糖	15,700	230.00	3,611,000	
日新製糖	5,000	1,775.00	8,875,000	
LIFULL	43,100	387.00	16,679,700	
ミクシィ	31,700	2,691.00	85,304,700	
ジェイエイシーリクルートメント	8,200	1,727.00	14,161,400	
日本M&Aセンター	204,200	2,608.00	532,553,600	
メンバーズ	3,600	2,787.00	10,033,200	
中広	1,300	346.00	449,800	
UTグループ	18,000	3,380.00	60,840,000	
アイティメディア	4,200	1,847.00	7,757,400	
タケエイ	13,900	1,263.00	17,555,700	
E・Jホールディングス	4,800	1,134.00	5,443,200	
夢真ビーネックスグループ	33,000	1,415.00	46,695,000	
コシダカホールディングス	33,300	558.00	18,581,400	
アルトナー	3,000	801.00	2,403,000	
パソナグループ	13,500	1,872.00	25,272,000	
CDS	2,500	1,557.00	3,892,500	
リンクアンドモチベーション	22,600	654.00	14,780,400	
GCA	16,000	833.00	13,328,000	
エス・エム・エス	42,200	2,905.00	122,591,000	
サニーサイドアップグループ	4,300	750.00	3,225,000	
パーソルホールディングス	124,600	2,017.00	251,318,200	
リニカル	7,200	730.00	5,256,000	
クックパッド	39,000	270.00	10,530,000	
エスクリ	4,100	413.00	1,693,300	
アイ・ケイ・ケイ	6,000	650.00	3,900,000	
森永製菓	30,700	3,680.00	112,976,000	
中村屋	2,600	3,830.00	9,958,000	
江崎グリコ	36,000	4,335.00	156,060,000	
名糖産業	6,000	1,520.00	9,120,000	

井村屋グループ	7,400	2,400.00	17,760,000	
不二家	8,400	2,157.00	18,118,800	
山崎製パン	98,100	1,725.00	169,222,500	
第一屋製パン	3,100	956.00	2,963,600	
モロゾフ	1,800	5,330.00	9,594,000	
亀田製菓	7,500	4,645.00	34,837,500	
寿スピリッツ	12,600	6,210.00	78,246,000	
カルビー	59,600	2,634.00	156,986,400	
森永乳業	24,000	6,300.00	151,200,000	
六甲バター	8,900	1,600.00	14,240,000	
ヤクルト本社	89,800	5,470.00	491,206,000	
明治ホールディングス	86,600	6,910.00	598,406,000	
雪印メグミルク	31,600	2,258.00	71,352,800	
プリマハム	18,400	3,275.00	60,260,000	
日本ハム	50,000	4,680.00	234,000,000	
林兼産業	4,100	634.00	2,599,400	
丸大食品	13,100	1,713.00	22,440,300	
S F o o d s	11,700	3,295.00	38,551,500	
柿安本店	4,400	2,534.00	11,149,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	84,800	745.00	63,176,000	
学情	4,300	1,334.00	5,736,200	
スタジオアリス	6,200	2,409.00	14,935,800	
クロスキャット	3,200	1,000.00	3,200,000	
シミックホールディングス	6,000	1,559.00	9,354,000	
エプコ	3,000	967.00	2,901,000	
システナ	45,700	2,185.00	99,854,500	
N J S	3,000	1,979.00	5,937,000	
デジタルアーツ	7,400	8,580.00	63,492,000	
日鉄ソリューションズ	19,000	3,210.00	60,990,000	
総合警備保障	49,700	5,020.00	249,494,000	
キューブシステム	6,800	1,075.00	7,310,000	
いちご	142,900	348.00	49,729,200	
エイジア	1,900	1,844.00	3,503,600	
日本駐車場開発	141,000	156.00	21,996,000	
コア	5,500	1,451.00	7,980,500	
カカコム	92,100	2,820.00	259,722,000	
アイロムグループ	4,300	2,295.00	9,868,500	
セントケア・ホールディング	9,100	1,142.00	10,392,200	
サイネックス	2,500	661.00	1,652,500	
ルネサンス	7,900	1,138.00	8,990,200	
ディップ	19,300	3,260.00	62,918,000	
S B Sホールディングス	9,700	2,781.00	26,975,700	
デジタルホールディングス	8,500	1,880.00	15,980,000	
新日本科学	15,000	789.00	11,835,000	
キャリアデザインセンター	2,600	1,066.00	2,771,600	
ベネフィット・ワン	45,500	2,595.00	118,072,500	
エムスリー	219,700	7,160.00	1,573,052,000	

ツカダ・グローバルホールディング	10,500	339.00	3,559,500	
プラス	1,600	513.00	820,800	
アウトソーシング	71,300	1,904.00	135,755,200	
ウェルネット	12,600	513.00	6,463,800	
ワールドホールディングス	4,300	2,730.00	11,739,000	
ディー・エヌ・エー	52,700	2,048.00	107,929,600	
博報堂D Yホールディングス	173,200	1,819.00	315,050,800	
ぐるなび	21,600	575.00	12,420,000	
タカミヤ	15,500	515.00	7,982,500	
ジャパンベストレスキューシステム	9,700	701.00	6,799,700	
ファンコミュニケーションズ	34,200	388.00	13,269,600	
ライク	3,200	2,354.00	7,532,800	
ビジネス・ブレークスルー	5,700	438.00	2,496,600	
エスプール	31,900	916.00	29,220,400	
WDBホールディングス	5,800	2,342.00	13,583,600	
手間いらず	1,600	5,450.00	8,720,000	
ティア	7,900	486.00	3,839,400	
CDG	1,400	1,592.00	2,228,800	
アドウェイズ	20,200	833.00	16,826,600	
バリューコマース	8,300	3,270.00	27,141,000	
インフォマート	126,100	861.00	108,572,100	
サッポロホールディングス	44,800	2,197.00	98,425,600	
アサヒグループホールディングス	286,000	4,697.00	1,343,342,000	
キリンホールディングス	554,900	2,076.00	1,151,972,400	
宝ホールディングス	96,900	1,418.00	137,404,200	
オエノンホールディングス	38,000	384.00	14,592,000	
養命酒製造	4,300	1,863.00	8,010,900	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	100,100	1,823.00	182,482,300	
サントリー食品インターナショナル	87,600	3,790.00	332,004,000	
ダイドーグループホールディングス	7,500	5,160.00	38,700,000	
伊藤園	39,800	6,170.00	245,566,000	
キーコーヒー	13,100	2,091.00	27,392,100	
ユニカフェ	4,300	1,001.00	4,304,300	
ジャパンフーズ	1,600	1,201.00	1,921,600	
日清オイリオグループ	16,800	3,025.00	50,820,000	
不二製油グループ本社	32,100	2,813.00	90,297,300	
かどや製油	1,000	4,040.00	4,040,000	
J-オイルミルズ	12,300	1,885.00	23,185,500	
ローソン	32,400	4,995.00	161,838,000	
サンエー	9,700	4,215.00	40,885,500	
カワチ薬品	9,000	2,349.00	21,141,000	
エービーシー・マート	20,000	6,050.00	121,000,000	
ハードオフコーポレーション	5,900	782.00	4,613,800	
高千穂交易	5,200	1,094.00	5,688,800	
アスクル	10,400	3,830.00	39,832,000	
ゲオホールディングス	17,300	1,204.00	20,829,200	

アダストリア	17,700	1,825.00	32,302,500	
ジーフット	8,300	408.00	3,386,400	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,300	395.00	908,500	
オルパヘルスケアホールディングス	1,700	1,695.00	2,881,500	
伊藤忠食品	2,500	5,020.00	12,550,000	
くら寿司	15,000	3,880.00	58,200,000	
キャンドウ	6,000	2,158.00	12,948,000	
エレマテック	10,200	1,201.00	12,250,200	
アイケイ	2,600	813.00	2,113,800	
パルグループホールディングス	11,200	1,590.00	17,808,000	
JALUX	3,600	1,595.00	5,742,000	
エディオン	54,400	1,170.00	63,648,000	
あらた	10,200	4,365.00	44,523,000	
サーラコーポレーション	26,500	615.00	16,297,500	
ワッツ	5,800	896.00	5,196,800	
トーメンデバイス	1,700	4,145.00	7,046,500	
ハローズ	4,800	2,957.00	14,193,600	
J Pホールディングス	35,700	306.00	10,924,200	
フジオフードグループ本社	10,700	1,420.00	15,194,000	
あみやき亭	2,600	2,810.00	7,306,000	
東京エレクトロン デバイス	4,300	6,560.00	28,208,000	
ひらまつ	23,900	158.00	3,776,200	
フィールズ	11,200	513.00	5,745,600	
双日	707,400	339.00	239,808,600	
アルフレッサ ホールディングス	133,000	2,015.00	267,995,000	
大黒天物産	4,100	8,610.00	35,301,000	
ハニーズホールディングス	9,900	1,072.00	10,612,800	
ファーマライズホールディングス	3,600	779.00	2,804,400	
キッコーマン	94,000	6,670.00	626,980,000	
味の素	311,200	2,410.00	749,992,000	
ブルドックソース	5,900	2,289.00	13,505,100	
キューピー	72,800	2,591.00	188,624,800	
ハウス食品グループ本社	48,900	3,505.00	171,394,500	
カゴメ	53,500	3,165.00	169,327,500	
焼津水産化学工業	5,300	977.00	5,178,100	
アリアケジャパン	12,200	6,540.00	79,788,000	
ピエトロ	1,300	1,773.00	2,304,900	
エバラ食品工業	2,500	2,667.00	6,667,500	
やまみ	1,100	2,114.00	2,325,400	
ニチレイ	62,400	2,763.00	172,411,200	
横浜冷凍	34,100	887.00	30,246,700	
東洋水産	67,200	4,540.00	305,088,000	
イートアンドホールディングス	4,500	1,825.00	8,212,500	
大冷	1,600	1,931.00	3,089,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,400	798.00	5,905,200	
日清食品ホールディングス	51,300	8,150.00	418,095,000	
永谷園ホールディングス	6,600	2,252.00	14,863,200	

一正蒲鉾	4,300	1,243.00	5,344,900	
フジッコ	14,300	1,941.00	27,756,300	
ロック・フィールド	14,200	1,552.00	22,038,400	
日本たばこ産業	701,600	2,149.50	1,508,089,200	
ケンコーマヨネーズ	8,100	1,750.00	14,175,000	
わらべや日洋ホールディングス	8,600	1,997.00	17,174,200	
なとり	7,600	1,923.00	14,614,800	
イフジ産業	2,500	951.00	2,377,500	
ピックルスコーポレーション	3,000	3,330.00	9,990,000	
ファーマフーズ	12,300	3,160.00	38,868,000	
北の達人コーポレーション	45,400	480.00	21,792,000	
ユーグレナ	66,600	889.00	59,207,400	
スター・マイカ・ホールディングス	6,700	1,095.00	7,336,500	
S R E ホールディングス	1,900	4,850.00	9,215,000	
A D ワークスグループ	24,700	161.00	3,976,700	
片倉工業	17,300	1,408.00	24,358,400	
グンゼ	9,400	3,995.00	37,553,000	
ヒューリック	272,700	1,225.00	334,057,500	
神栄	1,700	1,318.00	2,240,600	
ラサ商事	7,200	896.00	6,451,200	
アルペン	9,800	2,481.00	24,313,800	
ハブ	4,100	645.00	2,644,500	
ラクーンホールディングス	9,100	3,100.00	28,210,000	
クオールホールディングス	17,200	1,332.00	22,910,400	
アルコニックス	13,600	1,600.00	21,760,000	
神戸物産	88,700	2,823.00	250,400,100	
ソリトンシステムズ	6,400	1,834.00	11,737,600	
ジンズホールディングス	8,700	7,650.00	66,555,000	
ビックカメラ	76,300	1,137.00	86,753,100	
D C M ホールディングス	79,300	1,070.00	84,851,000	
ペッパーフードサービス	14,400	281.00	4,046,400	
ハイパー	2,300	559.00	1,285,700	
M o n o t a R O	182,500	2,395.00	437,087,500	
東京一番フーズ	2,700	577.00	1,557,900	
D D ホールディングス	5,800	550.00	3,190,000	
あい ホールディングス	18,400	2,197.00	40,424,800	
ディービーエックス	4,300	961.00	4,132,300	
きちりホールディングス	3,800	572.00	2,173,600	
アーランドサービスホールディングス	10,800	2,234.00	24,127,200	
J. フロント リテイリング	153,200	1,033.00	158,255,600	
ドトール・日レスホールディングス	20,400	1,631.00	33,272,400	
マツモトキヨシホールディングス	53,100	4,385.00	232,843,500	
ブロンコビリー	6,700	2,401.00	16,086,700	
Z O Z O	75,700	3,380.00	255,866,000	
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,134.00	4,309,200	
物語コーポレーション	6,800	6,550.00	44,540,000	

ココカラファイン	11,400	7,390.00	84,246,000	
三越伊勢丹ホールディングス	224,400	781.00	175,256,400	
東洋紡	50,400	1,440.00	72,576,000	
ユニチカ	37,700	391.00	14,740,700	
富士紡ホールディングス	6,000	4,425.00	26,550,000	
日清紡ホールディングス	79,600	847.00	67,421,200	
倉敷紡績	11,700	1,864.00	21,808,800	
ダイワボウホールディングス	58,200	1,813.00	105,516,600	
シキボウ	7,300	942.00	6,876,600	
日東紡績	19,200	3,910.00	75,072,000	
トヨタ紡織	38,100	2,042.00	77,800,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	30,600	2,433.00	74,449,800	
H a m e e	3,100	1,543.00	4,783,300	
ラクト・ジャパン	5,700	2,856.00	16,279,200	
ウエルシアホールディングス	67,900	3,410.00	231,539,000	
クリエイトSDホールディングス	18,900	3,300.00	62,370,000	
グリムス	3,800	1,833.00	6,965,400	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	22,700	738.00	16,752,600	
八洲電機	10,000	959.00	9,590,000	
メディアスホールディングス	7,400	960.00	7,104,000	
レスターホールディングス	13,500	2,000.00	27,000,000	
ジュテックホールディングス	2,500	1,000.00	2,500,000	
丸善CH I ホールディングス	16,800	390.00	6,552,000	
大光	5,500	702.00	3,861,000	
O C H I ホールディングス	3,900	1,273.00	4,964,700	
T O K A I ホールディングス	62,500	913.00	57,062,500	
黒谷	3,600	1,175.00	4,230,000	
ミサワ	2,500	714.00	1,785,000	
ティーライフ	1,800	1,353.00	2,435,400	
C o m i n i x	1,800	761.00	1,369,800	
エー・ピーホールディングス	2,200	429.00	943,800	
三洋貿易	12,700	1,109.00	14,084,300	
チムニー	3,900	1,229.00	4,793,100	
シュッピン	8,600	1,047.00	9,004,200	
ビューティガレージ	2,200	3,575.00	7,865,000	
オイシックス・ラ・大地	16,900	2,888.00	48,807,200	
ウイン・パートナーズ	9,300	987.00	9,179,100	
ネクステージ	22,200	1,674.00	37,162,800	
ジョイフル本田	37,700	1,343.00	50,631,100	
鳥貴族ホールディングス	3,600	1,625.00	5,850,000	
ホットランド	9,400	1,335.00	12,549,000	
すかいらーくホールディングス	143,800	1,631.00	234,537,800	
S F Pホールディングス	6,100	1,307.00	7,972,700	
綿半ホールディングス	9,600	1,294.00	12,422,400	
日本毛織	42,200	999.00	42,157,800	
ダイトウボウ	21,200	107.00	2,268,400	

トーア紡コーポレーション	4,400	456.00	2,006,400	
ダイドーリミテッド	18,200	179.00	3,257,800	
ヨシックス	2,500	1,975.00	4,937,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,500	1,091.00	40,912,500	
三栄建築設計	5,200	1,990.00	10,348,000	
野村不動産ホールディングス	78,100	2,811.00	219,539,100	
三重交通グループホールディングス	26,300	487.00	12,808,100	
サムティ	18,200	2,015.00	36,673,000	
ディア・ライフ	18,000	474.00	8,532,000	
コーセーアールイー	3,900	608.00	2,371,200	
日本商業開発	8,000	1,722.00	13,776,000	
プレサンスコーポレーション	21,100	1,654.00	34,899,400	
フィル・カンパニー	2,400	3,045.00	7,308,000	
THE グローバル社	8,000	250.00	2,000,000	
ハウスコム	1,300	1,220.00	1,586,000	
日本管理センター	6,800	1,275.00	8,670,000	
サンセイランディック	3,900	829.00	3,233,100	
エストラスト	1,400	676.00	946,400	
フージャースホールディングス	21,100	673.00	14,200,300	
オープンハウス	40,400	4,430.00	178,972,000	
東急不動産ホールディングス	349,400	625.00	218,375,000	
飯田グループホールディングス	107,100	2,755.00	295,060,500	
イーグランド	2,500	983.00	2,457,500	
ムゲンエステート	8,000	492.00	3,936,000	
帝国繊維	14,300	2,036.00	29,114,800	
日本コークス工業	110,100	108.00	11,890,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,600	1,433.00	9,457,800	
ミタチ産業	3,200	681.00	2,179,200	
BEENOS	5,900	3,345.00	19,735,500	
あさひ	9,400	1,475.00	13,865,000	
日本調剤	7,900	1,749.00	13,817,100	
コスモス薬品	13,100	15,720.00	205,932,000	
シップヘルスケアホールディングス	45,200	2,898.00	130,989,600	
トーエル	6,100	817.00	4,983,700	
ソフトクリエイイトホールディングス	5,100	2,458.00	12,535,800	
オンリー	2,700	451.00	1,217,700	
セブン&アイ・ホールディングス	502,300	4,648.00	2,334,690,400	
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	68,500	791.00	54,183,500	
明治電機工業	3,300	1,400.00	4,620,000	
ツルハホールディングス	28,100	12,860.00	361,366,000	
デリカフーズホールディングス	5,800	625.00	3,625,000	
スターティアホールディングス	2,500	1,068.00	2,670,000	
サンマルクホールディングス	10,000	1,695.00	16,950,000	
フェリシモ	2,700	1,312.00	3,542,400	
トリドールホールディングス	31,800	1,714.00	54,505,200	

帝人	120,200	1,870.00	224,774,000	
東レ	924,500	702.00	648,999,000	
クラレ	201,000	1,244.00	250,044,000	
旭化成	846,200	1,183.50	1,001,477,700	
サカイオーベックス	3,300	3,005.00	9,916,500	
TOKYO BASE	11,300	687.00	7,763,100	
稲葉製作所	7,400	1,481.00	10,959,400	
宮地エンジニアリンググループ	4,200	2,342.00	9,836,400	
トーカロ	33,400	1,482.00	49,498,800	
アルファ	5,000	1,221.00	6,105,000	
SUMCO	164,900	2,507.00	413,404,300	
川田テクノロジーズ	2,500	4,445.00	11,112,500	
RS Technologies	4,200	6,060.00	25,452,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,730.00	2,730,000	
信和	7,100	795.00	5,644,500	
ビーロット	5,900	652.00	3,846,800	
ファーストブラザーズ	2,500	986.00	2,465,000	
ハウスドゥ	6,000	1,045.00	6,270,000	
シーアールイー	3,200	1,454.00	4,652,800	
プロパティエージェント	2,200	2,511.00	5,524,200	
ケイアイスター不動産	4,100	3,645.00	14,944,500	
アグレ都市デザイン	2,400	981.00	2,354,400	
グッドコムアセット	6,000	1,413.00	8,478,000	
ジェイ・エス・ビー	2,500	3,360.00	8,400,000	
テンポイノベーション	3,600	863.00	3,106,800	
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	891.00	2,049,300	
住江織物	2,400	1,972.00	4,732,800	
日本フエルト	6,000	435.00	2,610,000	
イチカワ	1,400	1,339.00	1,874,600	
エコナックホールディングス	22,600	90.00	2,034,000	
日東製網	1,400	1,533.00	2,146,200	
芦森工業	2,500	1,012.00	2,530,000	
アツギ	10,100	632.00	6,383,200	
ウイルプラスホールディングス	2,200	1,298.00	2,855,600	
JMホールディングス	9,700	2,081.00	20,185,700	
コメダホールディングス	28,200	2,023.00	57,048,600	
サツドラホールディングス	1,600	2,279.00	3,646,400	
アレンザホールディングス	9,800	1,230.00	12,054,000	
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,688.00	5,401,600	
バロックジャパンリミテッド	8,900	753.00	6,701,700	
クスリのアオキホールディングス	12,800	7,740.00	99,072,000	
ダイニック	4,100	795.00	3,259,500	
共和レザー	7,400	770.00	5,698,000	
ピーバンドットコム	1,600	794.00	1,270,400	
力の源ホールディングス	5,900	597.00	3,522,300	
FOOD & LIFE COMPANIES	75,100	4,605.00	345,835,500	

アセンテック	3,100	1,397.00	4,330,700	
セーレン	31,500	1,917.00	60,385,500	
ソトー	4,300	797.00	3,427,100	
東海染工	1,400	1,121.00	1,569,400	
小松マテーレ	20,900	905.00	18,914,500	
ワコールホールディングス	31,900	2,540.00	81,026,000	
ホギメディカル	17,200	3,300.00	56,760,000	
クラウディアホールディングス	2,500	286.00	715,000	
T S I ホールディングス	38,000	323.00	12,274,000	
マツオカコーポレーション	4,200	1,824.00	7,660,800	
ワールド	16,600	1,422.00	23,605,200	
T I S	128,000	2,634.00	337,152,000	
J N S ホールディングス	6,000	537.00	3,222,000	
電算システム	4,800	3,205.00	15,384,000	
グリー	78,500	624.00	48,984,000	
GMOペパボ	900	5,820.00	5,238,000	
コーエーテクモホールディングス	33,700	4,615.00	155,525,500	
三菱総合研究所	5,700	4,085.00	23,284,500	
ボルテージ	3,000	557.00	1,671,000	
電算	1,000	2,358.00	2,358,000	
A G S	6,700	794.00	5,319,800	
ファインデックス	10,700	1,187.00	12,700,900	
ブレインパッド	3,100	4,985.00	15,453,500	
K L a b	23,500	753.00	17,695,500	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,900	1,096.00	18,522,400	
イーブックイニシアティブジャパン	2,200	2,611.00	5,744,200	
ネクソン	323,300	3,365.00	1,087,904,500	
アイスタイル	38,700	489.00	18,924,300	
エムアップホールディングス	3,200	2,716.00	8,691,200	
エイチーム	8,800	1,591.00	14,000,800	
エニグモ	12,100	1,273.00	15,403,300	
テクノスジャパン	9,700	640.00	6,208,000	
e n i s h	6,500	518.00	3,367,000	
コロブラ	41,900	810.00	33,939,000	
オルトプラス	7,400	471.00	3,485,400	
ブロードリーフ	63,500	545.00	34,607,500	
クロス・マーケティンググループ	5,900	506.00	2,985,400	
デジタルハーツホールディングス	5,800	1,572.00	9,117,600	
システム情報	9,300	967.00	8,993,100	
メディアドゥ	4,800	5,090.00	24,432,000	
じげん	30,800	392.00	12,073,600	
ブイキューブ	6,900	2,818.00	19,444,200	
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	644.00	1,610,000	
サイバーリンクス	4,200	1,558.00	6,543,600	
ディー・エル・イー	10,000	284.00	2,840,000	
フィックスターズ	13,400	972.00	13,024,800	

CARTA HOLDINGS	5,200	1,478.00	7,685,600	
オブティム	9,000	2,649.00	23,841,000	
セレス	4,200	3,655.00	15,351,000	
SHIFT	6,400	14,910.00	95,424,000	
特種東海製紙	7,900	4,600.00	36,340,000	
ティーガイア	13,600	1,930.00	26,248,000	
セック	1,800	2,701.00	4,861,800	
日本アジアグループ	12,400	937.00	11,618,800	
テクマトリックス	19,800	1,938.00	38,372,400	
プロシップ	3,800	1,390.00	5,282,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,700	2,048.00	62,873,600	
GMOペイメントゲートウェイ	24,500	12,370.00	303,065,000	
ザッパラス	5,100	504.00	2,570,400	
システムリサーチ	3,800	2,171.00	8,249,800	
インターネットイニシアティブ	34,000	2,372.00	80,648,000	
さくらインターネット	13,400	642.00	8,602,800	
ヴィンクス	3,500	1,010.00	3,535,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,600	5,340.00	13,884,000	
SRAホールディングス	6,900	2,597.00	17,919,300	
システムインテグレータ	3,500	657.00	2,299,500	
朝日ネット	10,500	709.00	7,444,500	
eBASE	15,100	969.00	14,631,900	
アバント	13,600	1,577.00	21,447,200	
アドソル日進	4,400	2,670.00	11,748,000	
ODKソリューションズ	2,300	844.00	1,941,200	
フリービット	7,500	894.00	6,705,000	
コムチュア	11,700	2,446.00	28,618,200	
サイバーコム	2,400	1,525.00	3,660,000	
アステリア	9,100	792.00	7,207,200	
アイル	7,200	1,705.00	12,276,000	
王子ホールディングス	574,600	744.00	427,502,400	
日本製紙	56,400	1,462.00	82,456,800	
三菱製紙	18,800	356.00	6,692,800	
北越コーポレーション	91,700	590.00	54,103,000	
中越パルプ工業	5,200	1,226.00	6,375,200	
巴川製紙所	4,200	794.00	3,334,800	
大王製紙	61,800	1,915.00	118,347,000	
阿波製紙	3,200	429.00	1,372,800	
マークライNZ	5,300	3,210.00	17,013,000	
メディカル・データ・ビジョン	14,500	1,868.00	27,086,000	
gumi	17,500	1,312.00	22,960,000	
ショーケース	2,500	820.00	2,050,000	
モバイルファクトリー	2,500	1,424.00	3,560,000	
テラスカイ	4,200	2,688.00	11,289,600	

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,700	2,111.00	12,032,700	
P C I ホールディングス	4,800	1,441.00	6,916,800	
パイプドHD	2,500	1,622.00	4,055,000	
アイビーシー	2,200	978.00	2,151,600	
ネオジャパン	2,500	1,717.00	4,292,500	
P R T I M E S	2,500	3,060.00	7,650,000	
ラクス	38,500	1,966.00	75,691,000	
ランドコンピュータ	1,600	1,041.00	1,665,600	
ダブルスタンダード	1,600	3,525.00	5,640,000	
オープンドア	7,500	2,006.00	15,045,000	
マイネット	4,200	877.00	3,683,400	
アカツキ	5,100	3,880.00	19,788,000	
ベネフィットジャパン	900	1,969.00	1,772,100	
U b i c o mホールディングス	3,200	2,930.00	9,376,000	
カナミックネットワーク	11,500	624.00	7,176,000	
ノムラシステムコーポレーション	5,700	309.00	1,761,300	
レンゴー	131,600	944.00	124,230,400	
トーモク	7,900	1,958.00	15,468,200	
ザ・パックス	9,700	2,746.00	26,636,200	
チェンジ	23,500	3,165.00	74,377,500	
シンクロ・フード	7,500	369.00	2,767,500	
オークネット	6,700	1,287.00	8,622,900	
キャピタル・アセット・プランニング	1,600	1,190.00	1,904,000	
セグエグループ	3,100	1,294.00	4,011,400	
エイトレッド	2,500	2,521.00	6,302,500	
A O I T Y O H O L D I N G S	13,100	632.00	8,279,200	
マクロミル	26,100	839.00	21,897,900	
ビーグリー	2,500	1,369.00	3,422,500	
オロ	4,100	3,760.00	15,416,000	
ユーザーローカル	1,900	4,470.00	8,493,000	
テモナ	2,600	859.00	2,233,400	
ニーズウェル	2,500	616.00	1,540,000	
サインポスト	2,700	901.00	2,432,700	
昭和電工	96,900	3,505.00	339,634,500	
住友化学	1,004,600	591.00	593,718,600	
住友精化	6,100	3,850.00	23,485,000	
日産化学	70,400	5,850.00	411,840,000	
ラサ工業	4,200	2,163.00	9,084,600	
クレハ	10,900	7,720.00	84,148,000	
多木化学	5,000	5,700.00	28,500,000	
テイカ	9,200	1,380.00	12,696,000	
石原産業	22,500	923.00	20,767,500	
片倉コープアグリ	2,500	1,200.00	3,000,000	
日本曹達	17,900	3,325.00	59,517,500	
東ソー	197,100	1,975.00	389,272,500	
トクヤマ	37,700	2,442.00	92,063,400	

セントラル硝子	24,200	2,298.00	55,611,600	
東亜合成	78,100	1,217.00	95,047,700	
大阪ソーダ	13,200	2,498.00	32,973,600	
関東電化工業	30,200	872.00	26,334,400	
デンカ	46,600	4,340.00	202,244,000	
イビデン	62,600	4,645.00	290,777,000	
信越化学工業	236,100	18,015.00	4,253,341,500	
日本カーバイド工業	4,500	1,337.00	6,016,500	
堺化学工業	9,000	1,896.00	17,064,000	
第一稀元素化学工業	12,900	1,379.00	17,789,100	
エア・ウォーター	130,100	1,900.00	247,190,000	
日本酸素ホールディングス	104,900	2,190.00	229,731,000	
日本化学工業	3,500	2,937.00	10,279,500	
東邦アセチレン	2,200	1,272.00	2,798,400	
日本パーカライジング	64,300	1,062.00	68,286,600	
高圧ガス工業	20,400	717.00	14,626,800	
チタン工業	1,600	2,039.00	3,262,400	
四国化成工業	17,200	1,224.00	21,052,800	
戸田工業	2,500	2,111.00	5,277,500	
ステラ ケミファ	6,900	3,205.00	22,114,500	
保土谷化学工業	3,800	4,360.00	16,568,000	
日本触媒	23,200	5,890.00	136,648,000	
大日精化工業	10,700	2,330.00	24,931,000	
カネカ	33,100	4,410.00	145,971,000	
協和キリン	131,100	3,320.00	435,252,000	
三菱瓦斯化学	127,900	2,665.00	340,853,500	
三井化学	110,200	3,585.00	395,067,000	
J S R	128,000	3,335.00	426,880,000	
東京応化工業	22,100	7,100.00	156,910,000	
大阪有機化学工業	11,700	3,905.00	45,688,500	
三菱ケミカルホールディングス	853,600	858.40	732,730,240	
KHネオケム	21,000	2,687.00	56,427,000	
ダイセル	171,400	881.00	151,003,400	
住友ベークライト	20,200	4,575.00	92,415,000	
積水化学工業	270,100	1,925.00	519,942,500	
日本ゼオン	115,200	1,741.00	200,563,200	
アイカ工業	35,400	4,100.00	145,140,000	
宇部興産	64,300	2,311.00	148,597,300	
積水樹脂	21,000	2,138.00	44,898,000	
タキロンシーアイ	28,000	649.00	18,172,000	
旭有機材	7,300	1,421.00	10,373,300	
ニチバン	6,900	1,831.00	12,633,900	
リケンテクノス	30,800	545.00	16,786,000	
大倉工業	6,000	1,959.00	11,754,000	
積水化成品工業	17,100	585.00	10,003,500	
群栄化学工業	2,500	2,403.00	6,007,500	
タイガースポリマー	7,400	481.00	3,559,400	

ミライアル	4,200	1,317.00	5,531,400	
ダイキアクシス	4,700	894.00	4,201,800	
ダイキョーニシカワ	26,900	773.00	20,793,700	
竹本容器	4,500	994.00	4,473,000	
森六ホールディングス	7,000	2,053.00	14,371,000	
恵和	1,800	2,499.00	4,498,200	
日本化薬	79,000	1,074.00	84,846,000	
カーリットホールディングス	12,600	712.00	8,971,200	
E P Sホールディングス	16,900	1,395.00	23,575,500	
ソルクシーズ	4,800	964.00	4,627,200	
レッグス	2,800	2,531.00	7,086,800	
プレステージ・インターナショナル	46,600	725.00	33,785,000	
フェイス	4,100	891.00	3,653,100	
プロトコーポレーション	15,300	1,172.00	17,931,600	
アミューズ	6,900	2,268.00	15,649,200	
野村総合研究所	222,100	3,260.00	724,046,000	
ドリームインキュベータ	3,900	1,001.00	3,903,900	
サイバネットシステム	9,100	830.00	7,553,000	
クイック	7,700	1,235.00	9,509,500	
T A C	6,900	243.00	1,676,700	
C Eホールディングス	6,800	575.00	3,910,000	
日本システム技術	2,400	1,550.00	3,720,000	
電通グループ	139,900	3,475.00	486,152,500	
インテージホールディングス	15,900	1,356.00	21,560,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,800	825.00	4,785,000	
東邦システムサイエンス	3,200	921.00	2,947,200	
ぴあ	3,500	2,803.00	9,810,500	
イオンファンタジー	4,700	1,981.00	9,310,700	
ソースネクスト	60,000	323.00	19,380,000	
シーティーエス	13,900	857.00	11,912,300	
ネクシィーズグループ	3,900	971.00	3,786,900	
インフォコム	11,600	2,685.00	31,146,000	
メディカルシステムネットワーク	11,200	718.00	8,041,600	
日本精化	9,200	1,431.00	13,165,200	
扶桑化学工業	10,000	4,120.00	41,200,000	
トリケミカル研究所	10,700	3,475.00	37,182,500	
HEROZ	3,500	2,676.00	9,366,000	
ラクスル	13,900	4,845.00	67,345,500	
I P S	2,400	2,380.00	5,712,000	
F I G	13,900	280.00	3,892,000	
システムサポート	3,800	1,490.00	5,662,000	
A D E K A	58,800	2,125.00	124,950,000	
日油	48,200	6,010.00	289,682,000	
ミヨシ油脂	4,800	1,216.00	5,836,800	
新日本理化	20,800	282.00	5,865,600	
ハリマ化成グループ	9,600	914.00	8,774,400	
イーソル	6,800	1,178.00	8,010,400	

アルテリア・ネットワークス	14,100	1,565.00	22,066,500	
EDULAB	1,100	6,020.00	6,622,000	
東海ソフト	1,500	1,248.00	1,872,000	
ウイングアーク1st	6,700	2,460.00	16,482,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	2,045.00	4,703,500	
サーバーワークス	1,200	4,220.00	5,064,000	
東名	800	1,112.00	889,600	
ヴィッツ	500	2,007.00	1,003,500	
トビラシステムズ	1,100	1,324.00	1,456,400	
Sansan	11,300	8,250.00	93,225,000	
Link-U	800	1,154.00	923,200	
ギフトィ	7,700	3,010.00	23,177,000	
花王	312,200	6,759.00	2,110,159,800	
第一工業製薬	4,300	3,595.00	15,458,500	
石原ケミカル	3,200	2,126.00	6,803,200	
日華化学	4,700	1,158.00	5,442,600	
ニイタカ	2,500	2,666.00	6,665,000	
三洋化成工業	7,500	5,430.00	40,725,000	
ベース	1,400	6,040.00	8,456,000	
武田薬品工業	1,084,500	3,722.00	4,036,509,000	
アステラス製薬	1,130,100	1,680.00	1,898,568,000	
大日本住友製薬	96,500	1,919.00	185,183,500	
塩野義製薬	164,000	5,866.00	962,024,000	
わかもと製薬	15,600	329.00	5,132,400	
日本新薬	37,100	7,130.00	264,523,000	
バイオフェルミン製薬	2,500	2,995.00	7,487,500	
中外製薬	407,800	4,084.00	1,665,455,200	
科研製薬	22,300	4,550.00	101,465,000	
エーザイ	143,900	7,088.00	1,019,963,200	
理研ビタミン	12,400	1,386.00	17,186,400	
ロート製薬	62,200	2,802.00	174,284,400	
小野薬品工業	299,600	2,743.50	821,952,600	
久光製薬	37,900	6,440.00	244,076,000	
有機合成薬品工業	10,000	291.00	2,910,000	
持田製薬	18,100	3,850.00	69,685,000	
参天製薬	227,000	1,409.00	319,843,000	
扶桑薬品工業	4,200	2,404.00	10,096,800	
日本ケミファ	1,300	2,299.00	2,988,700	
ツムラ	43,400	3,680.00	159,712,000	
日医工	36,900	961.00	35,460,900	
テルモ	399,700	4,095.00	1,636,771,500	
H. U. グループホールディングス	34,900	3,685.00	128,606,500	
キッセイ薬品工業	23,200	2,255.00	52,316,000	
生化学工業	23,200	1,014.00	23,524,800	
栄研化学	23,000	2,150.00	49,450,000	
日水製薬	5,300	985.00	5,220,500	

鳥居薬品	8,200	2,518.00	20,647,600	
J C Rファーマ	36,700	2,933.00	107,641,100	
東和薬品	18,900	2,298.00	43,432,200	
富士製薬工業	8,900	1,197.00	10,653,300	
ゼリア新薬工業	23,800	2,000.00	47,600,000	
第一三共	1,119,300	2,782.50	3,114,452,250	
キョーリン製薬ホールディングス	29,000	1,882.00	54,578,000	
大幸薬品	15,900	1,020.00	16,218,000	
ダイト	8,300	3,415.00	28,344,500	
大塚ホールディングス	271,100	4,280.00	1,160,308,000	
大正製薬ホールディングス	30,900	6,690.00	206,721,000	
ペプチドリーム	66,200	4,790.00	317,098,000	
大日本塗料	14,400	871.00	12,542,400	
日本ペイントホールディングス	526,000	1,670.00	878,420,000	
関西ペイント	143,400	2,767.00	396,787,800	
神東塗料	10,100	205.00	2,070,500	
中国塗料	30,800	1,013.00	31,200,400	
日本特殊塗料	9,600	1,022.00	9,811,200	
藤倉化成	17,500	537.00	9,397,500	
太陽ホールディングス	9,400	5,300.00	49,820,000	
D I C	53,900	2,916.00	157,172,400	
サカタインクス	28,000	1,079.00	30,212,000	
東洋インキＳＣホールディングス	27,100	2,072.00	56,151,200	
T & K T O K A	10,200	779.00	7,945,800	
アルプス技研	11,000	2,026.00	22,286,000	
サニックス	19,300	343.00	6,619,900	
ダイオーズ	2,500	980.00	2,450,000	
日本空調サービス	13,700	739.00	10,124,300	
オリエンタルランド	132,500	15,070.00	1,996,775,000	
フォーカスシステムズ	8,400	909.00	7,635,600	
ダスキン	29,000	2,621.00	76,009,000	
パーク 2 4	68,900	2,196.00	151,304,400	
明光ネットワークジャパン	15,900	577.00	9,174,300	
ファルコホールディングス	5,900	1,704.00	10,053,600	
クレスコ	8,600	1,798.00	15,462,800	
フジ・メディア・ホールディングス	132,500	1,307.00	173,177,500	
秀英予備校	3,000	403.00	1,209,000	
田谷	1,800	543.00	977,400	
ラウンドワン	42,400	1,233.00	52,279,200	
リゾートトラスト	57,100	1,651.00	94,272,100	
オービック	40,400	19,300.00	779,720,000	
ジャストシステム	18,200	6,060.00	110,292,000	
T D C ソフト	11,200	1,041.00	11,659,200	
Zホールディングス	1,757,400	462.50	812,797,500	
ビー・エム・エル	16,100	3,790.00	61,019,000	
ワタベウェディング	1,800	228.00	410,400	
トレンドマイクロ	68,300	5,190.00	354,477,000	

りらいあコミュニケーションズ	19,000	1,321.00	25,099,000	
I Dホールディングス	5,000	1,348.00	6,740,000	
リソー教育	62,800	284.00	17,835,200	
日本オラクル	25,900	10,600.00	274,540,000	
早稲田アカデミー	4,800	932.00	4,473,600	
アルファシステムズ	3,300	3,600.00	11,880,000	
フューチャー	15,500	2,049.00	31,759,500	
C A C H o l d i n g s	8,200	1,415.00	11,603,000	
S Bテクノロジー	4,500	3,025.00	13,612,500	
トーセ	3,600	800.00	2,880,000	
ユー・エス・エス	139,500	1,939.00	270,490,500	
オービックビジネスコンサルタント	13,200	6,300.00	83,160,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	58,400	3,720.00	217,248,000	
アイティフォー	16,800	779.00	13,087,200	
東京個別指導学院	10,800	582.00	6,285,600	
東計電算	2,000	4,310.00	8,620,000	
サイバーエージェント	306,900	2,126.00	652,469,400	
楽天グループ	580,500	1,290.00	748,845,000	
エックスネット	2,500	1,005.00	2,512,500	
クリーク・アンド・リバー社	6,400	1,547.00	9,900,800	
モーニングスター	13,600	446.00	6,065,600	
テー・オー・ダブリュー	21,800	318.00	6,932,400	
大塚商会	69,300	5,580.00	386,694,000	
サイボウズ	15,000	2,272.00	34,080,000	
山田コンサルティンググループ	7,300	1,277.00	9,322,100	
セントラルスポーツ	4,500	2,401.00	10,804,500	
パラカ	3,300	1,662.00	5,484,600	
電通国際情報サービス	15,800	3,885.00	61,383,000	
A C C E S S	16,000	875.00	14,000,000	
デジタルガレージ	21,000	4,505.00	94,605,000	
イーエムシステムズ	21,200	805.00	17,066,000	
ウェザーニューズ	3,800	5,340.00	20,292,000	
C I J	8,800	850.00	7,480,000	
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,425.00	4,452,500	
日本エンタープライズ	12,700	222.00	2,819,400	
WOWOW	6,100	2,675.00	16,317,500	
スカラ	11,300	741.00	8,373,300	
インテリジェント ウェイブ	7,500	668.00	5,010,000	
フルキャストホールディングス	10,700	1,888.00	20,201,600	
エン・ジャパン	22,200	3,360.00	74,592,000	
あすか製薬ホールディングス	14,900	1,376.00	20,502,400	
サワイグループホールディングス	28,800	5,230.00	150,624,000	
富士フイルムホールディングス	229,200	7,125.00	1,633,050,000	
コニカミノルタ	264,300	635.00	167,830,500	
資生堂	259,300	7,742.00	2,007,500,600	
ライオン	169,300	2,050.00	347,065,000	
高砂香料工業	8,100	2,657.00	21,521,700	

マンダム	27,300	1,992.00	54,381,600	
ミルボン	17,300	5,640.00	97,572,000	
ファンケル	47,400	3,245.00	153,813,000	
コーセー	24,400	15,580.00	380,152,000	
コタ	8,400	1,521.00	12,776,400	
シーボン	1,400	1,975.00	2,765,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	55,600	2,823.00	156,958,800	
ノエビアホールディングス	11,000	4,780.00	52,580,000	
アジュバンコスメジャパン	3,200	1,011.00	3,235,200	
新日本製薬	2,500	2,010.00	5,025,000	
エスデー	8,500	1,804.00	15,334,000	
アグロ カネショウ	5,000	1,460.00	7,300,000	
コニシ	21,500	1,558.00	33,497,000	
長谷川香料	22,600	2,174.00	49,132,400	
星光PMC	7,500	770.00	5,775,000	
小林製薬	36,500	9,670.00	352,955,000	
荒川化学工業	10,800	1,258.00	13,586,400	
メック	8,900	2,517.00	22,401,300	
日本高純度化学	3,600	2,631.00	9,471,600	
タカラバイオ	34,200	2,791.00	95,452,200	
J C U	14,800	3,955.00	58,534,000	
新田ゼラチン	8,400	635.00	5,334,000	
O A Tアグリオ	2,500	1,394.00	3,485,000	
デクセリアルズ	36,400	2,124.00	77,313,600	
アース製薬	9,800	6,090.00	59,682,000	
北興化学工業	12,100	961.00	11,628,100	
大成ラミック	4,300	2,804.00	12,057,200	
クミアイ化学工業	53,800	871.00	46,859,800	
日本農薬	23,300	568.00	13,234,400	
富士興産	3,900	1,296.00	5,054,400	
ニチレキ	15,500	1,347.00	20,878,500	
ユシロ化学工業	7,400	1,129.00	8,354,600	
ビーピー・カストロール	4,700	1,385.00	6,509,500	
富士石油	31,600	231.00	7,299,600	
MORESCO	5,000	1,094.00	5,470,000	
出光興産	144,600	2,764.00	399,674,400	
ENEOSホールディングス	1,961,200	499.60	979,815,520	
コスモエネルギーホールディングス	41,300	2,520.00	104,076,000	
横浜ゴム	75,400	2,093.00	157,812,200	
TOYO TIRE	68,500	2,069.00	141,726,500	
ブリヂストン	346,800	4,569.00	1,584,529,200	
住友ゴム工業	117,000	1,404.00	164,268,000	
藤倉コンポジット	11,800	485.00	5,723,000	
オカモト	8,100	4,050.00	32,805,000	
アキレス	9,200	1,418.00	13,045,600	
フコク	4,800	770.00	3,696,000	
ニッタ	13,500	2,699.00	36,436,500	

クリエートメディック	4,500	1,009.00	4,540,500	
住友理工	25,300	716.00	18,114,800	
三ツ星ベルト	15,800	1,674.00	26,449,200	
バンドー化学	23,000	742.00	17,066,000	
A G C	119,700	5,110.00	611,667,000	
日本板硝子	66,200	770.00	50,974,000	
石塚硝子	2,400	1,938.00	4,651,200	
有沢製作所	18,300	958.00	17,531,400	
日本山村硝子	5,800	959.00	5,562,200	
日本電気硝子	48,300	2,758.00	133,211,400	
オハラ	5,200	1,547.00	8,044,400	
住友大阪セメント	23,600	3,610.00	85,196,000	
太平洋セメント	77,200	2,841.00	219,325,200	
リソルホールディングス	900	3,975.00	3,577,500	
日本ヒューム	12,200	724.00	8,832,800	
日本コンクリート工業	27,800	396.00	11,008,800	
三谷セキサン	6,000	3,850.00	23,100,000	
アジアパイルホールディングス	20,400	499.00	10,179,600	
東海カーボン	127,300	1,701.00	216,537,300	
日本カーボン	7,300	4,585.00	33,470,500	
東洋炭素	7,700	2,246.00	17,294,200	
ノリタケカンパニーリミテド	7,400	4,420.00	32,708,000	
TOTO	93,200	5,620.00	523,784,000	
日本碍子	143,200	2,021.00	289,407,200	
日本特殊陶業	99,100	1,655.00	164,010,500	
ダントーホールディングス	9,400	313.00	2,942,200	
MARUWA	4,400	11,070.00	48,708,000	
品川リフラクトリーズ	3,000	3,320.00	9,960,000	
黒崎播磨	2,300	4,595.00	10,568,500	
ヨータイ	9,400	1,057.00	9,935,800	
イソライト工業	5,800	646.00	3,746,800	
東京窯業	17,200	320.00	5,504,000	
ニッカトー	5,900	700.00	4,130,000	
フジミインコーポレーテッド	10,600	4,520.00	47,912,000	
クニミネ工業	4,200	1,181.00	4,960,200	
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,010.00	2,525,000	
ニチアス	33,000	2,923.00	96,459,000	
日本製鉄	615,000	2,311.00	1,421,265,000	
神戸製鋼所	236,100	900.00	212,490,000	
中山製鋼所	18,800	478.00	8,986,400	
合同製鐵	7,000	1,854.00	12,978,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	373,100	1,678.00	626,061,800	
東京製鐵	50,400	1,173.00	59,119,200	
共英製鋼	14,300	1,493.00	21,349,900	
大和工業	27,400	3,710.00	101,654,000	
東京鐵鋼	5,000	1,706.00	8,530,000	

大阪製鐵	6,900	1,341.00	9,252,900	
淀川製鋼所	17,500	2,490.00	43,575,000	
丸一鋼管	41,700	2,871.00	119,720,700	
モリ工業	3,900	2,582.00	10,069,800	
大同特殊鋼	21,000	6,160.00	129,360,000	
日本高周波鋼業	4,300	442.00	1,900,600	
日本冶金工業	9,900	2,531.00	25,056,900	
山陽特殊製鋼	15,500	1,817.00	28,163,500	
愛知製鋼	7,400	3,410.00	25,234,000	
日立金属	121,500	2,127.00	258,430,500	
日本金属	3,100	1,169.00	3,623,900	
大太平洋金属	8,600	2,477.00	21,302,200	
新日本電工	83,300	390.00	32,487,000	
栗本鐵工所	5,900	1,728.00	10,195,200	
虹 技	1,400	1,210.00	1,694,000	
日本鑄鉄管	1,500	1,353.00	2,029,500	
日本製鋼所	39,100	2,576.00	100,721,600	
三菱製鋼	9,600	891.00	8,553,600	
日亜鋼業	19,500	307.00	5,986,500	
日本精線	1,800	4,235.00	7,623,000	
エンビプロ・ホールディングス	5,700	1,128.00	6,429,600	
大紀アルミニウム工業所	19,300	1,040.00	20,072,000	
日本軽金属ホールディングス	35,100	2,300.00	80,730,000	
三井金属鉱業	34,800	3,895.00	135,546,000	
東邦亜鉛	7,300	2,512.00	18,337,600	
三菱マテリアル	85,100	2,689.00	228,833,900	
住友金属鉱山	164,600	5,141.00	846,208,600	
DOWAホールディングス	32,500	4,950.00	160,875,000	
古河機械金属	21,400	1,309.00	28,012,600	
エス・サイエンス	60,000	40.00	2,400,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,100	1,059.00	13,872,900	
東邦チタニウム	23,200	1,060.00	24,592,000	
UACJ	19,400	2,839.00	55,076,600	
CKサンエツ	2,400	3,555.00	8,532,000	
古河電気工業	40,200	2,960.00	118,992,000	
住友電気工業	449,600	1,631.00	733,297,600	
フジクラ	155,800	576.00	89,740,800	
昭和電線ホールディングス	12,500	1,576.00	19,700,000	
東京特殊電線	1,600	2,624.00	4,198,400	
タツタ電線	22,500	605.00	13,612,500	
カナレ電気	2,500	1,781.00	4,452,500	
平河ヒューテック	7,200	1,311.00	9,439,200	
リョービ	15,600	1,657.00	25,849,200	
アーレスティ	16,000	490.00	7,840,000	
アサヒホールディングス	48,000	2,372.00	113,856,000	
東洋製罐グループホールディングス	82,100	1,324.00	108,700,400	
ホッカンホールディングス	6,600	1,412.00	9,319,200	

コロナ	7,400	938.00	6,941,200	
横河ブリッジホールディングス	22,300	2,117.00	47,209,100	
駒井ハルテック	2,500	1,932.00	4,830,000	
高田機工	900	2,684.00	2,415,600	
三和ホールディングス	121,500	1,375.00	167,062,500	
文化シヤッター	38,200	975.00	37,245,000	
三協立山	16,500	859.00	14,173,500	
アルインコ	8,500	1,028.00	8,738,000	
東洋シヤッター	2,500	641.00	1,602,500	
L I X I L	177,300	2,893.00	512,928,900	
日本ファイルコン	9,300	494.00	4,594,200	
ノーリツ	26,800	1,698.00	45,506,400	
長府製作所	13,200	2,032.00	26,822,400	
リンナイ	25,000	11,010.00	275,250,000	
ユニプレス	21,400	1,088.00	23,283,200	
ダイニチ工業	6,100	810.00	4,941,000	
日東精工	16,600	555.00	9,213,000	
三洋工業	1,400	1,967.00	2,753,800	
岡部	26,700	743.00	19,838,100	
ジーテクト	16,000	1,424.00	22,784,000	
東プレ	24,100	1,463.00	35,258,300	
高周波熱錬	24,500	562.00	13,769,000	
東京製綱	9,100	1,117.00	10,164,700	
サンコール	11,300	459.00	5,186,700	
モリテックスチール	9,800	442.00	4,331,600	
パイオラックス	19,100	1,507.00	28,783,700	
エイチワン	12,700	811.00	10,299,700	
日本発条	128,400	798.00	102,463,200	
中央発条	4,200	1,085.00	4,557,000	
アドバネクス	1,700	1,464.00	2,488,800	
三浦工業	55,700	5,640.00	314,148,000	
タクマ	43,700	2,294.00	100,247,800	
テクノプロ・ホールディングス	24,900	8,060.00	200,694,000	
アトラグループ	2,600	323.00	839,800	
インターワークス	3,900	386.00	1,505,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,100	12,830.00	65,433,000	
K e e P e r 技研	8,000	2,183.00	17,464,000	
ファーストロジック	2,500	770.00	1,925,000	
三機サービス	2,500	1,071.00	2,677,500	
G u n o s y	7,400	992.00	7,340,800	
デザインワン・ジャパン	3,900	246.00	959,400	
イー・ガーディアン	5,500	2,646.00	14,553,000	
リブセンス	6,800	232.00	1,577,600	
ジャパンマテリアル	38,500	1,229.00	47,316,500	
ベクトル	15,600	926.00	14,445,600	
ウチヤマホールディングス	6,400	367.00	2,348,800	

チャーム・ケア・コーポレーション	9,200	1,193.00	10,975,600	
キャリアリンク	4,100	2,169.00	8,892,900	
I B J	9,900	855.00	8,464,500	
アサンテ	4,500	1,825.00	8,212,500	
バリューHR	5,000	1,632.00	8,160,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	10,200	4,580.00	46,716,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	1,686.00	7,924,200	
E R I ホールディングス	3,000	587.00	1,761,000	
アビスト	1,900	2,996.00	5,692,400	
シグマクシス	6,800	2,072.00	14,089,600	
ウィルグループ	9,100	999.00	9,090,900	
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,200	243.00	4,422,600	
メドピア	9,600	5,540.00	53,184,000	
レアジョブ	1,700	1,982.00	3,369,400	
リクルートホールディングス	892,400	5,007.00	4,468,246,800	
エラン	17,200	1,314.00	22,600,800	
ツガミ	26,700	1,681.00	44,882,700	
オークマ	15,000	5,920.00	88,800,000	
芝浦機械	13,500	2,636.00	35,586,000	
アマダ	188,700	1,203.00	227,006,100	
アイダエンジニアリング	33,900	926.00	31,391,400	
滝澤鉄工所	4,300	1,175.00	5,052,500	
F U J I	51,400	2,846.00	146,284,400	
牧野フライス製作所	15,100	4,330.00	65,383,000	
オーエスジー	63,700	1,805.00	114,978,500	
ダイジェット工業	1,000	1,324.00	1,324,000	
旭ダイヤモンド工業	34,400	529.00	18,197,600	
DMG森精機	81,500	1,782.00	145,233,000	
ソディック	28,300	1,067.00	30,196,100	
ディスコ	17,500	33,550.00	587,125,000	
日東工器	6,200	1,922.00	11,916,400	
日進工具	10,100	1,536.00	15,513,600	
パンチ工業	10,800	574.00	6,199,200	
富士ダイス	7,100	647.00	4,593,700	
土木管理総合試験所	6,100	412.00	2,513,200	
ネットマーケティング	5,900	589.00	3,475,100	
日本郵政	942,900	929.40	876,331,260	
ベルシステム24ホールディングス	20,900	1,632.00	34,108,800	
鎌倉新書	12,500	1,358.00	16,975,000	
SMN	2,500	802.00	2,005,000	
一蔵	1,800	399.00	718,200	
グローバルキッズCOMPANY	2,400	1,009.00	2,421,600	
エアトリ	7,800	2,186.00	17,050,800	
アトラエ	7,600	1,621.00	12,319,600	
ストライク	4,500	4,200.00	18,900,000	
ソラスト	30,600	1,357.00	41,524,200	

セラク	3,900	2,292.00	8,938,800	
インソース	12,100	2,261.00	27,358,100	
豊田自動織機	105,500	9,030.00	952,665,000	
豊和工業	7,200	867.00	6,242,400	
OKK	5,300	436.00	2,310,800	
石川製作所	3,200	1,745.00	5,584,000	
東洋機械金属	9,200	519.00	4,774,800	
津田駒工業	2,500	919.00	2,297,500	
エンシュウ	2,500	988.00	2,470,000	
島精機製作所	19,000	2,225.00	42,275,000	
オプトラン	16,100	2,756.00	44,371,600	
NCホールディングス	3,300	681.00	2,247,300	
イワキ	8,300	987.00	8,192,100	
フリュー	12,600	966.00	12,171,600	
ヤマシンフィルタ	25,900	805.00	20,849,500	
日阪製作所	16,300	845.00	13,773,500	
やまびこ	25,000	1,208.00	30,200,000	
平田機工	6,000	6,960.00	41,760,000	
ペガサスミシン製造	13,400	500.00	6,700,000	
マルマエ	4,700	1,731.00	8,135,700	
タツモ	5,500	1,695.00	9,322,500	
ナブテスコ	75,900	4,930.00	374,187,000	
三井海洋開発	13,700	2,241.00	30,701,700	
レオン自動機	12,500	1,185.00	14,812,500	
SMC	38,100	63,630.00	2,424,303,000	
ホソカワミクロン	4,400	6,180.00	27,192,000	
ユニオンツール	4,800	3,515.00	16,872,000	
オイレス工業	18,200	1,615.00	29,393,000	
日精エー・エス・ビー機械	4,300	5,120.00	22,016,000	
サトーホールディングス	16,900	2,747.00	46,424,300	
技研製作所	11,400	4,510.00	51,414,000	
日本エアータック	4,200	1,183.00	4,968,600	
カワタ	3,500	905.00	3,167,500	
日精樹脂工業	10,000	999.00	9,990,000	
オカダアイヨン	4,200	1,216.00	5,107,200	
ワイエイシイホールディングス	5,100	930.00	4,743,000	
小松製作所	590,600	3,306.00	1,952,523,600	
住友重機械工業	74,500	3,305.00	246,222,500	
日立建機	61,000	3,560.00	217,160,000	
日工	19,500	718.00	14,001,000	
巴工業	5,300	2,086.00	11,055,800	
井関農機	13,000	1,579.00	20,527,000	
TOWA	12,300	2,105.00	25,891,500	
丸山製作所	2,500	1,821.00	4,552,500	
北川鉄工所	6,000	1,612.00	9,672,000	
シンニッタン	15,800	273.00	4,313,400	
ローツェ	5,800	9,210.00	53,418,000	

タカキタ	4,700	651.00	3,059,700	
クボタ	684,900	2,620.00	1,794,438,000	
荏原実業	3,100	4,870.00	15,097,000	
東洋エンジニアリング	16,800	723.00	12,146,400	
三菱化工機	4,200	2,764.00	11,608,800	
月島機械	24,000	1,216.00	29,184,000	
帝国電機製作所	9,100	1,284.00	11,684,400	
東京機械製作所	4,700	526.00	2,472,200	
新東工業	31,100	763.00	23,729,300	
澁谷工業	11,400	3,565.00	40,641,000	
アイチコーポレーション	22,700	889.00	20,180,300	
小森コーポレーション	33,300	755.00	25,141,500	
鶴見製作所	10,000	1,760.00	17,600,000	
住友精密工業	2,200	2,182.00	4,800,400	
日本ギア工業	6,600	320.00	2,112,000	
酒井重工業	2,200	2,080.00	4,576,000	
荏原製作所	54,000	4,715.00	254,610,000	
石井鐵工所	1,300	2,928.00	3,806,400	
西島製作所	13,400	866.00	11,604,400	
北越工業	13,600	1,125.00	15,300,000	
ダイキン工業	166,000	22,020.00	3,655,320,000	
オルガノ	4,200	7,190.00	30,198,000	
トーヨーカネツ	4,800	2,633.00	12,638,400	
栗田工業	70,600	4,755.00	335,703,000	
椿本チエイン	18,500	3,010.00	55,685,000	
大同工業	5,100	875.00	4,462,500	
日機装	42,100	1,148.00	48,330,800	
木村化工機	10,700	777.00	8,313,900	
レイズネクスト	22,200	1,186.00	26,329,200	
アネスト岩田	22,200	1,000.00	22,200,000	
ダイフク	71,700	10,790.00	773,643,000	
サムコ	3,100	3,120.00	9,672,000	
加藤製作所	7,100	1,071.00	7,604,100	
油研工業	1,800	1,662.00	2,991,600	
タダノ	62,900	1,121.00	70,510,900	
フジテック	45,000	2,524.00	113,580,000	
C K D	30,300	2,389.00	72,386,700	
キトー	10,900	1,869.00	20,372,100	
平和	36,300	1,923.00	69,804,900	
理想科学工業	10,000	1,342.00	13,420,000	
SANKYO	30,800	2,905.00	89,474,000	
日本金銭機械	14,400	582.00	8,380,800	
マースグループホールディングス	8,300	1,601.00	13,288,300	
フクシマガリレイ	9,000	4,160.00	37,440,000	
オーイズミ	5,700	389.00	2,217,300	
ダイコク電機	6,000	934.00	5,604,000	
竹内製作所	21,800	2,961.00	64,549,800	

アマノ	34,200	2,933.00	100,308,600	
JUK I	18,100	826.00	14,950,600	
サンデンホールディングス	18,100	385.00	6,968,500	
蛇の目ミシン工業	11,500	775.00	8,912,500	
ブラザー工業	159,000	2,154.00	342,486,000	
マックス	18,100	1,638.00	29,647,800	
モリタホールディングス	20,900	1,588.00	33,189,200	
グローリー	33,500	2,380.00	79,730,000	
新晃工業	12,200	2,335.00	28,487,000	
大和冷機工業	20,800	1,113.00	23,150,400	
セガサミーホールディングス	118,500	1,579.00	187,111,500	
日本ピストンリング	5,000	1,100.00	5,500,000	
リケン	6,000	2,375.00	14,250,000	
T P R	17,600	1,632.00	28,723,200	
ツバキ・ナカシマ	25,000	1,691.00	42,275,000	
ホシザキ	40,900	9,970.00	407,773,000	
大豊工業	10,700	975.00	10,432,500	
日本精工	267,700	1,043.00	279,211,100	
N T N	301,100	336.00	101,169,600	
ジェイテクト	125,000	1,065.00	133,125,000	
不二越	12,300	4,210.00	51,783,000	
ミネベアミツミ	224,600	2,755.00	618,773,000	
日本トムソン	35,700	677.00	24,168,900	
T H K	81,300	3,720.00	302,436,000	
ユーシン精機	8,600	869.00	7,473,400	
前澤給装工業	9,200	1,101.00	10,129,200	
イーグル工業	16,200	1,178.00	19,083,600	
前澤工業	8,000	670.00	5,360,000	
日本ピラー工業	13,300	1,853.00	24,644,900	
キッツ	40,700	724.00	29,466,800	
日立製作所	626,600	5,269.00	3,301,555,400	
東芝	257,900	4,515.00	1,164,418,500	
三菱電機	1,303,800	1,683.50	2,194,947,300	
富士電機	78,400	4,990.00	391,216,000	
東洋電機製造	5,200	1,261.00	6,557,200	
安川電機	140,400	4,955.00	695,682,000	
シンフォニア テクノロジー	17,000	1,483.00	25,211,000	
明電舎	22,200	2,339.00	51,925,800	
オリジン	2,700	1,347.00	3,636,900	
山洋電気	6,100	7,710.00	47,031,000	
デンヨー	11,100	2,000.00	22,200,000	
ベイカレント・コンサルティング	8,100	33,950.00	274,995,000	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	2,600	2,695.00	7,007,000	
アイモバイル	4,300	1,305.00	5,611,500	
キャリアインデックス	5,100	584.00	2,978,400	
M S - J a p a n	5,000	1,008.00	5,040,000	

船場	1,700	849.00	1,443,300	
グレイステクノロジー	12,300	2,597.00	31,943,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	35,900	2,089.00	74,995,100	
フルテック	1,900	1,414.00	2,686,600	
グリーンズ	4,500	576.00	2,592,000	
ツナググループ・ホールディングス	1,800	299.00	538,200	
G A M E W I T H	3,900	684.00	2,667,600	
ソウルドアウト	2,800	1,519.00	4,253,200	
M S & C o n s u l t i n g	2,200	595.00	1,309,000	
ウェルビー	4,600	1,438.00	6,614,800	
エル・ティー・エス	900	4,210.00	3,789,000	
ミダック	2,500	5,160.00	12,900,000	
日総工産	9,600	755.00	7,248,000	
キュービーネットホールディングス	5,800	1,738.00	10,080,400	
R P A ホールディングス	14,000	715.00	10,010,000	
三櫻工業	17,900	1,143.00	20,459,700	
マキタ	170,000	4,910.00	834,700,000	
東芝テック	14,100	4,465.00	62,956,500	
芝浦メカトロニクス	2,400	5,910.00	14,184,000	
マブチモーター	36,000	4,345.00	156,420,000	
日本電産	313,900	12,070.00	3,788,773,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,700	925.00	7,122,500	
トレックス・セミコンダクター	7,100	1,870.00	13,277,000	
東光高岳	6,600	1,402.00	9,253,200	
ダブル・スコープ	25,400	675.00	17,145,000	
宮越ホールディングス	4,800	954.00	4,579,200	
ダイヘン	14,200	4,820.00	68,444,000	
ヤーマン	21,300	1,428.00	30,416,400	
J V C ケンウッド	111,700	229.00	25,579,300	
ミマキエンジニアリング	12,200	670.00	8,174,000	
I - P E X	6,000	2,030.00	12,180,000	
日新電機	30,600	1,205.00	36,873,000	
大崎電気工業	25,800	598.00	15,428,400	
オムロン	108,500	8,200.00	889,700,000	
日東工業	19,000	1,951.00	37,069,000	
I D E C	17,600	1,713.00	30,148,800	
正興電機製作所	4,100	1,669.00	6,842,900	
不二電機工業	2,500	1,281.00	3,202,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,800	2,879.00	134,737,200	
サクサホールディングス	3,000	1,485.00	4,455,000	
メルコホールディングス	4,400	4,460.00	19,624,000	
テクノメディカ	3,000	1,601.00	4,803,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,800	2,755.00	10,469,000	
日本電気	165,600	6,160.00	1,020,096,000	
富士通	117,300	16,690.00	1,957,737,000	

沖電気工業	53,000	1,066.00	56,498,000	
岩崎通信機	4,800	920.00	4,416,000	
電気興業	6,200	2,517.00	15,605,400	
サンケン電気	15,200	5,140.00	78,128,000	
ナカヨ	2,200	1,497.00	3,293,400	
アイホン	7,400	2,080.00	15,392,000	
ルネサスエレクトロニクス	560,900	1,173.00	657,935,700	
セイコーエプソン	161,500	1,887.00	304,750,500	
ワコム	94,300	670.00	63,181,000	
アルバック	23,900	4,845.00	115,795,500	
アクセル	5,500	1,044.00	5,742,000	
E I Z O	11,000	4,090.00	44,990,000	
ジャパンディスプレイ	442,700	45.00	19,921,500	
日本信号	30,700	956.00	29,349,200	
京三製作所	28,400	405.00	11,502,000	
能美防災	17,300	2,070.00	35,811,000	
ホーチキ	9,400	1,275.00	11,985,000	
星和電機	6,500	596.00	3,874,000	
エレコム	30,000	2,254.00	67,620,000	
パナソニック	1,390,400	1,215.50	1,690,031,200	
シャープ	173,300	1,741.00	301,715,300	
アンリツ	78,300	2,171.00	169,989,300	
富士通ゼネラル	39,900	2,820.00	112,518,000	
ソニーグループ	816,600	10,400.00	8,492,640,000	
TDK	63,000	13,990.00	881,370,000	
帝国通信工業	6,000	1,092.00	6,552,000	
タムラ製作所	46,800	517.00	24,195,600	
アルプスアルパイン	106,300	1,229.00	130,642,700	
池上通信機	4,300	873.00	3,753,900	
日本電波工業	12,600	720.00	9,072,000	
鈴木	5,800	1,183.00	6,861,400	
日本トリム	2,600	3,750.00	9,750,000	
ローランド ディー. ジー.	7,700	1,834.00	14,121,800	
フォスター電機	13,600	1,175.00	15,980,000	
SMK	3,300	2,763.00	9,117,900	
ヨコオ	9,700	2,555.00	24,783,500	
ティアック	8,000	126.00	1,008,000	
ホシデン	35,500	1,068.00	37,914,000	
ヒロセ電機	20,100	15,190.00	305,319,000	
日本航空電子工業	29,800	1,920.00	57,216,000	
TOA	15,400	890.00	13,706,000	
マクセルホールディングス	25,700	1,301.00	33,435,700	
古野電気	16,600	1,096.00	18,193,600	
ユニデンホールディングス	3,200	2,593.00	8,297,600	
スミダコーポレーション	10,900	1,015.00	11,063,500	
アイコム	5,600	2,614.00	14,638,400	
リオン	5,600	2,622.00	14,683,200	

本多通信工業	10,200	505.00	5,151,000	
船井電機	14,800	913.00	13,512,400	
横河電機	130,400	2,018.00	263,147,200	
新電元工業	5,000	3,500.00	17,500,000	
アズビル	88,200	4,410.00	388,962,000	
東亜ディーケーケー	6,700	832.00	5,574,400	
日本光電工業	53,900	3,290.00	177,331,000	
チノー	4,200	1,339.00	5,623,800	
共和電業	14,700	388.00	5,703,600	
日本電子材料	4,700	1,931.00	9,075,700	
堀場製作所	25,700	7,480.00	192,236,000	
アドバンテスト	96,900	9,640.00	934,116,000	
小野測器	4,700	520.00	2,444,000	
エスベック	11,500	1,869.00	21,493,500	
キーエンス	127,900	52,220.00	6,678,938,000	
日置電機	6,100	5,220.00	31,842,000	
シスメックス	101,600	10,860.00	1,103,376,000	
日本マイクロニクス	22,600	1,613.00	36,453,800	
メガチップス	13,200	3,570.00	47,124,000	
OBARA GROUP	5,900	3,800.00	22,420,000	
IMAGICA GROUP	10,900	521.00	5,678,900	
澤藤電機	1,400	2,246.00	3,144,400	
デンソー	287,100	7,088.00	2,034,964,800	
原田工業	5,600	883.00	4,944,800	
コーセル	15,900	1,046.00	16,631,400	
イリソ電子工業	10,900	5,540.00	60,386,000	
オブテックスグループ	21,500	1,921.00	41,301,500	
千代田インテグレ	5,700	1,805.00	10,288,500	
アイ・オー・データ機器	4,800	1,091.00	5,236,800	
レーザーテック	57,100	17,810.00	1,016,951,000	
スタンレー電気	91,400	3,060.00	279,684,000	
岩崎電気	4,700	1,489.00	6,998,300	
ウシオ電機	66,900	1,437.00	96,135,300	
岡谷電機産業	9,700	392.00	3,802,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	12,400	351.00	4,352,400	
エノモト	3,600	1,790.00	6,444,000	
日本セラミック	13,200	2,720.00	35,904,000	
遠藤照明	7,400	736.00	5,446,400	
古河電池	9,200	1,571.00	14,453,200	
双信電機	6,400	495.00	3,168,000	
山一電機	8,300	1,546.00	12,831,800	
図研	8,500	3,120.00	26,520,000	
日本電子	23,800	5,760.00	137,088,000	
カシオ計算機	104,800	1,894.00	198,491,200	
ファナック	114,500	25,525.00	2,922,612,500	
日本シイエムケイ	28,000	471.00	13,188,000	
エンプラス	5,900	4,060.00	23,954,000	

大真空	4,300	2,523.00	10,848,900	
ローム	54,200	10,190.00	552,298,000	
浜松ホトニクス	93,400	6,170.00	576,278,000	
三井ハイテック	12,800	4,020.00	51,456,000	
新光電気工業	43,700	3,250.00	142,025,000	
京セラ	198,600	6,695.00	1,329,627,000	
協栄産業	1,600	1,387.00	2,219,200	
太陽誘電	57,900	4,750.00	275,025,000	
村田製作所	383,100	8,381.00	3,210,761,100	
双葉電子工業	22,200	901.00	20,002,200	
日東電工	78,800	8,690.00	684,772,000	
北陸電気工業	5,100	985.00	5,023,500	
東海理化電機製作所	34,300	1,730.00	59,339,000	
ニチコン	40,900	1,080.00	44,172,000	
日本ケミコン	13,200	2,077.00	27,416,400	
K O A	18,100	1,644.00	29,756,400	
三井E & Sホールディングス	50,000	589.00	29,450,000	
日立造船	103,400	814.00	84,167,600	
三菱重工業	204,700	3,443.00	704,782,100	
川崎重工業	101,400	2,674.00	271,143,600	
I H I	87,600	2,270.00	198,852,000	
名村造船所	39,100	185.00	7,233,500	
サノヤスホールディングス	17,000	152.00	2,584,000	
スプリックス	3,500	1,044.00	3,654,000	
マネジメントソリューションズ	6,000	1,884.00	11,304,000	
プロレド・パートナーズ	1,700	2,853.00	4,850,100	
a n d f a c t o r y	1,000	690.00	690,000	
テノ・ホールディングス	900	1,106.00	995,400	
フロンティア・マネジメント	2,300	1,590.00	3,657,000	
ピアラ	800	1,540.00	1,232,000	
コプロ・ホールディングス	1,600	1,299.00	2,078,400	
ギークス	1,600	1,644.00	2,630,400	
カーブスホールディングス	34,300	806.00	27,645,800	
フォーラムエンジニアリング	8,600	1,030.00	8,858,000	
日本車輛製造	4,700	2,408.00	11,317,600	
三菱ロジスネクスト	17,300	1,159.00	20,050,700	
近畿車輛	1,700	1,291.00	2,194,700	
F P G	43,200	718.00	31,017,600	
島根銀行	4,700	699.00	3,285,300	
じもとホールディングス	8,800	704.00	6,195,200	
全国保証	33,400	4,765.00	159,151,000	
めぶきフィナンシャルグループ	666,300	244.00	162,577,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,700	1,635.00	14,224,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,000	1,239.00	19,824,000	
九州フィナンシャルグループ	262,900	430.00	113,047,000	
かんぽ生命保険	159,300	2,140.00	340,902,000	

ゆうちょ銀行	364,600	1,034.00	376,996,400	
富山第一銀行	31,400	286.00	8,980,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	782,300	424.00	331,695,200	
ジェイリース	4,200	823.00	3,456,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	85,600	720.00	61,632,000	
マーキュリアインベストメント	5,300	807.00	4,277,100	
イントラスト	3,600	638.00	2,296,800	
日本モーゲージサービス	6,500	1,008.00	6,552,000	
CASA	3,500	916.00	3,206,000	
アルヒ	18,900	1,764.00	33,339,600	
プレミアムグループ	6,000	2,485.00	14,910,000	
日産自動車	1,537,500	578.60	889,597,500	
いすゞ自動車	346,000	1,123.00	388,558,000	
トヨタ自動車	1,320,800	8,341.00	11,016,792,800	
日野自動車	162,800	932.00	151,729,600	
三菱自動車工業	482,000	303.00	146,046,000	
エフテック	9,200	729.00	6,706,800	
レシップホールディングス	5,100	549.00	2,799,900	
GMB	2,500	939.00	2,347,500	
ファルテック	2,500	886.00	2,215,000	
武蔵精密工業	29,100	1,855.00	53,980,500	
日産車体	19,100	725.00	13,847,500	
新明和工業	36,800	1,002.00	36,873,600	
極東開発工業	22,500	1,690.00	38,025,000	
トビー工業	10,900	1,465.00	15,968,500	
ティラド	4,200	1,912.00	8,030,400	
曙ブレーキ工業	70,300	181.00	12,724,300	
タチエス	20,100	1,139.00	22,893,900	
NOK	63,100	1,412.00	89,097,200	
フタバ産業	32,700	529.00	17,298,300	
KYB	14,500	3,115.00	45,167,500	
市光工業	19,200	692.00	13,286,400	
大同メタル工業	27,100	575.00	15,582,500	
プレス工業	64,800	329.00	21,319,200	
ミクニ	17,600	317.00	5,579,200	
太平洋工業	27,400	1,220.00	33,428,000	
河西工業	17,800	453.00	8,063,400	
アイシン	95,400	4,315.00	411,651,000	
マツダ	408,800	875.00	357,700,000	
今仙電機製作所	11,300	713.00	8,056,900	
本田技研工業	1,026,300	3,332.00	3,419,631,600	
スズキ	258,500	4,110.00	1,062,435,000	
SUBARU	373,600	2,078.50	776,527,600	
安永	6,100	1,188.00	7,246,800	
ヤマハ発動機	184,200	2,737.00	504,155,400	

小糸製作所	78,100	6,740.00	526,394,000	
T B K	13,000	410.00	5,330,000	
エクセディ	17,700	1,580.00	27,966,000	
ミツバ	23,800	657.00	15,636,600	
豊田合成	42,100	2,678.00	112,743,800	
愛三工業	20,900	768.00	16,051,200	
盟和産業	1,700	858.00	1,458,600	
日本プラスト	11,300	573.00	6,474,900	
ヨロズ	11,200	1,236.00	13,843,200	
エフ・シー・シー	21,400	1,748.00	37,407,200	
新家工業	3,300	1,727.00	5,699,100	
シマノ	48,800	24,910.00	1,215,608,000	
テイ・エス テック	60,700	1,478.00	89,714,600	
三十三フィナンシャルグループ	11,200	1,337.00	14,974,400	
第四北越フィナンシャルグループ	20,900	2,381.00	49,762,900	
ひろぎんホールディングス	190,100	612.00	116,341,200	
ダイレクトマーケティングミックス	6,500	3,495.00	22,717,500	
ポピンズホールディングス	3,300	4,960.00	16,368,000	
L I T A L I C O	5,100	5,140.00	26,214,000	
ジャムコ	7,700	886.00	6,822,200	
小野建	11,600	1,370.00	15,892,000	
はるやまホールディングス	6,700	666.00	4,462,200	
南陽	2,400	1,772.00	4,252,800	
ノジマ	22,700	3,215.00	72,980,500	
佐鳥電機	8,300	792.00	6,573,600	
カッパ・クリエイト	18,200	1,462.00	26,608,400	
エコートレーディング	2,700	602.00	1,625,400	
伯東	7,900	1,528.00	12,071,200	
コンドーテック	10,000	1,007.00	10,070,000	
中山福	7,900	470.00	3,713,000	
ライトオン	9,600	678.00	6,508,800	
ナガイレーベン	17,100	2,510.00	42,921,000	
三菱食品	14,200	2,917.00	41,421,400	
良品計画	147,700	2,277.00	336,312,900	
三城ホールディングス	16,400	273.00	4,477,200	
松田産業	9,300	2,364.00	21,985,200	
第一興商	25,500	4,310.00	109,905,000	
メディバルホールディングス	128,600	2,125.00	273,275,000	
アドヴァン	13,100	961.00	12,589,100	
S P K	6,000	1,320.00	7,920,000	
萩原電気ホールディングス	4,800	2,631.00	12,628,800	
アルビス	4,200	2,323.00	9,756,600	
アズワン	9,200	13,210.00	121,532,000	
スズデン	3,900	1,318.00	5,140,200	
尾家産業	3,200	1,191.00	3,811,200	
シモジマ	7,200	1,130.00	8,136,000	
ドウシシャ	12,300	1,797.00	22,103,100	

小津産業	2,600	2,150.00	5,590,000	
コナカ	15,500	336.00	5,208,000	
高速	6,900	1,443.00	9,956,700	
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,655.00	2,151,500	
G-7ホールディングス	6,200	2,861.00	17,738,200	
たけびし	3,900	1,467.00	5,721,300	
イオン北海道	17,300	1,103.00	19,081,900	
コジマ	22,000	895.00	19,690,000	
ヒマラヤ	4,700	970.00	4,559,000	
コーナン商事	18,300	3,030.00	55,449,000	
ネットワンシステムズ	52,100	3,355.00	174,795,500	
エコス	4,700	1,850.00	8,695,000	
ワタミ	16,900	957.00	16,173,300	
マルシェ	3,200	480.00	1,536,000	
リックス	2,500	1,503.00	3,757,500	
システムソフト	28,000	158.00	4,424,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	256,900	2,299.00	590,613,100	
丸文	11,500	520.00	5,980,000	
西松屋チェーン	28,200	1,716.00	48,391,200	
ゼンショーホールディングス	68,900	2,779.00	191,473,100	
ハビネット	10,700	1,504.00	16,092,800	
幸楽苑ホールディングス	8,100	1,614.00	13,073,400	
ハークスレイ	2,300	905.00	2,081,500	
橋本総業ホールディングス	2,300	2,550.00	5,865,000	
日本ライフライン	41,400	1,486.00	61,520,400	
サイゼリヤ	19,000	2,389.00	45,391,000	
タカショー	8,400	757.00	6,358,800	
V Tホールディングス	48,500	418.00	20,273,000	
マルカ	4,200	2,157.00	9,059,400	
アルゴグラフィックス	9,900	3,025.00	29,947,500	
魚力	3,900	1,886.00	7,355,400	
I D O M	43,300	598.00	25,893,400	
日本エム・ディ・エム	7,400	2,203.00	16,302,200	
ポブラ	3,600	307.00	1,105,200	
フジ・コーポレーション	6,600	1,298.00	8,566,800	
ユナイテッドアローズ	14,500	1,851.00	26,839,500	
進和	7,700	2,065.00	15,900,500	
エスケイジャパン	2,800	446.00	1,248,800	
ダイトロン	5,600	2,023.00	11,328,800	
ハイデイ日高	18,400	1,713.00	31,519,200	
シークス	16,400	1,521.00	24,944,400	
京都きもの友禅	7,100	286.00	2,030,600	
コロワイド	42,600	1,832.00	78,043,200	
ピーシーデポコーポレーション	14,900	454.00	6,764,600	
田中商事	3,300	663.00	2,187,900	
オーハシテクニカ	6,800	1,441.00	9,798,800	

壺番屋	9,200	4,825.00	44,390,000	
白銅	4,100	1,766.00	7,240,600	
トップカルチャー	5,300	348.00	1,844,400	
P L A N T	3,300	725.00	2,392,500	
スギホールディングス	25,500	8,280.00	211,140,000	
ダイコー通産	1,100	1,747.00	1,921,700	
薬王堂ホールディングス	5,700	2,371.00	13,514,700	
島津製作所	167,600	3,825.00	641,070,000	
J M S	10,900	957.00	10,431,300	
クボテック	3,300	355.00	1,171,500	
長野計器	9,300	1,201.00	11,169,300	
ブイ・テクノロジー	6,000	5,300.00	31,800,000	
スター精密	20,200	1,674.00	33,814,800	
東京計器	8,200	1,058.00	8,675,600	
愛知時計電機	1,300	4,375.00	5,687,500	
インターアクション	6,500	2,247.00	14,605,500	
オーバル	11,600	276.00	3,201,600	
東京精密	22,100	5,390.00	119,119,000	
マニー	51,800	2,461.00	127,479,800	
ニコン	199,100	1,054.00	209,851,400	
トプコン	65,600	1,561.00	102,401,600	
オリンパス	721,300	2,191.50	1,580,728,950	
理研計器	11,500	2,813.00	32,349,500	
S C R E E Nホールディングス	22,500	9,950.00	223,875,000	
キヤノン電子	12,200	1,757.00	21,435,400	
タムロン	10,600	2,371.00	25,132,600	
H O Y A	256,600	12,720.00	3,263,952,000	
シード	5,800	739.00	4,286,200	
ノーリツ鋼機	11,600	2,477.00	28,733,200	
エー・アンド・デイ	10,800	1,298.00	14,018,400	
朝日インテック	137,100	2,902.00	397,864,200	
キヤノン	647,500	2,599.50	1,683,176,250	
リコー	331,700	1,258.00	417,278,600	
シチズン時計	164,700	382.00	62,915,400	
リズム	3,300	788.00	2,600,400	
大研医器	10,500	570.00	5,985,000	
メニコン	20,000	6,800.00	136,000,000	
シンシア	1,300	886.00	1,151,800	
中本パックス	3,300	1,585.00	5,230,500	
スノーピーク	7,700	3,945.00	30,376,500	
パラマウントベッドホールディングス	25,100	2,171.00	54,492,100	
トランザクション	7,100	1,289.00	9,151,900	
粧美堂	3,200	406.00	1,299,200	
ニホンフラッシュ	11,000	1,319.00	14,509,000	
前田工織	14,300	3,370.00	48,191,000	
永大産業	18,300	335.00	6,130,500	
アートネイチャー	12,700	667.00	8,470,900	

バンダイナムコホールディングス	107,900	7,740.00	835,146,000	
アイフィスジャパン	3,500	707.00	2,474,500	
共立印刷	23,900	131.00	3,130,900	
SHOEI	12,200	3,885.00	47,397,000	
フランスベッドホールディングス	17,000	913.00	15,521,000	
マーベラス	20,000	803.00	16,060,000	
パイロットコーポレーション	23,100	3,495.00	80,734,500	
萩原工業	7,400	1,428.00	10,567,200	
エイベックス	22,200	1,471.00	32,656,200	
トッパン・フォームズ	23,500	1,144.00	26,884,000	
フジシールインターナショナル	26,800	2,430.00	65,124,000	
タカラトミー	58,400	943.00	55,071,200	
廣済堂	8,900	1,009.00	8,980,100	
エステールホールディングス	4,300	627.00	2,696,100	
レック	15,500	1,159.00	17,964,500	
タカノ	5,000	624.00	3,120,000	
三光合成	13,600	439.00	5,970,400	
プロネックス	11,300	1,119.00	12,644,700	
ホクシン	9,300	210.00	1,953,000	
ウッドワン	3,800	1,678.00	6,376,400	
大建工業	8,900	2,039.00	18,147,100	
きもと	20,700	278.00	5,754,600	
凸版印刷	197,900	1,918.00	379,572,200	
大日本印刷	157,400	2,235.00	351,789,000	
共同印刷	4,200	2,719.00	11,419,800	
NISSHA	26,800	1,313.00	35,188,400	
光村印刷	900	1,742.00	1,567,800	
藤森工業	11,600	4,105.00	47,618,000	
TAKARA & COMPANY	6,500	1,890.00	12,285,000	
前澤化成工業	8,500	1,139.00	9,681,500	
未来工業	4,700	1,752.00	8,234,400	
アシックス	115,300	1,780.00	205,234,000	
ツツミ	3,200	2,329.00	7,452,800	
ウェーブロックホールディングス	4,300	726.00	3,121,800	
JSP	7,700	1,701.00	13,097,700	
ニチハ	18,200	3,095.00	56,329,000	
ローランド	10,100	5,660.00	57,166,000	
エフピコ	24,000	4,375.00	105,000,000	
小松ウオール工業	4,200	2,025.00	8,505,000	
ヤマハ	77,500	5,910.00	458,025,000	
河合楽器製作所	3,600	3,480.00	12,528,000	
クリナップ	12,500	551.00	6,887,500	
ピジョン	83,700	3,615.00	302,575,500	
天馬	9,700	2,256.00	21,883,200	
オリバー	2,500	2,672.00	6,680,000	
兼松サステック	800	1,774.00	1,419,200	
キングジム	11,400	944.00	10,761,600	

象印マホービン	35,100	1,698.00	59,599,800	
リンテック	28,100	2,480.00	69,688,000	
信越ポリマー	20,300	1,069.00	21,700,700	
東リ	34,000	252.00	8,568,000	
イトーキ	25,400	370.00	9,398,000	
任天堂	74,500	62,480.00	4,654,760,000	
三菱鉛筆	21,400	1,449.00	31,008,600	
松風	6,000	2,098.00	12,588,000	
タカラスタンダード	27,100	1,578.00	42,763,800	
コクヨ	62,400	1,756.00	109,574,400	
ナカバヤシ	13,300	597.00	7,940,100	
ニフコ	47,900	3,670.00	175,793,000	
立川ブラインド工業	5,800	1,338.00	7,760,400	
グローブライト	6,100	4,240.00	25,864,000	
オカムラ	44,900	1,351.00	60,659,900	
バルカー	10,800	2,120.00	22,896,000	
MUTOHホールディングス	1,300	1,571.00	2,042,300	
伊藤忠商事	898,200	3,484.00	3,129,328,800	
丸紅	1,266,100	984.10	1,245,969,010	
スクロール	18,200	892.00	16,234,400	
高島	1,700	1,700.00	2,890,000	
ヨンドシーホールディングス	12,000	1,888.00	22,656,000	
三陽商会	6,600	818.00	5,398,800	
長瀬産業	72,200	1,690.00	122,018,000	
ナイガイ	4,200	337.00	1,415,400	
蝶理	8,200	1,773.00	14,538,600	
豊田通商	128,800	4,995.00	643,356,000	
オンワードホールディングス	76,800	296.00	22,732,800	
三共生興	19,700	512.00	10,086,400	
兼松	51,300	1,457.00	74,744,100	
美津濃	13,000	2,287.00	29,731,000	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,412.00	2,541,600	
ルックホールディングス	4,300	1,252.00	5,383,600	
三井物産	1,042,300	2,506.00	2,612,003,800	
日本紙パルプ商事	6,800	3,595.00	24,446,000	
東京エレクトロン	76,400	48,000.00	3,667,200,000	
カメイ	16,600	1,125.00	18,675,000	
東都水産	1,500	4,375.00	6,562,500	
OUGホールディングス	1,900	2,840.00	5,396,000	
スターゼン	9,200	2,248.00	20,681,600	
セイコーホールディングス	18,300	2,056.00	37,624,800	
山善	50,100	998.00	49,999,800	
椿本興業	1,800	3,440.00	6,192,000	
住友商事	810,300	1,556.00	1,260,826,800	
日本ユニシス	44,600	3,465.00	154,539,000	
内田洋行	5,100	4,800.00	24,480,000	
三菱商事	781,500	2,993.50	2,339,420,250	

第一実業	5,800	4,230.00	24,534,000	
キヤノンマーケティングジャパン	31,900	2,551.00	81,376,900	
西華産業	6,800	1,714.00	11,655,200	
佐藤商事	11,100	1,071.00	11,888,100	
菱洋エレクトロ	9,700	2,676.00	25,957,200	
東京産業	12,700	620.00	7,874,000	
ユアサ商事	13,200	3,000.00	39,600,000	
神鋼商事	2,800	2,496.00	6,988,800	
トルク	6,400	246.00	1,574,400	
阪和興業	25,600	3,535.00	90,496,000	
正栄食品工業	8,300	4,035.00	33,490,500	
カナデン	10,800	1,131.00	12,214,800	
菱電商事	9,400	1,651.00	15,519,400	
ニプロ	97,200	1,347.00	130,928,400	
フルサト工業	6,900	1,650.00	11,385,000	
岩谷産業	30,700	6,820.00	209,374,000	
ナイス	5,200	1,996.00	10,379,200	
ニチモウ	1,700	1,978.00	3,362,600	
極東貿易	3,200	1,707.00	5,462,400	
イワキ	16,900	737.00	12,455,300	
兼松エレクトロニクス	7,200	3,745.00	26,964,000	
三愛石油	31,800	1,251.00	39,781,800	
稲畑産業	30,700	1,673.00	51,361,100	
G S I クレオス	6,000	1,187.00	7,122,000	
明和産業	11,800	479.00	5,652,200	
クワザワホールディングス	4,800	597.00	2,865,600	
キムラタン	74,800	23.00	1,720,400	
ヤマエ久野	9,300	1,053.00	9,792,900	
ゴールドウイン	21,000	6,450.00	135,450,000	
ユニ・チャーム	276,700	4,137.00	1,144,707,900	
デサント	21,900	1,891.00	41,412,900	
キング	5,100	518.00	2,641,800	
ワキタ	25,300	1,098.00	27,779,400	
ヤマトインターナショナル	11,500	331.00	3,806,500	
東邦ホールディングス	41,200	1,891.00	77,909,200	
サンゲツ	34,700	1,594.00	55,311,800	
ミツウロコグループホールディングス	18,800	1,256.00	23,612,800	
シナネンホールディングス	4,800	3,035.00	14,568,000	
伊藤忠エネクス	29,000	1,076.00	31,204,000	
サンリオ	36,000	1,732.00	62,352,000	
サンワテクノス	8,300	1,260.00	10,458,000	
リョーサン	14,100	2,240.00	31,584,000	
新光商事	17,600	747.00	13,147,200	
トーヨー	6,000	1,700.00	10,200,000	
三信電気	7,200	2,070.00	14,904,000	
東陽テクニカ	13,600	1,098.00	14,932,800	
モスフードサービス	18,200	3,045.00	55,419,000	

加賀電子	11,500	2,470.00	28,405,000	
三益半導体工業	10,000	2,621.00	26,210,000	
都築電気	4,700	1,814.00	8,525,800	
ソーダニッカ	12,800	610.00	7,808,000	
立花エレテック	9,700	1,571.00	15,238,700	
木曽路	16,900	2,254.00	38,092,600	
S R S ホールディングス	16,300	823.00	13,414,900	
千趣会	23,500	400.00	9,400,000	
タカキュー	10,800	135.00	1,458,000	
リテールパートナーズ	15,500	1,161.00	17,995,500	
ケーヨー	24,000	716.00	17,184,000	
上新電機	15,100	2,777.00	41,932,700	
日本瓦斯	63,300	1,900.00	120,270,000	
ロイヤルホールディングス	22,400	1,917.00	42,940,800	
東天紅	800	999.00	799,200	
いなげや	14,300	1,539.00	22,007,700	
チョダ	13,400	884.00	11,845,600	
ライフコーポレーション	13,000	3,450.00	44,850,000	
リンガーハット	15,800	2,229.00	35,218,200	
M r M a x HD	17,400	627.00	10,909,800	
テンアライド	12,900	321.00	4,140,900	
A O K I ホールディングス	25,300	632.00	15,989,600	
オークワ	20,200	1,149.00	23,209,800	
コメリ	19,800	2,842.00	56,271,600	
青山商事	28,500	855.00	24,367,500	
しまむら	15,000	10,720.00	160,800,000	
はせがわ	5,800	290.00	1,682,000	
高島屋	93,400	1,215.00	113,481,000	
松屋	28,100	928.00	26,076,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	60,600	843.00	51,085,800	
近鉄百貨店	5,000	3,105.00	15,525,000	
丸井グループ	108,600	2,044.00	221,978,400	
クレディセゾン	75,000	1,276.00	95,700,000	
アクシアル リテイリング	10,800	4,085.00	44,118,000	
井筒屋	6,900	253.00	1,745,700	
イオン	494,100	3,006.00	1,485,264,600	
イズミ	26,000	4,290.00	111,540,000	
フォーバル	4,700	820.00	3,854,000	
平和堂	23,800	2,254.00	53,645,200	
フジ	15,600	2,081.00	32,463,600	
ヤオコー	14,500	6,660.00	96,570,000	
ゼビオホールディングス	15,400	896.00	13,798,400	
ケーズホールディングス	109,200	1,419.00	154,954,800	
P A L T A C	20,700	5,440.00	112,608,000	
三谷産業	17,100	404.00	6,908,400	
O l y m p i c グループ	6,600	768.00	5,068,800	
日産東京販売ホールディングス	15,600	243.00	3,790,800	

新生銀行	104,800	1,584.00	166,003,200	
あおぞら銀行	76,600	2,408.00	184,452,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,795,500	597.50	5,255,311,250	
りそなホールディングス	1,483,000	463.10	686,777,300	
三井住友トラスト・ホールディングス	243,300	3,782.00	920,160,600	
三井住友フィナンシャルグループ	889,900	3,926.00	3,493,747,400	
千葉銀行	428,700	697.00	298,803,900	
群馬銀行	264,700	367.00	97,144,900	
武蔵野銀行	19,100	1,652.00	31,553,200	
千葉興業銀行	33,300	272.00	9,057,600	
筑波銀行	53,100	175.00	9,292,500	
七十七銀行	40,500	1,405.00	56,902,500	
青森銀行	9,900	2,355.00	23,314,500	
秋田銀行	7,900	1,400.00	11,060,000	
山形銀行	14,200	1,039.00	14,753,800	
岩手銀行	8,300	2,107.00	17,488,100	
東邦銀行	115,000	215.00	24,725,000	
東北銀行	6,500	1,047.00	6,805,500	
みちのく銀行	8,200	1,111.00	9,110,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	115,800	1,936.00	224,188,800	
静岡銀行	313,100	845.00	264,569,500	
十六銀行	16,100	2,056.00	33,101,600	
スルガ銀行	112,300	408.00	45,818,400	
八十二銀行	289,400	388.00	112,287,200	
山梨中央銀行	14,900	844.00	12,575,600	
大垣共立銀行	25,500	1,999.00	50,974,500	
福井銀行	11,000	1,723.00	18,953,000	
北國銀行	12,200	2,453.00	29,926,600	
清水銀行	5,500	1,590.00	8,745,000	
富山銀行	2,200	2,777.00	6,109,400	
滋賀銀行	25,600	2,133.00	54,604,800	
南都銀行	18,600	1,845.00	34,317,000	
百五銀行	116,400	325.00	37,830,000	
京都銀行	46,000	5,880.00	270,480,000	
紀陽銀行	45,600	1,458.00	66,484,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	85,400	950.00	81,130,000	
山陰合同銀行	81,300	510.00	41,463,000	
中国銀行	110,700	886.00	98,080,200	
鳥取銀行	4,300	1,130.00	4,859,000	
伊予銀行	170,600	621.00	105,942,600	
百十四銀行	13,500	1,542.00	20,817,000	
四国銀行	18,300	718.00	13,139,400	
阿波銀行	19,600	2,248.00	44,060,800	
大分銀行	7,400	1,889.00	13,978,600	
宮崎銀行	8,000	2,256.00	18,048,000	
佐賀銀行	7,400	1,381.00	10,219,400	
沖縄銀行	11,700	2,694.00	31,519,800	

琉球銀行	28,200	719.00	20,275,800	
セブン銀行	429,000	234.00	100,386,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,747,100	1,618.50	2,827,681,350	
高知銀行	4,500	825.00	3,712,500	
山口フィナンシャルグループ	160,500	660.00	105,930,000	
芙蓉総合リース	13,500	7,510.00	101,385,000	
みずほリース	19,800	3,280.00	64,944,000	
東京センチュリー	29,900	6,570.00	196,443,000	
SBIホールディングス	157,700	2,947.00	464,741,900	
日本証券金融	54,600	827.00	45,154,200	
アイフル	215,100	311.00	66,896,100	
日本アジア投資	11,000	244.00	2,684,000	
長野銀行	4,300	1,190.00	5,117,000	
名古屋銀行	10,300	2,725.00	28,067,500	
北洋銀行	194,100	284.00	55,124,400	
愛知銀行	4,300	2,879.00	12,379,700	
中京銀行	4,700	1,688.00	7,933,600	
大光銀行	3,900	1,428.00	5,569,200	
愛媛銀行	18,300	919.00	16,817,700	
トマト銀行	5,000	1,035.00	5,175,000	
京葉銀行	55,000	423.00	23,265,000	
栃木銀行	61,500	179.00	11,008,500	
北日本銀行	4,200	1,814.00	7,618,800	
東和銀行	22,400	624.00	13,977,600	
福島銀行	14,400	230.00	3,312,000	
大東銀行	6,500	619.00	4,023,500	
リコーリース	10,100	3,435.00	34,693,500	
イオンフィナンシャルサービス	78,500	1,239.00	97,261,500	
アコム	258,600	459.00	118,697,400	
ジャックス	14,100	2,147.00	30,272,700	
オリエントコーポレーション	347,300	140.00	48,622,000	
オリックス	780,600	1,778.00	1,387,906,800	
三菱HCキャピタル	443,800	630.00	279,594,000	
ジャフコグループ	19,700	7,600.00	149,720,000	
九州リースサービス	7,200	673.00	4,845,600	
トモニホールディングス	99,400	302.00	30,018,800	
大和証券グループ本社	963,100	611.40	588,839,340	
野村ホールディングス	1,962,900	573.60	1,125,919,440	
岡三証券グループ	109,600	462.00	50,635,200	
丸三証券	38,300	658.00	25,201,400	
東洋証券	41,800	169.00	7,064,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	136,700	411.00	56,183,700	
光世証券	3,200	690.00	2,208,000	
水戸証券	34,100	304.00	10,366,400	
いちよし証券	25,400	618.00	15,697,200	
松井証券	63,100	854.00	53,887,400	

SOMPOホールディングス	226,900	4,177.00	947,761,300	
日本取引所グループ	347,400	2,494.00	866,415,600	
マネックスグループ	114,900	853.00	98,009,700	
極東証券	17,200	819.00	14,086,800	
岩井コスモホールディングス	13,200	1,724.00	22,756,800	
藍澤証券	23,200	1,036.00	24,035,200	
フィデアホールディングス	124,900	128.00	15,987,200	
池田泉州ホールディングス	147,500	173.00	25,517,500	
アニコムホールディングス	36,200	1,024.00	37,068,800	
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	312,500	3,243.00	1,013,437,500	
マネーパートナーズグループ	14,000	256.00	3,584,000	
スパークス・グループ	58,900	283.00	16,668,700	
小林洋行	3,200	275.00	880,000	
第一生命ホールディングス	679,200	2,009.00	1,364,512,800	
東京海上ホールディングス	423,300	5,351.00	2,265,078,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	712.00	4,343,200	
イー・ギャランティ	14,800	2,029.00	30,029,200	
アサックス	7,200	690.00	4,968,000	
NECキャピタルソリューション	5,300	2,034.00	10,780,200	
T&Dホールディングス	384,000	1,357.00	521,088,000	
アドバンスクリエイト	5,100	1,028.00	5,242,800	
三井不動産	585,800	2,448.00	1,434,038,400	
三菱地所	844,400	1,828.00	1,543,563,200	
平和不動産	22,200	3,955.00	87,801,000	
東京建物	126,700	1,690.00	214,123,000	
ダイビル	33,300	1,276.00	42,490,800	
京阪神ビルディング	22,300	1,475.00	32,892,500	
住友不動産	289,000	3,814.00	1,102,246,000	
太平洋興発	5,700	677.00	3,858,900	
テーオーシー	25,400	716.00	18,186,400	
東京楽天地	2,300	4,220.00	9,706,000	
レオパレス21	105,700	150.00	15,855,000	
スターツコーポレーション	15,200	2,758.00	41,921,600	
フジ住宅	14,900	646.00	9,625,400	
空港施設	13,700	618.00	8,466,600	
明和地所	6,000	664.00	3,984,000	
ゴールドクレスト	11,400	1,597.00	18,205,800	
リログループ	68,100	2,133.00	145,257,300	
エスリード	5,100	1,615.00	8,236,500	
日神グループホールディングス	19,200	487.00	9,350,400	
日本エスコン	23,400	748.00	17,503,200	
タカラレーベン	53,800	361.00	19,421,800	
AVANTIA	7,300	894.00	6,526,200	
イオンモール	64,300	1,732.00	111,367,600	
毎日コムネット	3,900	774.00	3,018,600	
ファースト住建	5,600	1,228.00	6,876,800	

ランド	684,600	12.00	8,215,200	
カチタス	31,900	3,230.00	103,037,000	
東祥	7,900	1,635.00	12,916,500	
トーセイ	17,800	1,086.00	19,330,800	
穴吹興産	2,800	2,113.00	5,916,400	
サンフロンティア不動産	15,500	1,000.00	15,500,000	
エフ・ジェー・ネクスト	12,700	1,019.00	12,941,300	
インテリックス	2,800	865.00	2,422,000	
ランドビジネス	4,800	388.00	1,862,400	
サンネクスタグループ	4,200	990.00	4,158,000	
グランディハウス	8,900	450.00	4,005,000	
東武鉄道	135,800	2,891.00	392,597,800	
相鉄ホールディングス	44,800	2,225.00	99,680,000	
東急	328,700	1,413.00	464,453,100	
京浜急行電鉄	167,400	1,408.00	235,699,200	
小田急電鉄	208,700	2,881.00	601,264,700	
京王電鉄	72,800	6,910.00	503,048,000	
京成電鉄	97,600	3,220.00	314,272,000	
富士急行	17,700	5,030.00	89,031,000	
新京成電鉄	3,200	2,162.00	6,918,400	
東日本旅客鉄道	229,400	7,513.00	1,723,482,200	
西日本旅客鉄道	116,200	6,082.00	706,728,400	
東海旅客鉄道	108,300	16,020.00	1,734,966,000	
西武ホールディングス	157,200	1,148.00	180,465,600	
鴻池運輸	21,000	1,163.00	24,423,000	
西日本鉄道	36,100	2,787.00	100,610,700	
ハマキョウレックス	10,000	3,160.00	31,600,000	
サカイ引越センター	6,000	5,480.00	32,880,000	
近鉄グループホールディングス	123,200	3,940.00	485,408,000	
阪急阪神ホールディングス	164,500	3,440.00	565,880,000	
南海電気鉄道	58,700	2,344.00	137,592,800	
京阪ホールディングス	55,100	3,770.00	207,727,000	
神戸電鉄	3,100	3,610.00	11,191,000	
名古屋鉄道	101,500	2,525.00	256,287,500	
山陽電気鉄道	9,000	1,870.00	16,830,000	
アルプス物流	8,500	950.00	8,075,000	
トランコム	3,800	9,020.00	34,276,000	
日本通運	42,900	8,730.00	374,517,000	
ヤマトホールディングス	173,000	3,060.00	529,380,000	
山九	31,700	4,965.00	157,390,500	
日新	9,800	1,474.00	14,445,200	
丸運	8,300	276.00	2,290,800	
丸全昭和運輸	10,000	3,245.00	32,450,000	
センコーグループホールディングス	68,400	1,024.00	70,041,600	
トナミホールディングス	2,500	5,300.00	13,250,000	
ニッコンホールディングス	41,500	2,329.00	96,653,500	
日本石油輸送	900	2,642.00	2,377,800	

福山通運	15,800	4,210.00	66,518,000	
セイノーホールディングス	92,500	1,526.00	141,155,000	
エスライン	3,200	915.00	2,928,000	
神奈川中央交通	2,600	3,605.00	9,373,000	
日立物流	27,300	3,495.00	95,413,500	
丸和運輸機関	26,000	1,682.00	43,732,000	
C & F ロジホールディングス	12,600	1,651.00	20,802,600	
日本郵船	103,200	4,470.00	461,304,000	
商船三井	73,200	4,715.00	345,138,000	
川崎汽船	38,000	3,120.00	118,560,000	
N S ユナイテッド海運	5,900	2,339.00	13,800,100	
明治海運	13,500	479.00	6,466,500	
飯野海運	57,800	513.00	29,651,400	
共栄タンカー	2,500	947.00	2,367,500	
九州旅客鉄道	95,300	2,473.00	235,676,900	
S G ホールディングス	233,400	2,433.00	567,862,200	
日本航空	300,900	2,291.00	689,361,900	
A N A ホールディングス	333,200	2,518.00	838,997,600	
パスコ	2,500	1,381.00	3,452,500	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	2,700	2,671.00	7,211,700	
シルバーライフ	2,600	2,563.00	6,663,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	2,215.00	2,436,500	
一家ダイニングプロジェクト	1,100	554.00	609,400	
G e n k y D r u g S t o r e s	5,700	3,385.00	19,294,500	
コア商事ホールディングス	7,200	807.00	5,810,400	
国際紙パルプ商事	28,000	244.00	6,832,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,500	1,188.00	2,970,000	
ブックオフグループホールディングス	7,400	1,000.00	7,400,000	
ギフト	1,100	2,116.00	2,327,600	
三菱倉庫	42,600	3,250.00	138,450,000	
三井倉庫ホールディングス	13,200	2,281.00	30,109,200	
住友倉庫	44,600	1,458.00	65,026,800	
澁澤倉庫	6,900	2,134.00	14,724,600	
ヤマタネ	5,800	1,478.00	8,572,400	
東陽倉庫	18,300	322.00	5,892,600	
乾汽船	8,400	1,100.00	9,240,000	
日本トランスシティ	27,800	525.00	14,595,000	
ケイヒン	1,800	1,396.00	2,512,800	
中央倉庫	7,100	1,067.00	7,575,700	
川西倉庫	2,400	1,160.00	2,784,000	
安田倉庫	10,800	942.00	10,173,600	
ファイズホールディングス	2,300	917.00	2,109,100	
東洋埠頭	3,200	1,489.00	4,764,800	
宇徳	9,300	497.00	4,622,100	
上組	68,800	2,191.00	150,740,800	
サンリツ	2,500	710.00	1,775,000	

キムラユニティー	3,900	1,284.00	5,007,600	
キューソー流通システム	3,100	1,624.00	5,034,400	
近鉄エクスプレス	23,500	2,674.00	62,839,000	
東海運	8,600	351.00	3,018,600	
エーアイティー	7,900	1,043.00	8,239,700	
内外トランスライン	4,400	1,845.00	8,118,000	
ショーエイコーポレーション	2,700	985.00	2,659,500	
日本コンセプト	4,200	1,515.00	6,363,000	
TBSホールディングス	84,900	2,114.00	179,478,600	
日本テレビホールディングス	106,500	1,425.00	151,762,500	
朝日放送グループホールディングス	13,600	695.00	9,452,000	
テレビ朝日ホールディングス	39,600	1,947.00	77,101,200	
スカパーJ SATホールディングス	84,400	446.00	37,642,400	
テレビ東京ホールディングス	9,400	2,244.00	21,093,600	
日本BS放送	4,400	1,091.00	4,800,400	
ビジョン	15,600	997.00	15,553,200	
スマートバリュー	3,300	860.00	2,838,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	12,200	2,033.00	24,802,600	
ワイヤレスゲート	5,300	480.00	2,544,000	
コネクシオ	7,600	1,474.00	11,202,400	
日本通信	111,800	218.00	24,372,400	
クロップス	2,500	881.00	2,202,500	
日本電信電話	1,496,300	2,866.00	4,288,395,800	
KDDI	1,025,900	3,418.00	3,506,526,200	
ソフトバンク	1,162,800	1,436.00	1,669,780,800	
光通信	15,100	21,790.00	329,029,000	
エムティーアイ	12,500	756.00	9,450,000	
GMOインターネット	45,800	3,010.00	137,858,000	
ファイバーゲート	4,200	1,507.00	6,329,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	402.00	1,246,200	
KADOKAWA	33,100	3,760.00	124,456,000	
学研ホールディングス	17,200	1,392.00	23,942,400	
ゼンリン	23,300	1,139.00	26,538,700	
昭文社ホールディングス	4,800	472.00	2,265,600	
インプレスホールディングス	10,900	235.00	2,561,500	
東京電力ホールディングス	1,105,300	343.00	379,117,900	
中部電力	398,800	1,367.50	545,359,000	
関西電力	494,000	1,086.00	536,484,000	
中国電力	188,200	1,241.00	233,556,200	
北陸電力	119,200	673.00	80,221,600	
東北電力	305,200	972.00	296,654,400	
四国電力	108,300	810.00	87,723,000	
九州電力	287,800	1,013.00	291,541,400	
北海道電力	121,800	536.00	65,284,800	
沖縄電力	25,500	1,466.00	37,383,000	

電源開発	103,600	1,680.00	174,048,000	
エフオン	7,900	1,024.00	8,089,600	
イーレックス	19,000	1,906.00	36,214,000	
レノバ	22,100	3,125.00	69,062,500	
東京瓦斯	250,600	2,332.50	584,524,500	
大阪瓦斯	236,100	2,175.00	513,517,500	
東邦瓦斯	64,100	6,320.00	405,112,000	
北海道瓦斯	7,300	1,553.00	11,336,900	
広島ガス	27,800	375.00	10,425,000	
西部ガスホールディングス	14,800	2,505.00	37,074,000	
静岡ガス	37,200	982.00	36,530,400	
メタウォーター	14,900	2,069.00	30,828,100	
アイネット	6,600	1,460.00	9,636,000	
松竹	8,400	12,230.00	102,732,000	
東宝	75,400	4,270.00	321,958,000	
エイチ・アイ・エス	19,100	2,218.00	42,363,800	
東映	4,200	24,730.00	103,866,000	
ラックランド	3,600	2,489.00	8,960,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	340,800	1,701.00	579,700,800	
共立メンテナンス	20,700	3,450.00	71,415,000	
イチネンホールディングス	13,200	1,262.00	16,658,400	
建設技術研究所	8,100	2,497.00	20,225,700	
スペース	8,400	887.00	7,450,800	
長 大	5,000	1,737.00	8,685,000	
アインホールディングス	18,500	6,370.00	117,845,000	
燦ホールディングス	5,200	1,057.00	5,496,400	
ピー・シー・エー	1,800	4,400.00	7,920,000	
スバル興業	900	8,090.00	7,281,000	
東京テアトル	5,100	1,242.00	6,334,200	
タナベ経営	2,500	1,370.00	3,425,000	
ビジネスブレイン太田昭和	4,300	1,802.00	7,748,600	
ナガワ	4,100	8,170.00	33,497,000	
東京都競馬	8,100	5,300.00	42,930,000	
常磐興産	5,200	1,383.00	7,191,600	
カナモト	22,200	2,690.00	59,718,000	
D T S	26,500	2,551.00	67,601,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,600	5,920.00	323,232,000	
シーイーシー	13,500	1,364.00	18,414,000	
カプコン	109,600	3,445.00	377,572,000	
西尾レントオール	11,400	3,175.00	36,195,000	
アイ・エス・ビー	5,800	1,339.00	7,766,200	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	77,900	25.00	1,947,500	
日本空港ビルデング	44,600	4,695.00	209,397,000	
トランス・コスモス	12,000	3,140.00	37,680,000	
乃村工藝社	53,400	806.00	43,040,400	

ジャステック	8,200	1,280.00	10,496,000	
S C S K	29,500	6,040.00	178,180,000	
藤田観光	4,900	1,908.00	9,349,200	
K N T－C Tホールディングス	6,600	1,107.00	7,306,200	
日本管財	13,500	2,290.00	30,915,000	
トーカイ	12,300	2,439.00	29,999,700	
白洋舎	1,000	2,330.00	2,330,000	
セコム	122,700	9,212.00	1,130,312,400	
日本システムウェア	4,200	2,242.00	9,416,400	
セントラル警備保障	6,000	2,934.00	17,604,000	
アイネス	12,500	1,414.00	17,675,000	
丹青社	23,400	835.00	19,539,000	
メイテック	15,200	5,840.00	88,768,000	
T K C	21,700	3,420.00	74,214,000	
富士ソフト	13,600	5,370.00	73,032,000	
応用地質	14,600	1,324.00	19,330,400	
船井総研ホールディングス	25,500	2,364.00	60,282,000	
N S D	41,300	1,788.00	73,844,400	
進学会ホールディングス	5,500	412.00	2,266,000	
丸紅建材リース	900	1,855.00	1,669,500	
オオバ	8,600	845.00	7,267,000	
コナミホールディングス	46,500	6,360.00	295,740,000	
いであ	2,800	1,817.00	5,087,600	
学究社	3,800	1,312.00	4,985,600	
ベネッセホールディングス	45,700	2,427.00	110,913,900	
イオンディライト	15,300	3,375.00	51,637,500	
ナック	6,000	922.00	5,532,000	
福井コンピュータホールディングス	5,800	4,115.00	23,867,000	
ダイセキ	20,900	4,035.00	84,331,500	
ステップ	4,700	1,597.00	7,505,900	
日鉄物産	9,200	4,500.00	41,400,000	
泉州電業	3,600	3,295.00	11,862,000	
元気寿司	3,500	2,436.00	8,526,000	
トラスコ中山	29,400	2,974.00	87,435,600	
ヤマダホールディングス	430,200	549.00	236,179,800	
オートバックスセブン	47,600	1,496.00	71,209,600	
モリト	9,800	608.00	5,958,400	
アークランドサカモト	20,100	1,533.00	30,813,300	
ニトリホールディングス	51,000	19,300.00	984,300,000	
グルメ杵屋	9,400	940.00	8,836,000	
愛眼	8,300	227.00	1,884,100	
ケーユーホールディングス	6,600	957.00	6,316,200	
吉野家ホールディングス	42,100	2,074.00	87,315,400	
加藤産業	18,500	3,270.00	60,495,000	
北恵	3,500	927.00	3,244,500	
イノテック	7,300	1,328.00	9,694,400	
イエローハット	24,100	1,969.00	47,452,900	

松屋フーズホールディングス	6,100	3,435.00	20,953,500	
J B C Cホールディングス	8,600	1,385.00	11,911,000	
J Kホールディングス	11,600	815.00	9,454,000	
サガミホールディングス	17,400	1,029.00	17,904,600	
日伝	10,700	2,019.00	21,603,300	
関西スーパーマーケット	9,600	1,022.00	9,811,200	
ミロク情報サービス	12,700	1,827.00	23,202,900	
北沢産業	8,000	250.00	2,000,000	
杉本商事	6,600	2,216.00	14,625,600	
因幡電機産業	34,200	2,560.00	87,552,000	
王将フードサービス	8,500	5,640.00	47,940,000	
プレナス	14,500	2,042.00	29,609,000	
ミニストップ	9,600	1,448.00	13,900,800	
アークス	24,300	2,390.00	58,077,000	
バローホールディングス	26,300	2,290.00	60,227,000	
東テク	4,300	2,936.00	12,624,800	
ミスミグループ本社	160,900	3,420.00	550,278,000	
藤久	2,800	786.00	2,200,800	
アルテック	9,600	317.00	3,043,200	
ベルク	6,400	5,810.00	37,184,000	
大 庄	6,900	985.00	6,796,500	
タキヒヨー	4,300	1,838.00	7,903,400	
ファーストリテイリング	17,200	87,040.00	1,497,088,000	
ソフトバンクグループ	1,015,000	9,508.00	9,650,620,000	
蔵王産業	2,200	1,429.00	3,143,800	
スズケン	54,300	4,100.00	222,630,000	
サンドラッグ	48,300	3,860.00	186,438,000	
サックスパー ホールディングス	10,900	597.00	6,507,300	
ジェコス	9,100	915.00	8,326,500	
ヤマザワ	2,700	1,692.00	4,568,400	
やまや	2,600	2,313.00	6,013,800	
グローセル	14,100	421.00	5,936,100	
ベルーナ	27,500	1,188.00	32,670,000	
合計	138,389,300		341,151,143,760	

(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)

2021年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	8,553,292,532
コール・ローン	1,103,398,881
株式	487,946,726,780
投資信託受益証券	935,053,184
投資証券	10,295,661,425
派生商品評価勘定	299,941,458
未収入金	28,913,564
未収配当金	565,086,864
差入委託証拠金	6,044,506,909
流動資産合計	515,772,581,597
資産合計	515,772,581,597
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,715,576
未払解約金	876,873,000
流動負債合計	880,588,576
負債合計	880,588,576
純資産の部	
元本等	
元本	99,287,308,113
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	415,604,684,908
元本等合計	514,891,993,021
純資産合計	514,891,993,021
負債純資産合計	515,772,581,597

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月12日 至 2021年5月11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本となる重要な事項	<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	2021年5月11日現在
<p>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</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p> <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p> <p>D I A M外国株式パッシブ・ファンド</p> <p>M I T O ラップ型ファンド（安定型）</p>	<p>94, 213, 969, 059円</p> <p>26, 322, 248, 146円</p> <p>21, 248, 909, 092円</p> <p></p> <p>3, 613, 416, 011円</p> <p>2, 620, 763円</p>

MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,094,397円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	8,486,373円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	26,195,637円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	16,734,584円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	12,019,403円
たわらノーロード 先進国株式	21,458,622,304円
たわらノーロード 先進国株式＜ラップ向け＞	251,918,685円
たわらノーロード 先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,397,939,454円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	432,467,782円
たわらノーロード バランス（堅実型）	47,897,000円
たわらノーロード バランス（標準型）	388,422,713円
たわらノーロード バランス（積極型）	463,035,643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）	1,191,191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）	130,404,574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）	348,804,596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）	237,222,596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）	368,048,929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）	611,989円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,645,795円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,087,212円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	4,867,632円
たわらノーロード 全世界株式	103,463,164円
DIAM外国株式インデックスファンド＜DC年金＞	47,759,122,978円
One DC 先進国株式インデックスファンド	847,120,185円
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞1安定型	160,700,294円
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞2安定・成長型	897,060,174円
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞3成長型	1,073,429,586円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	104,742,275円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	326,855,114円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	279,977,640円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	21,408,640円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	668,457,892円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	160,050,732円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	188,785,974円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	171,749,111円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	287,479,000円
投資のソムリエ	3,975,161,749円
クルーズコントロール	134,089,435円
投資のソムリエ＜DC年金＞	214,778,862円
DIAM 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	185,189,706円
4資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	113,492,231円
DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）	1,042,702円
DIAMコア資産設計ファンド（積極型）	2,591,459円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	82,609,825円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	907,717,249円
ワールドアセットバランス（基本コース）	283,293,240円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	929,334,292円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	17,322,213円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	8,180,798円

リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	809,655円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	25,288,296円
4資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	35,061,546円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	545,912,824円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	161,211,862円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	9,787,035円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	4,943,949円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	5,102,497円
4資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	4,092,241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）	527,338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）	557,257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）	8,768,590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）	245,460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）	440,791,635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）	61,561,913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）	1,345,546,830円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,219,970,501円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	901,083,137円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	88,709,016円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	10,252,518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）	819,550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）	38,658,766円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	65,292,618円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	4,612,224円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	28,199,333円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,298,264円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	803,559円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	8,472,497円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	34,950,021円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	253,432,642円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	362,583,447円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,182,902,943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）	297,445,485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）	62,925,024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）	411,622,187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）	18,320,152円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	4,313,984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）	173,995,257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）	14,084,653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）	55, 927, 461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）	89, 206, 228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）	177, 254, 488円
計	99, 287, 308, 113円
2. 受益権の総数	99, 287, 308, 113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 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （2）デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。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	2021年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	24,110,712,268
投資信託受益証券	49,808,866
投資証券	986,158,093
合計	25,146,679,227

(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 (2021年2月16日から2021年5月11日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月11日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	14,919,251	—	15,014,724	△95,473
イギリス・ポンド	12,669,767	—	12,767,807	△98,040
ユーロ	2,249,484	—	2,246,917	2,567
買建	1,891,141,341	—	1,891,486,571	345,230
アメリカ・ドル	1,429,265,838	—	1,429,597,866	332,028
イギリス・ポンド	87,372,600	—	87,374,360	1,760
オーストラリア・ドル	51,779,891	—	51,764,960	△14,931
カナダ・ドル	75,298,900	—	75,321,155	22,255
ユーロ	247,424,112	—	247,428,230	4,118
合計	1,906,060,592	—	1,906,501,295	249,757

(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	2021年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	16,960,946,699	—	17,256,922,824	295,976,125
合計	16,960,946,699	—	17,256,922,824	295,976,125

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.1859円 (51,859円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年5月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	37,204	3,190.490	118,698,989.960	
	ABBOTT LABORATORIES	154,600	118.940	18,388,124.000	
	AES CORP	58,916	25.730	1,515,908.680	
	ABIOMED INC	3,987	282.720	1,127,204.640	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,780	146.170	11,369,102.600	
	ADVANCED MICRO DEVICES	105,090	75.990	7,985,789.100	
	ADOBE INC	41,923	479.380	20,097,047.740	
	CHUBB LTD	39,379	173.830	6,845,251.570	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,256	293.530	5,652,213.680	
	ALLEGHANY CORP	1,278	723.360	924,454.080	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	70.030	423,821.560	
	ALLSTATE CORP	26,594	134.490	3,576,627.060	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	61,069	230.940	14,103,274.860	
AMGEN INC	50,861	252.620	12,848,505.820	
HESS CORP	24,776	82.560	2,045,506.560	
AMERICAN EXPRESS CO	59,733	158.680	9,478,432.440	
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,862	87.560	3,840,556.720	
AFLAC INC	57,954	56.530	3,276,139.620	
AMERICAN INTL GROUP	75,656	51.920	3,928,059.520	
AMERCO	929	632.000	587,128.000	
ANALOG DEVICES	32,544	150.790	4,907,309.760	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,326	171.810	3,320,400.060	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	63,332	65.830	4,169,145.560	
VALERO ENERGY CORP	37,400	79.640	2,978,536.000	
ANSYS INC	7,643	323.170	2,469,988.310	
APPLE INC	1,482,992	126.850	188,117,535.200	
APPLIED MATERIALS INC	79,849	124.690	9,956,371.810	
ALBEMARLE CORP	9,546	159.480	1,522,396.080	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,789	67.630	3,299,600.070	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	87.760	814,237.280	
AMEREN CORP	22,273	85.840	1,911,914.320	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	117.320	780,295.320	
AUTOLIV INC	7,570	102.010	772,215.700	
AUTODESK INC	19,237	276.050	5,310,373.850	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,447	194.400	7,279,696.800	
AUTOZONE INC	2,054	1,519.620	3,121,299.480	
AVERY DENNISON CORP	7,627	221.580	1,689,990.660	
BALL CORP	28,607	89.870	2,570,911.090	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	119,534	292.330	34,943,374.220	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	70,629	52.270	3,691,777.830	
BAXTER INTERNATIONAL INC	44,605	86.490	3,857,886.450	
BECTON DICKINSON & CO	25,351	246.630	6,252,317.130	
AMETEK INC	19,940	137.090	2,733,574.600	
VERIZON COMM INC	360,099	59.520	21,433,092.480	
WR BERKLEY CORP	12,511	80.880	1,011,889.680	
BEST BUY CO INC	19,478	125.790	2,450,137.620	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,002	603.650	1,208,507.300	
YUM! BRANDS INC	25,239	121.920	3,077,138.880	
FIRSTENERGY CORP	47,800	37.650	1,799,670.000	
BOEING CO	46,813	232.930	10,904,152.090	
ROBERT HALF INTL INC	8,955	90.800	813,114.000	

BORGWARNER INC	21,938	52.930	1,161,178.340	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,951	43.250	5,404,130.750	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	101.730	1,192,173.870	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,579	169.020	1,619,042.580	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,130	1,244.550	2,650,891.500	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	197,722	64.700	12,792,613.400	
ONEOK INC	39,284	53.960	2,119,764.640	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,186	127.830	790,756.380	
UNITED RENTALS INC	6,451	348.140	2,245,851.140	
SEMPRA ENERGY	25,257	139.020	3,511,228.140	
FEDEX CORP	21,801	309.270	6,742,395.270	
VERISIGN INC	9,090	221.890	2,016,980.100	
AMPHENOL CORP	52,503	67.060	3,520,851.180	
BROWN-FORMAN CORP	25,320	77.810	1,970,149.200	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	5.960	578,930.560	
CSX CORP	66,677	103.160	6,878,399.320	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.700	556,063.200	
CAMPBELL SOUP CO	16,623	50.150	833,643.450	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	89.990	1,767,493.590	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,843	239.190	3,550,297.170	
CARDINAL HEALTH INC	25,949	58.330	1,513,605.170	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	64,967	26.270	1,706,683.090	
CATERPILLAR INC	47,359	242.610	11,489,766.990	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	119.850	1,182,320.250	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	119.290	1,184,907.570	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	80,424	14.290	1,149,258.960	
CERNER CORP	27,258	77.350	2,108,406.300	
JPMORGAN CHASE & CO	265,580	161.220	42,816,807.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,977	89.390	1,964,524.030	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	120.700	1,553,650.400	
CINTAS CORP	7,790	360.740	2,810,164.600	
CISCO SYSTEMS INC	368,365	53.160	19,582,283.400	
CLOROX COMPANY	11,142	187.990	2,094,584.580	
COCA-COLA CO/THE	355,908	54.910	19,542,908.280	
COPART INC	18,628	123.110	2,293,293.080	
COGNEX CORP	14,100	76.360	1,076,676.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,780	83.340	5,898,805.200	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	24,297	140.660	3,417,616.020	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	268.740	1,398,254.220	
NRG ENERGY, INC.	21,039	35.460	746,042.940	

COMCAST CORP-CL A	398,143	57.510	22,897,203.930	
CONAGRA BRANDS INC	43,383	38.250	1,659,399.750	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,844	79.850	2,383,043.400	
CMS ENERGY CORP	25,936	64.910	1,683,505.760	
COOPER COS INC	4,682	401.820	1,881,321.240	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	59.560	983,514.280	
CORNING INC	64,261	45.240	2,907,167.640	
SEALED AIR CORP	13,870	56.820	788,093.400	
HEICO CORP-CL A	6,236	129.490	807,499.640	
CUMMINS INC	13,193	270.740	3,571,872.820	
DR HORTON INC	30,677	104.450	3,204,212.650	
DANAHER CORP	55,754	259.030	14,441,958.620	
MOODY'S CORP	14,751	333.620	4,921,228.620	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,276	74.010	3,350,876.760	
TARGET CORP	43,728	214.030	9,359,103.840	
DEERE & CO	25,963	391.400	10,161,918.200	
MORGAN STANLEY	122,733	86.470	10,612,722.510	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	112.050	2,144,188.800	
COSTAR GROUP INC	3,463	839.720	2,907,950.360	
THE WALT DISNEY CO	158,055	184.300	29,129,536.500	
DOLLAR TREE INC	19,806	116.040	2,298,288.240	
DOVER CORP	12,652	153.450	1,941,449.400	
OMNICOM GROUP	19,138	84.800	1,622,902.400	
DTE ENERGY CO	17,152	144.150	2,472,460.800	
DUKE ENERGY CORP	64,242	103.740	6,664,465.080	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,636	140.690	1,637,068.840	
EBAY INC	58,336	61.440	3,584,163.840	
BANK OF AMERICA CORP	678,468	42.050	28,529,579.400	
CITIGROUP INC	181,369	75.130	13,626,252.970	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,705	124.880	1,336,840.400	
EATON CORP PLC	33,574	147.420	4,949,479.080	
CADENCE DESIGN SYS INC	24,634	124.140	3,058,064.760	
DISH NETWORK CORP	21,420	46.460	995,173.200	
ECOLAB INC	22,306	224.960	5,017,957.760	
PERKINELMER INC	9,755	140.000	1,365,700.000	
ELECTRONIC ARTS INC	25,600	140.650	3,600,640.000	
SALESFORCE.COM INC	79,504	213.890	17,005,110.560	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	208.630	467,957.090	
EMERSON ELECTRIC CO	51,889	95.380	4,949,172.820	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	103.510	1,190,675.530	
ENTERGY CORP	17,338	109.110	1,891,749.180	
EOG RESOURCES INC	51,692	84.550	4,370,558.600	
EQUIFAX INC	10,182	239.170	2,435,228.940	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,758	298.390	5,895,589.620	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,073	120.050	1,689,463.650	
EXXON MOBIL CORP	369,665	62.580	23,133,635.700	

FMC CORP	11,416	118.360	1,351,197.760	
NEXTERA ENERGY INC	170,795	74.800	12,775,466.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	335.110	1,087,767.060	
FAIR ISAAC CORP	2,482	492.900	1,223,377.800	
ASSURANT INC	5,523	159.960	883,459.080	
FASTENAL CO	50,482	53.750	2,713,407.500	
FIFTH THIRD BANCORP	62,822	42.240	2,653,601.280	
M&T BANK CORP	11,357	162.870	1,849,714.590	
FISERV INC	49,995	116.150	5,806,919.250	
FORD MOTOR CO	342,821	11.710	4,014,433.910	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	34.680	926,441.520	
FREEPORT-MCMORAN INC	126,846	42.740	5,421,398.040	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	150.790	2,702,458.380	
DENTSPLY SIRONA INC	19,366	69.120	1,338,577.920	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,623	194.600	4,013,235.800	
GENERAL MILLS INC	53,955	63.830	3,443,947.650	
GENUINE PARTS CO	12,867	133.600	1,719,031.200	
GILEAD SCIENCES INC	109,962	67.480	7,420,235.760	
GARTNER INC	7,895	231.160	1,825,008.200	
MCKESSON CORP	14,289	202.130	2,888,235.570	
NVIDIA CORP	54,034	570.630	30,833,421.420	
GENERAL ELECTRIC CO	764,551	13.350	10,206,755.850	
WW GRAINGER INC	3,622	474.220	1,717,624.840	
HALLIBURTON CO	77,483	22.740	1,761,963.420	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,607	91.600	3,170,001.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,529	368.680	10,518,071.720	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,486	217.020	4,011,831.720	
HASBRO INC	11,383	99.390	1,131,356.370	
HENRY SCHEIN INC	12,161	82.970	1,008,998.170	
HEICO CORP	3,623	139.100	503,959.300	
HERSHEY FOODS CORP	13,002	170.310	2,214,370.620	
HP INC	120,197	35.250	4,236,944.250	
F5 NETWORKS INC	5,529	182.720	1,010,258.880	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,874	112.610	1,337,131.140	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	27.000	754,353.000	
HOLOGIC INC	21,443	65.090	1,395,724.870	
HOME DEPOT INC	93,882	341.120	32,025,027.840	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	76.390	1,244,240.320	
HORMEL FOODS CORP	26,254	47.570	1,248,902.780	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	24.500	1,202,092.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	353.510	1,029,774.630	
HUMANA INC	11,517	469.970	5,412,644.490	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	180.470	1,361,465.680	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,857	15.760	1,479,186.320	
BIOGEN INC	13,531	275.610	3,729,278.910	
IDEX CORP	6,612	226.860	1,499,998.320	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,428	239.060	6,556,937.680	
INTUIT INC	22,980	392.540	9,020,569.200	
IDEXX LABORATORIES INC	7,466	525.260	3,921,591.160	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	36.240	397,190.400	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,013	186.660	3,922,286.580	
INTEL CORP	357,563	55.970	20,012,801.110	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,906	142.710	2,840,785.260	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,598	62.080	2,023,683.840	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	32.790	1,158,044.430	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,541	142.360	1,642,976.760	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	158.860	1,092,003.640	
INCYTE CORP	15,341	81.390	1,248,603.990	
JOHNSON & JOHNSON	229,593	170.270	39,092,800.110	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,886	65.890	2,100,968.540	
KLA CORPORATION	13,653	299.900	4,094,534.700	
DEVON ENERGY CORP	49,345	26.010	1,283,463.450	
KELLOGG CO	22,333	68.210	1,523,333.930	
KEYCORP	79,472	22.960	1,824,677.120	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,692	136.900	4,064,834.800	
BLACKROCK INC/NEW YORK	13,282	857.450	11,388,650.900	
KROGER CO	71,262	38.860	2,769,241.320	
LAM RESEARCH CORP	12,603	586.450	7,391,029.350	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	431.980	1,426,397.960	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	154.560	1,304,177.280	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	111.230	1,574,238.190	
PLUG POWER INC	42,511	20.070	853,195.770	
LENNAR CORP	24,511	107.960	2,646,207.560	
ELI LILLY & CO	75,159	194.760	14,637,966.840	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	69.360	1,254,722.400	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	62,427	216.130	13,492,347.510	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	27,140	131.870	3,578,951.800	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,903	393.140	8,610,945.420	
LOEWS CORP	22,394	58.430	1,308,481.420	
LOWE'S COS INC	63,943	211.310	13,511,795.330	
DOMINION ENERGY INC	71,472	79.460	5,679,165.120	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,870	39.460	1,612,730.200	
MCCORMICK & CO INC	22,130	90.680	2,006,748.400	
MCDONALD'S CORPORATION	64,955	237.110	15,401,480.050	
S&P GLOBAL INC	20,982	390.360	8,190,533.520	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	272.810	931,918.960	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,215.820	1,460,199.820	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	54,307	90.400	4,909,352.800	
MARSH & MCLENNAN COS	44,421	137.790	6,120,769.590	
MASCO CORP	23,151	67.110	1,553,663.610	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,123	375.390	1,923,122.970	
METLIFE INC	67,434	66.470	4,482,337.980	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,591	92.650	2,185,706.150	
MEDTRONIC PLC	117,053	126.900	14,854,025.700	
ACTIVISION BLIZZARD INC	67,840	93.170	6,320,652.800	
CVS HEALTH CORP	114,217	85.850	9,805,529.450	
MERCK & CO. INC.	220,745	78.170	17,255,636.650	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	36,651	37.020	1,356,820.020	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,588	277.080	2,379,563.040	
MICROSOFT CORP	626,536	247.180	154,867,168.480	
MICRON TECH INC	97,476	80.850	7,880,934.600	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,990	143.310	3,294,696.900	
3M CO	50,244	207.330	10,417,088.520	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	226.480	1,126,964.480	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,876	200.410	2,981,299.160	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	307.820	2,569,065.720	
ILLUMINA INC	12,779	380.460	4,861,898.340	
XCEL ENERGY INC	46,591	72.590	3,382,040.690	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	91.240	735,211.920	
NETAPP INC	19,804	78.860	1,561,743.440	
NEWELL BRANDS INC	33,317	29.270	975,188.590	
NEWMONT CORP	67,812	68.350	4,634,950.200	
NVR INC	308	5,215.810	1,606,469.480	
NIKE INC-CL B	109,499	136.400	14,935,663.600	
NORDSON CORP	4,644	208.680	969,109.920	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,176	290.350	6,438,801.600	
EVERSOURCE ENERGY	30,121	85.450	2,573,839.450	
NISOURCE INC	33,097	26.470	876,077.590	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	120.180	2,086,925.700	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,126	373.800	5,280,298.800	
WELLS FARGO & CO	342,476	46.600	15,959,381.600	

NUCOR CORP	26,612	101.300	2,695,795.600	
CHENIERE ENERGY INC	19,976	81.680	1,631,639.680	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,074	157.380	6,306,846.120	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	78,449	26.630	2,089,096.870	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,821	270.130	2,112,686.730	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.080	546,234.240	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,576	562.470	3,698,802.720	
ORACLE CORP	170,734	80.150	13,684,330.100	
PACCAR INC	30,769	95.730	2,945,516.370	
PTC INC	9,801	129.140	1,265,701.140	
EXELON CORP	85,259	44.520	3,795,730.680	
PARKER HANNIFIN CORP	11,236	316.320	3,554,171.520	
PAYCHEX INC	27,217	100.440	2,733,675.480	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,553	554.500	3,633,638.500	
PPL CORPORATION	67,795	29.480	1,998,596.600	
PEPSICO INC	120,414	146.720	17,667,142.080	
PENTAIR PLC	12,644	69.050	873,068.200	
PFIZER INC	485,055	39.860	19,334,292.300	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,211	46.760	945,066.360	
CONOCOPHILLIPS	119,209	57.000	6,794,913.000	
PG&E CORP	123,999	10.880	1,349,109.120	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,337	167.580	3,072,914.460	
ALTRIA GROUP INC	162,340	50.680	8,227,391.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,940	198.560	7,334,806.400	
BROWN & BROWN INC	20,308	53.370	1,083,837.960	
GARMIN LTD	12,365	142.380	1,760,528.700	
PPG INDUSTRIES INC	21,001	179.270	3,764,849.270	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	187.500	628,687.500	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,463	381.480	14,672,865.240	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,806	190.210	3,767,299.260	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	141.480	1,687,290.480	
PROCTER & GAMBLE CO	216,037	137.670	29,741,813.790	
PROGRESSIVE CORP	49,860	105.740	5,272,196.400	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	44,503	63.280	2,816,149.840	
PULTE GROUP INC	21,939	62.350	1,367,896.650	
GLOBAL PAYMENTS INC	26,272	195.310	5,131,184.320	
QUALCOMM INC	98,725	128.940	12,729,601.500	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	135.050	1,450,977.200	
EXACT SCIENCES CORP	13,911	98.840	1,374,963.240	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	162.560	753,953.280	

REGENERON PHARMACEUTICALS	9, 234	502. 340	4, 638, 607. 560	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6, 097	128. 000	780, 416. 000	
RESMED INC	12, 108	193. 210	2, 339, 386. 680	
US BANCORP	118, 479	61. 170	7, 247, 360. 430	
SEAGEN INC	10, 602	135. 930	1, 441, 129. 860	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34, 383	39. 920	1, 372, 569. 360	
ROSS STORES INC	31, 230	130. 960	4, 089, 880. 800	
ROLLINS INC	18, 567	37. 220	691, 063. 740	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9, 166	444. 400	4, 073, 370. 400	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9, 692	270. 810	2, 624, 690. 520	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20, 567	83. 930	1, 726, 188. 310	
RPM INTERNATIONAL INC	11, 004	97. 920	1, 077, 511. 680	
ACCENTURE PLC-CL A	55, 275	290. 610	16, 063, 467. 750	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	124, 700	62. 070	7, 740, 129. 000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10, 818	268. 880	2, 908, 743. 840	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	22, 302	161. 670	3, 605, 564. 340	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	54, 372	149. 460	8, 126, 439. 120	
BOOKING HOLDINGS INC	3, 576	2, 263. 100	8, 092, 845. 600	
SCHLUMBERGER LTD	123, 810	31. 630	3, 916, 110. 300	
SCHWAB (CHARLES) CORP	133, 711	71. 100	9, 506, 852. 100	
POOL CORP	3, 532	444. 960	1, 571, 598. 720	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18, 291	171. 950	3, 145, 137. 450	
BUNGE LTD	10, 954	90. 540	991, 775. 160	
SEI INVESTMENTS CO	10, 653	63. 385	675, 240. 400	
ANTHEM INC	21, 677	401. 900	8, 711, 986. 300	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13, 836	123. 250	1, 705, 287. 000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25, 038	66. 810	1, 672, 788. 780	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21, 388	288. 650	6, 173, 646. 200	
CENTENE CORP	48, 785	69. 560	3, 393, 484. 600	
SVB FINANCIAL GROUP	4, 631	575. 900	2, 666, 992. 900	
SMITH (A. O.) CORP	11, 351	72. 250	820, 109. 750	
SNAP-ON INC	4, 591	255. 370	1, 172, 403. 670	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34, 967	106. 720	3, 731, 678. 240	
ADVANCE AUTO PARTS	6, 226	208. 590	1, 298, 681. 340	
EDISON INTERNATIONAL	31, 223	58. 990	1, 841, 844. 770	
SOUTHERN CO	92, 031	66. 310	6, 102, 575. 610	
TRUIST FINANCIAL CORP	117, 919	60. 890	7, 180, 087. 910	
SOUTHWEST AIRLINES	13, 220	61. 350	811, 047. 000	
AT&T INC	621, 475	32. 630	20, 278, 729. 250	
CHEVRON CORP	168, 033	109. 570	18, 411, 375. 810	

STANLEY BLACK & DECKER INC	14, 274	220. 690	3, 150, 129. 060	
STATE STREET CORP	29, 438	87. 830	2, 585, 539. 540	
STARBUCKS CORP	102, 433	114. 300	11, 708, 091. 900	
STEEL DYNAMICS INC	17, 547	63. 980	1, 122, 657. 060	
STRYKER CORP	29, 442	255. 980	7, 536, 563. 160	
NETFLIX INC	38, 560	486. 690	18, 766, 766. 400	
NORTONLIFELOCK INC	48, 955	21. 080	1, 031, 971. 400	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9, 793	50. 090	490, 531. 370	
SYNOPSYS INC	13, 449	232. 390	3, 125, 413. 110	
SYSCO CORP	42, 310	85. 640	3, 623, 428. 400	
INTUITIVE SURGICAL INC	10, 252	834. 790	8, 558, 267. 080	
TELEFLEX INC	4, 122	407. 640	1, 680, 292. 080	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88, 322	10. 250	905, 300. 500	
TERADYNE INC	14, 284	121. 840	1, 740, 362. 560	
TEXAS INSTRUMENTS INC	80, 128	182. 050	14, 587, 302. 400	
TEXTRON INC	19, 486	68. 050	1, 326, 022. 300	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34, 613	463. 470	16, 042, 087. 110	
GLOBE LIFE INC	8, 329	105. 860	881, 707. 940	
DAVITA INC	6, 497	127. 980	831, 486. 060	
TRACTOR SUPPLY CO	10, 462	195. 700	2, 047, 413. 400	
TRIMBLE INC	22, 159	77. 740	1, 722, 640. 660	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3, 534	392. 220	1, 386, 105. 480	
TYSON FOODS INC	25, 913	78. 820	2, 042, 462. 660	
UGI CORP	19, 377	46. 210	895, 411. 170	
UNION PACIFIC CORP	58, 712	228. 440	13, 412, 169. 280	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	132, 685	85. 040	11, 283, 532. 400	
UNITEDHEALTH GROUP INC	82, 659	420. 890	34, 790, 346. 510	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7, 737	157. 050	1, 215, 095. 850	
VF CORP	29, 520	86. 940	2, 566, 468. 800	
VIACOMCBS INC	50, 493	39. 270	1, 982, 860. 110	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22, 989	212. 900	4, 894, 358. 100	
VULCAN MATERIALS CO	10, 992	190. 760	2, 096, 833. 920	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62, 288	55. 110	3, 432, 691. 680	
WALMART INC	123, 488	140. 820	17, 389, 580. 160	
WASTE MANAGEMENT INC	36, 937	143. 260	5, 291, 594. 620	
WATERS CORP	5, 084	317. 630	1, 614, 830. 920	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6, 458	333. 730	2, 155, 228. 340	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10, 306	138. 490	1, 427, 277. 940	

VAIL RESORTS INC	3, 590	318. 010	1, 141, 655. 900	
WESTERN DIGITAL CORP	27, 103	68. 620	1, 859, 807. 860	
WABTEC CORP	16, 043	80. 860	1, 297, 236. 980	
WHIRLPOOL CORP	5, 587	251. 800	1, 406, 806. 600	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13, 987	165. 950	2, 321, 142. 650	
WYNN RESORTS LTD	8, 309	125. 730	1, 044, 690. 570	
NASDAQ INC	10, 097	163. 530	1, 651, 162. 410	
CME GROUP INC	31, 381	208. 050	6, 528, 817. 050	
WILLIAMS COS INC	101, 276	25. 540	2, 586, 589. 040	
LKQ CORP	25, 055	49. 960	1, 251, 747. 800	
ALLIANT ENERGY CORP	22, 453	57. 950	1, 301, 151. 350	
WEC ENERGY GROUP INC	26, 247	99. 260	2, 605, 277. 220	
CARMAX INC	14, 684	127. 910	1, 878, 230. 440	
XILINX INC	20, 603	119. 590	2, 463, 912. 770	
TJX COMPANIES INC	104, 812	72. 990	7, 650, 227. 880	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4, 459	484. 040	2, 158, 334. 360	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108, 700	4. 860	528, 282. 000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20, 600	66. 890	1, 377, 934. 000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10, 239	128. 630	1, 317, 042. 570	
CBRE GROUP INC	29, 528	86. 590	2, 556, 829. 520	
LIBERTY GLOBAL PLC	12, 732	27. 760	353, 440. 320	
REGIONS FINANCIAL CORP	85, 582	22. 650	1, 938, 432. 300	
DOMINO'S PIZZA INC	3, 317	431. 070	1, 429, 859. 190	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3, 737	321. 860	1, 202, 790. 820	
T-MOBILE US INC	48, 758	135. 810	6, 621, 823. 980	
LAS VEGAS SANDS CORP	30, 277	57. 140	1, 730, 027. 780	
MOSAIC CO/THE	32, 592	35. 510	1, 157, 341. 920	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3, 402	439. 790	1, 496, 165. 580	
CELANESE CORP	10, 141	167. 200	1, 695, 575. 200	
DEXCOM INC	8, 096	342. 690	2, 774, 418. 240	
DISCOVERY INC-A	14, 886	37. 260	554, 652. 360	
EXPEDIA GROUP INC	11, 410	173. 090	1, 974, 956. 900	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18, 475	54. 650	1, 009, 658. 750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10, 347	264. 100	2, 732, 642. 700	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34, 023	27. 810	946, 179. 630	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49, 028	114. 280	5, 602, 919. 840	
LIVE NATION	13, 804	83. 060	1, 146, 560. 240	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2, 338	1, 391. 840	3, 254, 121. 920	
TRANSDIGM GROUP INC	4, 537	601. 370	2, 728, 415. 690	
MASTERCARD INC	77, 603	366. 340	28, 429, 083. 020	

WESTERN UNION CO	35,367	25.800	912,468.600	
OWENS CORNING	9,740	108.220	1,054,062.800	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	104.480	1,344,239.680	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	18.500	320,975.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,959	165.630	1,649,509.170	
DELTA AIR LINES INC	14,723	45.430	668,865.890	
INSULET CORP	6,122	226.750	1,388,163.500	
DISCOVER FINANCIAL	27,544	118.740	3,270,574.560	
TE CONNECTIVITY LTD	28,976	136.500	3,955,224.000	
MASIMO CORP	4,505	216.880	977,044.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,863	324.260	3,522,436.380	
VMWARE INC	7,464	163.660	1,221,558.240	
MERCADOLIBRE INC	3,928	1,384.460	5,438,158.880	
ULTA BEAUTY INC	4,737	322.340	1,526,924.580	
INVESCO LTD	33,443	28.220	943,761.460	
MSCI INC	7,461	476.890	3,558,076.290	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,731	98.060	13,309,781.860	
VISA INC	147,591	225.970	33,351,138.270	
KEURIG DR PEPPER INC	48,480	36.380	1,763,702.400	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,083	156.000	2,508,948.000	
DISCOVERY INC-C	24,122	32.265	778,296.330	
MARATHON PETROLEUM CORP	57,257	59.810	3,424,541.170	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	111.960	1,314,858.240	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	170,023	18.250	3,102,919.750	
XYLEM INC	15,776	119.800	1,889,964.800	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	113.440	2,794,707.840	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	219.370	764,285.080	
SPLUNK INC	13,441	113.740	1,528,779.340	
EPAM SYSTEMS INC	4,954	460.010	2,278,889.540	
ZILLOW GROUP INC	4,265	113.870	485,655.550	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	57.630	853,730.820	
HCA HEALTHCARE INC	23,595	211.890	4,999,544.550	
VERISK ANALYTICS INC	13,730	179.560	2,465,358.800	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,257	176.100	925,757.700	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,343	283.190	2,079,464.170	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	14,394	188.640	2,715,284.160	
NXP SEMICONDUCTOR NV	24,544	189.030	4,639,552.320	

BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11, 667	83. 360	972, 561. 120	
LEAR CORP	4, 681	190. 630	892, 339. 030	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8, 704	110. 630	962, 923. 520	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20, 243	73. 320	1, 484, 216. 760	
DOLLAR GENERAL CORP	22, 156	218. 860	4, 849, 062. 160	
FORTINET INC	12, 146	204. 290	2, 481, 306. 340	
HORIZON PHARMA PLC	19, 642	86. 240	1, 693, 926. 080	
TESLA INC	66, 165	629. 040	41, 620, 431. 600	
GENERAC HOLDINGS INC	5, 632	305. 210	1, 718, 942. 720	
ENPHASE ENERGY INC	10, 163	118. 120	1, 200, 453. 560	
GENERAL MOTORS CO	112, 605	57. 410	6, 464, 653. 050	
XPO LOGISTICS INC	7, 614	148. 180	1, 128, 242. 520	
ALLY FINANCIAL INC	30, 467	53. 670	1, 635, 163. 890	
VOYA FINANCIAL INC	10, 611	68. 530	727, 171. 830	
APTIV PLC	24, 029	143. 780	3, 454, 889. 620	
PHILLIPS 66	38, 464	85. 590	3, 292, 133. 760	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7, 172	97. 740	700, 991. 280	
FACEBOOK INC	209, 759	305. 970	64, 179, 961. 230	
IQVIA HOLDINGS INC	16, 838	231. 490	3, 897, 828. 620	
SERVICENOW INC	17, 124	466. 800	7, 993, 483. 200	
PALO ALTO NETWORKS INC	8, 027	341. 340	2, 739, 936. 180	
WORKDAY INC	15, 874	232. 290	3, 687, 371. 460	
ABBVIE INC	154, 294	116. 220	17, 932, 048. 680	
ZOETIS INC	41, 554	171. 170	7, 112, 798. 180	
NEWS CORP/NEW-CL A	30, 862	27. 440	846, 853. 280	
CDW CORP	12, 600	171. 420	2, 159, 892. 000	
HOWMET AEROSPACE INC	34, 315	32. 580	1, 117, 982. 700	
TWILIO INC	12, 367	294. 700	3, 644, 554. 900	
COUPA SOFTWARE INC	5, 718	234. 530	1, 341, 042. 540	
SNAP INC	81, 216	52. 140	4, 234, 602. 240	
TRADE DESK INC A	3, 760	489. 600	1, 840, 896. 000	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18, 557	43. 770	812, 239. 890	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8, 324	41. 980	349, 441. 520	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14, 205	42. 160	598, 882. 800	
OKTA INC	10, 690	230. 750	2, 466, 717. 500	
BLACK KNIGHT INC	13, 669	75. 020	1, 025, 448. 380	
BAKER HUGHES CO	56, 969	24. 630	1, 403, 146. 470	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13, 181	78. 900	1, 039, 980. 900	
ALTICE USA INC-A	21, 506	37. 600	808, 625. 600	
BROADCOM INC	35, 343	436. 100	15, 413, 082. 300	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6, 293	260. 390	1, 638, 634. 270	
MONGODB INC	4, 349	254. 390	1, 106, 342. 110	
BURLINGTON STORES INC	5, 894	328. 650	1, 937, 063. 100	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35, 824	32. 240	1, 154, 965. 760	

VEEVA SYSTEMS INC	11,921	249.140	2,969,997.940	
TWITTER INC	69,812	51.810	3,616,959.720	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	57.620	761,390.680	
EVERGY INC	18,131	64.040	1,161,109.240	
ALLEGION PLC	7,353	142.550	1,048,170.150	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	83.930	961,334.220	
STERIS PLC	7,390	207.640	1,534,459.600	
DOCUSIGN INC	15,982	190.000	3,036,580.000	
WIX.COM LTD	4,918	281.590	1,384,859.620	
DROPBOX INC	28,170	25.430	716,363.100	
KKR & CO INC	42,868	57.090	2,447,334.120	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	17,075	288.490	4,925,966.750	
MODERNA INC	23,442	158.550	3,716,729.100	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	24,527	121.580	2,981,992.660	
ARAMARK	20,857	37.620	784,640.340	
CIGNA CORP	31,550	266.910	8,421,010.500	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,759	99.680	2,069,257.120	
DOW INC	64,632	68.730	4,442,157.360	
AMCOR PLC	138,490	12.450	1,724,200.500	
PINTEREST INC	44,897	58.360	2,620,188.920	
PELOTON INTERACTIVE INC	20,525	87.490	1,795,732.250	
FOX CORP-A	31,751	38.830	1,232,891.330	
FOX CORP-B	13,009	37.250	484,585.250	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	14,762	187.580	2,769,055.960	
CHEWY INC	6,586	67.830	446,728.380	
AVANTOR INC	44,509	30.480	1,356,634.320	
DYNATRACE INC	15,949	45.370	723,606.130	
CLOUDFLARE INC	16,628	68.870	1,145,170.360	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	83.050	586,748.250	
CARRIER GLOBAL CORP	72,193	45.410	3,278,284.130	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,946	78.250	2,812,774.500	
UBER TECHNOLOGIES INC	84,858	45.790	3,885,647.820	
CORTEVA INC	65,002	46.990	3,054,443.980	
MATCH GROUP INC	21,285	141.810	3,018,425.850	
SLACK TECHNOLOGIES INC	38,755	41.040	1,590,505.200	
BLACKSTONE GROUP INC	58,958	88.610	5,224,268.380	
CARLYLE GROUP INC	12,509	44.510	556,775.590	
10X GENOMICS INC	5,312	134.840	716,270.080	
DATADOG INC	14,775	76.860	1,135,606.500	
INGERSOLL RAND INC	31,282	50.120	1,567,853.840	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	317.200	1,373,476.000	
PPD INC	10,828	46.120	499,387.360	
AON PLC	19,949	258.450	5,155,819.050	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	234.760	1,658,344.640	

AIRBNB INC	4, 882	146. 730	716, 335. 860	
ZENDESK INC	10, 590	131. 930	1, 397, 138. 700	
ROYALTY PHARMA PLC	16, 861	41. 490	699, 562. 890	
VIATRIS INC	103, 126	15. 040	1, 551, 015. 040	
DRAFTKINGS INC	14, 671	45. 340	665, 183. 140	
SNOWFLAKE INC	2, 127	193. 820	412, 255. 140	
ARISTA NETWORKS INC	5, 042	326. 200	1, 644, 700. 400	
IHS MARKIT LTD	33, 179	107. 700	3, 573, 378. 300	
FNF GROUP	24, 567	46. 380	1, 139, 417. 460	
MARVELL TECHNOLOGY INC	66, 605	44. 320	2, 951, 933. 600	
CATALENT INC	14, 673	104. 800	1, 537, 730. 400	
SYNCHRONY FINANCIAL	46, 538	46. 020	2, 141, 678. 760	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	37, 788	49. 350	1, 864, 837. 800	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3, 457	119. 750	413, 975. 750	
WAYFAIR INC	5, 840	321. 100	1, 875, 224. 000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16, 395	139. 900	2, 293, 660. 500	
HUBSPOT INC	3, 654	486. 430	1, 777, 415. 220	
QORVO INC	10, 168	171. 470	1, 743, 506. 960	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	1, 162	160. 950	187, 023. 900	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14, 950	165. 790	2, 478, 560. 500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17, 018	33. 680	573, 166. 240	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4, 257	213. 340	908, 188. 380	
GODADDY INC	14, 540	80. 890	1, 176, 140. 600	
ETSY INC	10, 580	167. 130	1, 768, 235. 400	
TRANSUNION	16, 760	106. 520	1, 785, 275. 200	
SQUARE INC	33, 616	216. 430	7, 275, 510. 880	
DUPONT DE NEMOURS INC	47, 313	81. 680	3, 864, 525. 840	
CARVANA CO	5, 347	242. 180	1, 294, 936. 460	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	18, 296	56. 430	1, 032, 443. 280	
TELADOC HEALTH INC	9, 788	141. 050	1, 380, 597. 400	
WESTROCK CO	22, 778	59. 680	1, 359, 391. 040	
KRAFT HEINZ CO	56, 429	43. 620	2, 461, 432. 980	
NOVOCURE LTD	7, 408	182. 010	1, 348, 330. 080	
FORTIVE CORP	26, 474	71. 630	1, 896, 332. 620	
WASTE CONNECTIONS INC	23, 285	123. 620	2, 878, 491. 700	
ALPHABET INC-CL A	26, 351	2, 291. 750	60, 389, 904. 250	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	114, 285	16. 410	1, 875, 416. 850	
PAYPAL HOLDINGS INC	97, 262	243. 630	23, 695, 941. 060	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35, 277	34. 330	1, 211, 059. 410	
SUNRUN INC	10, 000	40. 800	408, 000. 000	

	ZILLOW GROUP INC-C	13,376	112.470	1,504,398.720	
	ALPHABET INC-CL C	25,783	2,341.660	60,375,019.780	
	ZSCALER INC	6,609	165.770	1,095,573.930	
	CABLE ONE INC	392	1,742.480	683,052.160	
	LINDE PLC	45,759	301.010	13,773,916.590	
	ATHENE HOLDING LTD	8,838	62.290	550,519.020	
	ROKU INC	9,562	301.410	2,882,082.420	
	AVALARA INC	7,102	122.760	871,841.520	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,191	694.720	8,469,331.520	
	VISTRA CORP	38,032	16.010	608,892.320	
アメリカ・ドル 小計		27,284,226		3,194,066,309.730 (348,121,287,096)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	18.835	664,140.930	
	ASHTAD GROUP	39,955	48.130	1,923,034.150	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	24.980	547,886.340	
	BHP GROUP PLC	183,920	23.755	4,369,019.600	
	BARCLAYS PLC	1,522,628	1.854	2,822,952.310	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	80,307	7.812	627,358.280	
	BT GROUP PLC	795,507	1.708	1,358,725.950	
	BUNZL PLC	28,834	23.160	667,795.440	
	AVIVA PLC	347,472	4.132	1,435,754.300	
	CRODA INTERNATIONAL	12,568	67.000	842,056.000	
	DIAGEO PLC	204,014	32.650	6,661,057.100	
	SCHRODERS PLC	11,354	35.980	408,516.920	
	DCC PLC	7,898	61.280	483,989.440	
	NATIONAL GRID PLC	310,448	9.300	2,887,166.400	
	KINGFISHER PLC	168,984	3.703	625,747.750	
	BAE SYSTEMS PLC	268,285	5.132	1,376,838.620	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	200,509	28.250	5,664,379.250	
	HALMA PLC	33,758	25.610	864,542.380	
	NEXT PLC	11,467	83.200	954,054.400	
	IMPERIAL BRANDS PLC	79,783	16.135	1,287,298.700	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	32.400	619,066.800	
	ANGLO AMERICAN PLC	106,433	34.085	3,627,768.800	
	COMPASS GROUP PLC	156,538	16.005	2,505,390.690	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,777,219	4.544	8,075,683.130	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	521,984	2.884	1,505,401.850	
	UNILEVER PLC	229,033	42.785	9,799,176.900	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.830	421,287.960	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	9.880	669,014.320	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	95,487	6.840	653,131.080	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	23.690	738,322.540	
PEARSON PLC	65,009	8.422	547,505.790	
PERSIMMON PLC	28,126	31.810	894,688.060	
PRUDENTIAL PLC	227,614	15.855	3,608,819.970	
RIO TINTO PLC	97,409	66.580	6,485,491.220	
VODAFONE GROUP PLC	2,336,405	1.424	3,327,040.720	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	63,262	63.500	4,017,137.000	
RELX PLC	168,306	18.725	3,151,529.850	
RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	4.756	807,407.090	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	746,540	1.096	818,207.840	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.970	833,416.380	
ST JAMES' S PLACE PLC	49,789	13.835	688,830.810	
SSE PLC	90,917	14.785	1,344,207.840	
BP PLC	1,774,599	3.157	5,602,409.040	
SAGE GROUP PLC (THE)	87,238	6.316	550,995.200	
SMITHS GROUP PLC	35,235	15.905	560,412.670	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	118.000	775,732.000	
STANDARD CHARTERED PLC	240,093	5.214	1,251,844.900	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,262,988	0.478	2,993,708.260	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.810	627,697.140	
TESCO PLC	679,368	2.300	1,562,546.400	
3I GROUP PLC	87,095	12.335	1,074,316.820	
SMITH & NEPHEW PLC	76,928	15.450	1,188,537.600	
GLAXOSMITHKLINE PLC	439,252	13.518	5,937,808.530	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,667	70.760	1,886,956.920	
WPP PLC	109,394	9.914	1,084,532.110	
ASTRAZENECA PLC	114,648	77.170	8,847,386.160	
WHITBREAD PLC	18,594	31.880	592,776.720	
INTERTEK GROUP PLC	13,842	59.840	828,305.280	
BURBERRY GROUP PLC	32,218	21.900	705,574.200	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	49.800	829,269.600	
SAINSBURY (J) PLC	132,694	2.561	339,829.330	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	29.780	473,293.540	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,434	48.970	559,922.980	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	358,793	14.216	5,100,601.280	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	322,365	13.642	4,397,703.330	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,491	23.500	293,538.500	
AVEVA GROUP PLC	10,408	32.510	338,364.080	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.765	570,455.440	

	EXPERIAN PLC	76,868	27.220	2,092,346.960	
	MONDI PLC	38,299	19.600	750,660.400	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	17.720	496,354.920	
	FRESNILLO PLC NPR	17,385	9.202	159,976.770	
	OCADO GROUP PLC	42,789	19.715	843,585.130	
	INFORMA PLC	128,510	5.684	730,450.840	
	GLENCORE PLC	839,927	3.312	2,781,838.220	
	ENTAIN PLC	49,618	16.210	804,307.780	
	EVRAZ PLC	48,765	6.982	340,477.230	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.939	331,207.660	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	25.680	390,541.440	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	53,472	7.320	391,415.040	
	FERGUSON PLC	20,531	94.380	1,937,715.780	
	M&G PLC	204,940	2.216	454,147.040	
	JD SPORTS FASHION PLC	47,098	9.160	431,417.680	
	AUTO TRADER GROUP PLC	81,805	5.594	457,617.170	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.665	707,083.870	
イギリス・ポンド 小計		25,735,140		154,686,502.860 (23,795,424,735)	
イスラエル・シ ュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	27.060	2,769,834.540	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	24.440	3,194,381.320	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	436.500	768,240.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.620	1,595,333.080	
	ICL GROUP LTD	68,048	22.500	1,531,080.000	
	NICE LTD	5,535	745.800	4,128,003.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	94.390	985,809.160	
	AZRIELI GROUP	4,414	234.700	1,035,965.800	
イスラエル・シュケル 小計		425,397		16,008,646.900 (535,002,576)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	62.920	1,060,453.680	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	248,406	27.380	6,801,356.280	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	316,030	26.420	8,349,512.600	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	143,130	24.790	3,548,192.700	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.490	1,271,787.410	
	AMP LTD	302,414	1.125	340,215.750	
	ASX LTD	15,518	71.920	1,116,054.560	
	BHP GROUP LTD	256,650	51.650	13,255,972.500	
	AMPOL LTD	20,946	26.970	564,913.620	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	14.160	730,712.640	
	CSL LIMITED	39,828	275.360	10,967,038.080	
	REA GROUP LTD	4,278	160.440	686,362.320	

TRANSURBAN GROUP	242, 508	14. 340	3, 477, 564. 720	
COCHLEAR LTD	5, 743	218. 460	1, 254, 615. 780	
ORIGIN ENERGY LTD	128, 224	4. 160	533, 411. 840	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	154, 630	95. 150	14, 713, 044. 500	
RIO TINTO LIMITED	33, 859	132. 940	4, 501, 215. 460	
APA GROUP	118, 205	9. 820	1, 160, 773. 100	
ARISTOCRAT LEISU	51, 717	38. 000	1, 965, 246. 000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225, 180	5. 100	1, 148, 418. 000	
TPG TELECOM LTD	28, 719	5. 180	148, 764. 420	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39, 410	43. 800	1, 726, 158. 000	
ORICA LTD	41, 311	13. 940	575, 875. 340	
CIMIC GROUP LTD	8, 709	19. 320	168, 257. 880	
LEND LEASE CORP LTD	62, 116	12. 140	754, 088. 240	
BLUESCOPE STEEL LTD	46, 777	23. 380	1, 093, 646. 260	
SYDNEY AIRPORT	116, 056	5. 980	694, 014. 880	
MACQUARIE GROUP LTD	30, 322	158. 210	4, 797, 243. 620	
SUNCORP GROUP LTD	118, 236	11. 060	1, 307, 690. 160	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	288, 474	27. 090	7, 814, 760. 660	
NEWCREST MINING LTD	73, 202	28. 100	2, 056, 976. 200	
OIL SEARCH LTD	148, 835	3. 960	589, 386. 600	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62, 282	4. 710	293, 348. 220	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117, 924	10. 680	1, 259, 428. 320	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93, 404	11. 340	1, 059, 201. 360	
SANTOS LTD	159, 618	7. 190	1, 147, 653. 420	
SONIC HEALTHCARE	40, 148	35. 130	1, 410, 399. 240	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8, 406	30. 010	252, 264. 060	
TABCORP HOLDINGS LTD	214, 597	5. 150	1, 105, 174. 550	
WESFARMERS LTD	99, 088	54. 850	5, 434, 976. 800	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	86, 196	23. 420	2, 018, 710. 320	
WOOLWORTHS GROUP LTD	110, 976	40. 500	4, 494, 528. 000	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9, 995	46. 990	469, 665. 050	
SEEK LTD	28, 713	30. 250	868, 568. 250	
AUSNET SERVICES	165, 066	1. 885	311, 149. 410	
AGL ENERGY LTD	49, 076	8. 850	434, 322. 600	
BRAMBLES LTD	127, 166	10. 590	1, 346, 687. 940	
CROWN RESORTS LTD	32, 861	13. 000	427, 193. 000	
EVOLUTION MINING LTD	140, 964	5. 090	717, 506. 760	
AURIZON HOLDINGS LTD	150, 150	3. 700	555, 555. 000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	57, 667	10. 090	581, 860. 030	

	XERO LTD	10,498	136.000	1,427,728.000	
	AFTERPAY LTD	18,322	97.500	1,786,395.000	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.060	866,451.240	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	3.080	1,270,022.600	
	COLES GROUP LTD	121,032	16.210	1,961,928.720	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	27.930	379,959.720	
オーストラリア・ドル 小計		6,355,552		131,054,401.410 (11,176,319,352)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,375	82.790	1,769,636.250	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	71,520	42.600	3,046,752.000	
	BARRICK GOLD CORP	156,423	28.950	4,528,445.850	
	ATCO LTD	7,193	42.450	305,342.850	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	17.400	370,132.800	
	BANK OF MONTREAL	56,107	117.810	6,609,965.670	
	BANK OF NOVA SCOTIA	105,569	79.450	8,387,457.050	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,716	90.730	2,514,672.680	
	BCE INC	14,959	59.490	889,910.910	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	112,393	55.700	6,260,290.100	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	33.280	938,229.760	
	SAPUTO INC	25,395	39.670	1,007,419.650	
	BLACKBERRY LTD	46,671	9.860	460,176.060	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	56,605	19.200	1,086,816.000	
	CGI INC	19,859	108.940	2,163,439.460	
	CCL INDUSTRIES INC	15,358	70.890	1,088,728.620	
	CAE INC	25,006	37.250	931,473.500	
	CAMECO CORP	32,627	23.770	775,543.790	
	ROGERS COMM-CL B	31,543	62.080	1,958,189.440	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,924	130.770	5,090,091.480	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,953	41.520	4,316,128.560	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	198.250	963,891.500	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	35.300	321,900.700	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,949	136.820	8,475,862.180	
	YAMANA GOLD INC	84,317	6.120	516,020.040	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	43.480	691,810.280	
	OPEN TEXT CORP	24,883	56.770	1,412,607.910	
	EMPIRE CO LTD	15,093	40.670	613,832.310	
	KINROSS GOLD CORP	118,575	9.350	1,108,676.250	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	81.610	813,080.430	
	FORTIS INC	39,632	54.990	2,179,363.680	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	31.980	1,589,214.120	

TELUS CORP	31,890	26.290	838,388.100	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	36.460	920,615.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	37.530	808,471.260	
ENBRIDGE INC	177,484	48.430	8,595,550.120	
IGM FINANCIAL INC	6,069	45.180	274,197.420	
MANULIFE FINANCIAL CORP	169,194	26.020	4,402,427.880	
LOBLAW CO LTD	15,136	71.560	1,083,132.160	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,626	117.200	2,768,967.200	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,646	65.910	3,338,077.860	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	576.060	1,381,391.880	
METRO INC	21,394	58.380	1,248,981.720	
EMERA INC	22,433	56.370	1,264,548.210	
ONEX CORP	6,646	84.190	559,526.740	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	41.740	783,292.840	
POWER CORP OF CANADA	50,405	36.840	1,856,920.200	
QUEBECOR INC-B	16,042	34.750	557,459.500	
ROYAL BANK OF CANADA	123,521	120.380	14,869,457.980	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,765	482.370	5,675,083.050	
SHAW COMM INC-B	39,427	36.130	1,424,497.510	
SUNCOR ENERGY INC	134,506	28.240	3,798,449.440	
LUNDIN MINING CORP	64,310	14.860	955,646.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	30.590	1,254,679.440	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	116.510	1,753,358.990	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	106.260	788,130.420	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	157,623	85.800	13,524,053.400	
TC ENERGY CORP	79,381	61.950	4,917,652.950	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	105.040	756,288.000	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	114.620	708,810.080	
INTACT FINANCIAL CORP	12,515	166.970	2,089,629.550	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,884	52.650	2,099,892.600	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,781	1,759.140	3,133,028.340	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	15,847	179.360	2,842,317.920	
B2GOLD CORP	101,675	6.100	620,217.500	
KEYERA CORP	16,668	29.100	485,038.800	
PARKLAND CORP	14,497	40.510	587,273.470	
ALTAGAS LTD	23,944	24.240	580,402.560	
PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	38.110	1,921,125.100	
DOLLARAMA INC	26,906	53.750	1,446,197.500	
CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	9.260	1,108,505.340	
NORTHLAND POWER INC	17,568	39.130	687,435.840	
TMX GROUP LTD	5,058	135.180	683,740.440	

	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	49.540	1,081,953.600	
	INTER PIPELINE LTD	41,863	17.790	744,742.770	
	NUTRIEN LTD	47,599	74.650	3,553,265.350	
	SSR MINING INC	18,000	20.300	365,400.000	
	WSP GLOBAL INC	10,194	128.040	1,305,239.760	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,771	71.500	627,126.500	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	38.750	638,793.750	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	47.430	514,378.350	
	AIR CANADA	10,722	25.000	268,050.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	83.550	2,103,454.800	
	SHOPIFY INC	9,634	1,303.280	12,555,799.520	
	FIRSTSERVICE CORP	3,503	195.820	685,957.460	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	29.220	544,485.480	
	HYDRO ONE LTD	27,340	30.300	828,402.000	
カナダ・ドル 小計		3,516,046		198,395,012.130 (17,853,567,142)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.750	468,750.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	158,800	29.630	4,705,244.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.640	278,096.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	10.260	706,914.000	
	CAPITALAND LTD	232,915	3.620	843,152.300	
	GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.840	358,512.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.310	716,319.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	297,553	12.570	3,740,241.210	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	664,422	2.440	1,621,189.680	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	100,150	4.870	487,730.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	26.540	2,717,696.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.540	305,370.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.920	397,320.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.910	890,674.000	
シンガポール・ドル 小計		2,591,140		18,237,208.690 (1,498,186,694)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	215,578	9.180	1,979,006.040	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	98.380	1,419,525.020	
	NESTLE SA-REGISTERED	251,234	109.000	27,384,506.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	45,822	95.480	4,375,084.560	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	60,929	301.750	18,385,325.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	260.300	902,460.100	
	SIKA INHABER	12,399	278.500	3,453,121.500	
	SGS SA-REG	540	2,750.000	1,485,000.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	193,828	79.440	15,397,696.320	

	BALOISE HOLDING AG -R	4, 259	151. 500	645, 238. 500	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2, 046. 000	542, 190. 000	
	CLARIANT AG-REG	19, 979	19. 550	390, 589. 450	
	SWISSCOM AG-REG	2, 489	494. 800	1, 231, 557. 200	
	ABB LTD	160, 075	30. 380	4, 863, 078. 500	
	ADECCO GROUP AG-REG	13, 600	61. 500	836, 400. 000	
	GEBERIT AG	3, 214	622. 800	2, 001, 679. 200	
	LONZA GROUP AG-REG	6, 593	563. 600	3, 715, 814. 800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	8, 405. 000	798, 475. 000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	89, 800. 000	808, 200. 000	
	GIVAUDAN-REG	809	3, 891. 000	3, 147, 819. 000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12, 752	387. 000	4, 935, 024. 000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3, 336	320. 600	1, 069, 521. 600	
	HOLCIM LTD	45, 832	55. 340	2, 536, 342. 880	
	TEMENOS GROUP	5, 723	129. 950	743, 703. 850	
	SONOVA HOLDING AG	4, 698	265. 800	1, 248, 728. 400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4, 816	280. 600	1, 351, 369. 600	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1, 365. 000	1, 254, 435. 000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2, 441	295. 300	720, 827. 300	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4, 592	57. 650	264, 728. 800	
	SCHINDLER NAMEN	1, 663	252. 200	419, 408. 600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2, 739	462. 000	1, 265, 418. 000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2, 500	88. 200	220, 500. 000	
	VIFOR PHARMA AG	3, 392	123. 450	418, 742. 400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	852. 000	479, 676. 000	
	SWISS PRIME SITE AG	6, 341	90. 350	572, 909. 350	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1, 658	1, 323. 000	2, 193, 534. 000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20, 118	57. 760	1, 162, 015. 680	
	SWISS RE LTD	25, 212	88. 100	2, 221, 177. 200	
	ALCON INC	43, 135	62. 040	2, 676, 095. 400	
	UBS GROUP AG	321, 504	14. 080	4, 526, 776. 320	
スイス・フラン 小計		1, 523, 547		124, 043, 701. 320 (14, 998, 123, 927)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	56, 181	523. 000	29, 382, 663. 000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36, 051	450. 000	16, 222, 950. 000	
	ERICSSON LM-B SHS	255, 112	114. 720	29, 266, 448. 640	
	LUNDBERGS B	7, 382	485. 600	3, 584, 699. 200	
	SKF AB-B SHS	34, 849	233. 100	8, 123, 301. 900	
	SANDVIK AB	103, 400	234. 200	24, 216, 280. 000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144, 990	110. 150	15, 970, 648. 500	
	SKANSKA AB-B SHS	31, 653	239. 000	7, 565, 067. 000	
	SWEDBANK AB	79, 825	150. 720	12, 031, 224. 000	

	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	151.650	8,029,109.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	99.340	13,831,108.200	
	VOLVO AB-B SHS	122,781	220.600	27,085,488.600	
	SWEDISH MATCH AB	138,450	75.010	10,385,134.500	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	112.450	5,291,334.750	
	INDUSTRIVARDEN A	12,131	331.000	4,015,361.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	311.400	3,550,894.200	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	236.600	4,540,590.600	
	SECURITAS AB-B SHS	23,986	143.750	3,447,987.500	
	INVESTOR AB-B SHS	39,372	729.800	28,733,685.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	212.100	15,037,041.600	
	ASSA ABLOY AB-B	88,119	254.400	22,417,473.600	
	TELIA CO AB	223,567	36.410	8,140,074.470	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	278.000	4,097,442.000	
	BOLIDEN AB	23,180	359.450	8,332,051.000	
	ALFA LAVAL AB	28,392	302.900	8,599,936.800	
	KINNEVIK AB-B	21,722	415.750	9,030,921.500	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	503.400	4,513,987.800	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	396.900	3,575,672.100	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	120.950	4,075,047.400	
	NIBE INDUSTRIER AB	24,131	323.000	7,794,313.000	
	HEXAGON AB	24,690	803.400	19,835,946.000	
	EPIROC AB-A	60,750	196.550	11,940,412.500	
	EPIROC AB-B	30,899	178.000	5,500,022.000	
	ESSITY AB-B	52,718	289.500	15,261,861.000	
	EQT AB	20,934	276.000	5,777,784.000	
	BOLIDEN AB	23,180	5.995	138,964.100	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	13,641	1,584.800	21,618,256.800	
	NORDEA BANK ABP	269,020	86.260	23,205,665.200	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	258.000	3,855,810.000	
スウェーデン・クローナ 小計		2,413,178		458,022,659.310 (5,977,195,704)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,494	1,121.000	9,521,774.000	
	A P MOLLER A/S	568	16,450.000	9,343,600.000	
	AP MOLLER MAERSK A	255	15,500.000	3,952,500.000	
	DANSKE BANK A/S	59,305	119.300	7,075,086.500	
	GENMAB A/S	5,825	2,289.000	13,333,425.000	
	NOVOZYMES-B SHS	17,740	450.800	7,997,192.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,964.000	2,409,732.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	150,567	467.750	70,427,714.250	
	GN STORE NORD A/S	11,641	504.000	5,867,064.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	86,515	235.800	20,400,237.000	

	COLOPLAST-B	10,734	963.600	10,343,282.400	
	DSV PANALPINA A S	18,283	1,432.000	26,181,256.000	
	DEMANT A/S	10,739	315.700	3,390,302.300	
	H LUNDBECK A/S	4,840	191.300	925,892.000	
	TRYG A/S	26,079	144.350	3,764,503.650	
	PANDORA A/S	8,251	776.200	6,404,426.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	556.000	5,190,816.000	
	AMBU A/S B	14,156	324.400	4,592,206.400	
	ORSTED A/S	15,885	864.600	13,734,171.000	
デンマーク・クロネ 小計		460,026		224,855,180.700 (3,997,925,113)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.520	828,899.520	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	14.250	425,989.500	
	A2 MILK CO LTD	62,165	6.620	411,532.300	
	FISHER & PAYKEL	49,044	33.900	1,662,591.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.540	724,688.420	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.820	421,025.880	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.320	660,541.840	
ニュージーランド・ドル 小計		596,848		5,135,269.060 (406,045,725)	
ノルウェー・クロネ	MOWI ASA	33,955	220.000	7,470,100.000	
	DNB ASA	80,709	182.200	14,705,179.800	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	56.440	7,282,791.840	
	TELENOR ASA	63,038	147.200	9,279,193.600	
	SCHIBSTED ASA	7,537	401.800	3,028,366.600	
	ORKLA ASA	65,283	84.500	5,516,413.500	
	EQUINOR ASA	81,088	180.100	14,603,948.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	438.000	6,654,534.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	189.100	3,154,755.300	
	ADEVINTA ASA	22,265	140.000	3,117,100.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	355.600	2,647,442.000	
ノルウェー・クロネ 小計		522,232		77,459,825.440 (1,019,371,303)	
ユーロ	CRH PLC	68,853	42.300	2,912,481.900	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,738	163.800	2,250,284.400	
	KERRY GROUP PLC-A	14,113	108.900	1,536,905.700	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	76.400	1,027,732.800	
	UMICORE	17,654	51.520	909,534.080	
	AIR LIQUIDE	41,123	143.300	5,892,925.900	
	AIRBUS SE	51,353	98.360	5,051,081.080	
	AXA SA	168,895	23.045	3,892,185.270	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,468	25.710	1,117,562.280	
	ADIDAS AG	16,660	286.450	4,772,257.000	

ASSICURAZIONI GENERALI	97, 569	17. 560	1, 713, 311. 640	
DASSAULT AVIATION SA	295	975. 000	287, 625. 000	
DANONE	54, 305	57. 580	3, 126, 881. 900	
SAFRAN SA	27, 991	125. 760	3, 520, 148. 160	
INTESA SANPAOLO	1, 437, 145	2. 389	3, 433, 339. 400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28, 325	85. 180	2, 412, 723. 500	
ACCOR SA	17, 380	33. 140	575, 973. 200	
BOUYGUES	21, 417	35. 410	758, 375. 970	
BNP PARIBAS	98, 131	55. 820	5, 477, 672. 420	
THALES SA	8, 486	86. 400	733, 190. 400	
CAPGEMINI SA	14, 202	154. 650	2, 196, 339. 300	
UNICREDIT SPA	188, 437	9. 854	1, 856, 858. 190	
NATIXIS	70, 166	4. 101	287, 750. 760	
KONINKLIJKE DSM NV	15, 326	150. 650	2, 308, 861. 900	
COMMERZBANK AG	83, 118	5. 781	480, 505. 150	
EIFFAGE	6, 848	95. 140	651, 518. 720	
FRESENIUS SE & CO KGAA	36, 634	43. 270	1, 585, 153. 180	
UNITED INTERNET	9, 882	34. 800	343, 893. 600	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5, 546	43. 640	242, 027. 440	
PUBLICIS GROUPE	19, 879	56. 280	1, 118, 790. 120	
FAURECIA	10, 774	45. 030	485, 153. 220	
IBERDROLA SA	533, 229	11. 470	6, 116, 136. 630	
ENI SPA	223, 653	10. 408	2, 327, 780. 420	
JERONIMO MARTINS	19, 517	15. 665	305, 733. 800	
KESKO OYJ-B	24, 085	26. 130	629, 341. 050	
KBC GROUPE	21, 995	66. 260	1, 457, 388. 700	
HANNOVER RUECK SE	4, 868	151. 400	737, 015. 200	
WARTSILA OYJ	34, 935	10. 825	378, 171. 370	
L' OREAL	21, 878	352. 400	7, 709, 807. 200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	24, 215	625. 000	15, 134, 375. 000	
GEA GROUP AG	13, 284	36. 410	483, 670. 440	
BOLLORE	71, 347	4. 336	309, 360. 590	
MEDIOBANCA SPA	57, 442	9. 654	554, 545. 060	
MICHELIN (CGDE) -B	14, 568	124. 200	1, 809, 345. 600	
CONTINENTAL AG	10, 336	114. 320	1, 181, 611. 520	
DEUTSCHE POST AG-REG	86, 795	51. 450	4, 465, 602. 750	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21, 206	26. 350	558, 778. 100	
OMV AG	12, 817	44. 920	575, 739. 640	
VERBUND AG	4, 559	70. 300	320, 497. 700	
PERNOD-RICARD	17, 720	174. 100	3, 085, 052. 000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	13, 577	87. 720	1, 190, 974. 440	
RENAULT SA	19, 019	35. 345	672, 226. 550	
REPSOL SA	135, 990	10. 916	1, 484, 466. 840	

REMY COINTREAU	1, 860	167. 900	312, 294. 000	
MERCK KGAA	10, 776	141. 650	1, 526, 420. 400	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	44, 634	56. 020	2, 500, 396. 680	
RWE AG	56, 755	31. 580	1, 792, 322. 900	
SEB SA	2, 439	155. 300	378, 776. 700	
SOCIETE GENERALE-A	72, 362	25. 635	1, 854, 999. 870	
VINCI S. A.	45, 541	94. 800	4, 317, 286. 800	
SODEXO	7, 429	86. 000	638, 894. 000	
SOFINA	1, 382	318. 200	439, 752. 400	
SOLVAY SA	7, 183	114. 800	824, 608. 400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46, 739	130. 920	6, 119, 069. 880	
VIVENDI SA	73, 354	30. 020	2, 202, 087. 080	
SAP SE	91, 062	115. 600	10, 526, 767. 200	
TELEFONICA S. A	455, 887	4. 067	1, 854, 092. 420	
TOTAL SE	220, 179	39. 340	8, 661, 841. 860	
VALEO	19, 653	27. 690	544, 191. 570	
E. ON SE	188, 683	10. 660	2, 011, 360. 780	
VOEST-ALPINE AG	9, 875	38. 240	377, 620. 000	
HENKEL AG & CO KGAA	8, 602	83. 000	713, 966. 000	
SIEMENS AG-REG	66, 654	143. 800	9, 584, 845. 200	
UPM-KYMMENE OYJ	46, 882	33. 190	1, 556, 013. 580	
ING GROEP NV-CVA	342, 398	11. 012	3, 770, 486. 770	
PUMA AG	8, 844	88. 980	786, 939. 120	
BAYER AG	86, 288	54. 370	4, 691, 478. 560	
STORA ENSO OYJ-R SHS	51, 891	16. 120	836, 482. 920	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15, 809	96. 480	1, 525, 252. 320	
DAIMLER AG	74, 820	73. 760	5, 518, 723. 200	
BASF SE	79, 925	70. 760	5, 655, 493. 000	
BEIERSDORF AG	8, 371	97. 020	812, 154. 420	
HOCHTIEF AG	1, 707	72. 600	123, 928. 200	
HEIDELBERGCEMENT AG	13, 238	75. 600	1, 000, 792. 800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17, 223	64. 900	1, 117, 772. 700	
ASM INTERNATIONAL NV	3, 895	255. 100	993, 614. 500	
ORANGE	184, 093	10. 600	1, 951, 385. 800	
SAMPO OYJ-A SHS	41, 326	40. 440	1, 671, 223. 440	
RANDSTAD NV	11, 017	62. 840	692, 308. 280	
ALLIANZ SE	35, 868	215. 200	7, 718, 793. 600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238, 662	4. 556	1, 087, 344. 070	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97, 453	23. 250	2, 265, 782. 250	
HERMES INTL	2, 681	1, 059. 500	2, 840, 519. 500	
ENDESA S. A.	27, 736	22. 390	621, 009. 040	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27, 990	11. 380	318, 526. 200	
ERSTE GROUP BANK AG	24, 204	31. 510	762, 668. 040	

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12, 250	247. 550	3, 032, 487. 500	
ARCELOR MITTAL (NL)	61, 594	27. 635	1, 702, 150. 190	
DASSAULT SYSTEMES SA	11, 068	185. 600	2, 054, 220. 800	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21, 734	28. 350	616, 158. 900	
HEINEKEN NV	22, 683	99. 500	2, 256, 958. 500	
AKZO NOBEL	16, 929	103. 900	1, 758, 923. 100	
ASML HOLDING NV	37, 175	525. 700	19, 542, 897. 500	
AEGON NV	150, 349	3. 975	597, 637. 270	
VOLKSWAGEN AG	2, 758	265. 800	733, 076. 400	
VOLKSWAGEN AG PFD	16, 309	211. 900	3, 455, 877. 100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	562, 809	4. 928	2, 773, 522. 750	
KERING	6, 618	704. 400	4, 661, 719. 200	
CNP ASSURANCES	13, 987	15. 520	217, 078. 240	
FORTUM OYJ	39, 409	23. 060	908, 771. 540	
AGEAS	14, 365	51. 800	744, 107. 000	
UCB SA	10, 571	76. 120	804, 664. 520	
NEMETSCHEK SE	5, 095	56. 860	289, 701. 700	
CARREFOUR SA	53, 060	16. 810	891, 938. 600	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23, 612	21. 550	508, 838. 600	
ATOS SE	8, 972	56. 040	502, 790. 880	
NOKIA OYJ	472, 892	4. 181	1, 977, 161. 450	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	79, 616	46. 640	3, 713, 290. 240	
WOLTERS KLUWER-CVA	23, 736	78. 340	1, 859, 478. 240	
SANOFI	98, 989	86. 370	8, 549, 679. 930	
STMICROELECTRONICS NV	53, 224	30. 150	1, 604, 703. 600	
ELISA OYJ	13, 642	47. 960	654, 270. 320	
BANCO SANTANDER SA	1, 518, 626	3. 306	5, 020, 577. 550	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47, 453	16. 015	759, 959. 790	
QIAGEN N.V.	20, 763	38. 940	808, 511. 220	
DEUTSCHE BANK AG-REG	171, 364	11. 566	1, 981, 996. 020	
BMW VORZUG	4, 116	70. 800	291, 412. 800	
ENEL SPA	708, 368	8. 274	5, 861, 036. 830	
COLRUYT NV	4, 673	50. 040	233, 836. 920	
VOPAK (KON.)	5, 364	38. 360	205, 763. 040	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	289, 776	16. 648	4, 824, 190. 840	
SARTORIUS AG	3, 044	428. 400	1, 304, 049. 600	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7, 686	62. 900	483, 449. 400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	114, 735	31. 550	3, 619, 889. 250	
RATIONAL AG	479	770. 000	368, 830. 000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3, 771	139. 900	527, 562. 900	
BECHTLE AG	2, 511	159. 200	399, 751. 200	
KONINKLIJKE KPN NV	288, 984	2. 819	814, 645. 890	
EUROFINS SCIENTIFIC	11, 330	81. 640	924, 981. 200	

TELEPERFORMANCE	5, 201	317. 800	1, 652, 877. 800	
DEUTSCHE BOERSE AG	16, 538	141. 350	2, 337, 646. 300	
EURAZEO	3, 007	70. 400	211, 692. 800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9, 904	91. 740	908, 592. 960	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10, 004	84. 950	849, 839. 800	
INDITEX	92, 169	31. 420	2, 895, 949. 980	
ESSILORLUXOTTICA	25, 073	139. 860	3, 506, 709. 780	
SNAM SPA	171, 294	4. 817	825, 123. 190	
CREDIT AGRICOLE SA	95, 281	13. 376	1, 274, 478. 650	
ORPEA	4, 932	105. 050	518, 106. 600	
ENAGAS	23, 477	18. 950	444, 889. 150	
WENDEL	2, 220	114. 700	254, 634. 000	
TENARIS SA	36, 959	9. 792	361, 902. 520	
TELECOM ITALIA SPA	762, 675	0. 427	325, 662. 220	
TELECOM ITALIA-RNC	497, 596	0. 464	230, 884. 540	
ATLANTIA SPA	45, 299	16. 150	731, 578. 850	
ILIAD SA	1, 046	147. 300	154, 075. 800	
PROXIMUS	13, 739	17. 505	240, 501. 190	
SES FDR	28, 847	6. 340	182, 889. 980	
TERNA SPA	126, 172	6. 184	780, 247. 640	
BIOMERIEUX	3, 248	94. 800	307, 910. 400	
GRIFOLS SA	23, 518	23. 540	553, 613. 720	
FERROVIAL SA	38, 400	24. 680	947, 712. 000	
LANXESS AG	6, 856	65. 500	449, 068. 000	
NESTE OYJ	36, 796	50. 320	1, 851, 574. 720	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17, 911	19. 330	346, 219. 630	
RECORDATI SPA	10, 303	44. 800	461, 574. 400	
GALAPAGOS NV	3, 426	59. 210	202, 853. 460	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55, 304	10. 240	566, 312. 960	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4, 873	211. 800	1, 032, 101. 400	
KONE OYJ	29, 890	67. 720	2, 024, 150. 800	
ELIA GROUP	2, 862	89. 150	255, 147. 300	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2, 387	362. 500	865, 287. 500	
ENGIE	153, 403	12. 650	1, 940, 547. 950	
ALSTOM	21, 741	46. 550	1, 012, 043. 550	
ELECTRICITE DE FRANCE	54, 778	11. 685	640, 080. 930	
IPSEN SA	3, 646	80. 060	291, 898. 760	
DEUTSCHE WOHNEN	29, 812	43. 380	1, 293, 244. 560	
ARKEMA SA	6, 393	110. 350	705, 467. 550	
LEGRAND SA	23, 806	85. 220	2, 028, 747. 320	
AMPLIFON SPA	11, 372	35. 240	400, 749. 280	
ADP	2, 313	114. 350	264, 491. 550	
ORION OYJ	8, 051	36. 610	294, 747. 110	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	10.230	410,100.240	
SYMRISE AG	11,308	106.900	1,208,825.200	
SCOR SE	15,667	27.870	436,639.290	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,870	44.420	927,045.400	
PRYSMIAN SPA	22,328	26.960	601,962.880	
DIASORIN SPA	2,223	142.650	317,110.950	
CAIXABANK	394,299	2.784	1,097,728.410	
BUREAU VERITAS SA	29,810	24.920	742,865.200	
GETLINK	37,646	13.650	513,867.900	
SUEZ SA	26,620	19.870	528,939.400	
AMADEUS IT GROUP SA	37,851	59.260	2,243,050.260	
BRENTAG SE	14,044	76.760	1,078,017.440	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	30.170	516,389.720	
EDENRED	21,488	45.980	988,018.240	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.495	245,470.570	
LEG IMMOBILIEN SE	6,537	116.250	759,926.250	
KION GROUP AG	5,903	84.820	500,692.460	
VONOVIA SE	46,966	51.240	2,406,537.840	
KNORR-BREMSE AG	6,860	104.450	716,527.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,805	47.280	1,125,500.400	
FERRARI NV	10,525	165.250	1,739,256.250	
CNH INDUSTRIAL NV	89,378	14.025	1,253,526.450	
AROUNDTOWN SA	83,054	6.676	554,468.500	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	43.950	355,643.400	
MONCLER SPA	17,567	51.740	908,916.580	
NEXI SPA	34,862	15.400	536,874.800	
TEAMVIEWER AG	13,668	33.640	459,791.520	
PROSUS NV	42,762	86.600	3,703,189.200	
JDE PEET'S BV	7,308	32.430	236,998.440	
SIEMENS ENERGY AG	35,831	25.680	920,140.080	
WORLDLINE SA	21,160	76.820	1,625,511.200	
NN GROUP NV	24,900	43.280	1,077,672.000	
FINECOBANK SPA	53,818	14.160	762,062.880	
ARGENX SE	3,705	211.900	785,089.500	
ZALANDO SE	13,525	83.780	1,133,124.500	
STELLANTIS NV	172,385	15.100	2,603,013.500	
AENA SME SA	6,256	144.850	906,181.600	
CELLNEX TELECOM SAU	38,983	47.020	1,832,980.660	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	80.000	866,880.000	
ABN AMRO BANK NV	34,251	11.168	382,515.160	
EXOR NV	9,966	69.160	689,248.560	
SCOUT24 AG	9,670	69.400	671,098.000	
COVESTRO AG	16,337	58.660	958,328.420	
HELLOFRESH SE	12,838	64.160	823,686.080	

	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	66,475	62.080	4,126,768.000	
	POSTE ITALIANE SPA	38,953	11.225	437,247.420	
	AMUNDI SA	5,924	76.800	454,963.200	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.514	222,094.810	
	ADYEN NV	1,605	1,840.000	2,953,200.000	
	UNIPER SE	18,203	30.500	555,191.500	
	DELIVERY HERO SE	11,565	117.550	1,359,465.750	
ユーロ 小計		16,338,141		405,473,670.760 (53,591,455,064)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	112.500	3,701,250.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	20.250	3,321,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.020	1,663,837.200	
	CLP HOLDINGS LTD	135,000	80.350	10,847,250.000	
	PCCW LTD	331,000	4.650	1,539,150.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	49.900	2,470,050.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	105,940	456.000	48,308,640.000	
	MTR CORP	126,000	44.600	5,619,600.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	162.500	10,676,250.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	36.000	4,156,200.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	103,500	50.500	5,226,750.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	914,292	13.520	12,361,227.840	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	197,000	67.350	13,267,950.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	29.500	9,366,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	120,066	42.350	5,084,795.100	
	SINO LAND CO	255,400	12.000	3,064,800.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,500	119.800	14,435,900.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	63.400	3,138,300.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	121,000	150.100	18,162,100.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	28.150	4,672,900.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.040	1,410,240.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	13.680	1,701,792.000	
	AIA GROUP LTD	1,058,227	101.900	107,833,331.300	
	HKT TRUST / HKT LTD	262,000	11.460	3,002,520.000	
	SANDS CHINA LTD	211,200	34.950	7,381,440.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	22.900	2,386,180.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	47.150	7,060,712.500	
	ESR CAYMAN LTD	147,400	24.800	3,655,520.000	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.940	1,826,200.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	26.250	3,953,250.000	
	WH GROUP LTD	897,000	6.850	6,144,450.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	242,332	65.750	15,933,329.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	50.500	11,354,016.000	
香港・ドル 小計		7,552,049		354,727,180.940 (4,976,822,349)	
合計		95,313,522		487,946,726,780 (487,946,726,780)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	81,526.000	835,641.500	
		GOODMAN GROUP	148,357.000	2,897,412.210	
		GPT GROUP	158,232.000	727,867.200	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	925,664.580	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,319,880.000	
		STOCKLAND	194,018.000	904,123.880	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	574,293.490	
	オーストラリア・ドル 小計		1,768,512.000	8,184,882.860 (698,006,811)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	880,744.060	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	369,636.000	779,931.960	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	401,907.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	534,798.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	288,150.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,316,742.000	2,885,531.020 (237,046,373)	
投資信託受益証券 合計			3,085,254	935,053,184 (935,053,184)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	841,391.840	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,124.000	1,992,753.360	
		AMERICAN TOWER CORP	38,783.000	9,642,229.460	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,164,613.670	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,329.000	2,428,689.710	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,947.000	1,400,994.870	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,873.000	1,093,774.710	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	37,704.000	6,906,995.760	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	23,841.000	3,600,706.230	
	DUKE REALTY TRUST	31,929.000	1,472,565.480	
	EQUINIX INC	7,807.000	5,621,040.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,554.000	1,091,890.800	
	EQUITY RESIDENTIAL	32,922.000	2,455,981.200	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,750.000	1,675,320.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	11,470.000	1,695,724.800	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	46,799.000	1,568,234.490	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,094,218.720	
	INVITATION HOMES INC	50,074.000	1,761,102.580	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	1,028,149.710	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,159,086.500	
	MID AMERICA	10,200.000	1,625,676.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	728,417.850	
	PROLOGIS INC	64,584.000	7,504,660.800	
	PUBLIC STORAGE	13,279.000	3,680,407.640	
	REALTY INCOME CORP	30,906.000	2,087,391.240	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	948,669.570	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,838.000	2,873,286.280	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,753.000	3,644,442.750	
	SUN COMMUNITIES INC	9,670.000	1,605,026.600	
	UDR INC	26,674.000	1,244,608.840	
	VENTAS INC	30,905.000	1,697,611.650	
	VEREIT INC	19,960.000	928,539.200	
	VICI PROPERTIES INC	48,258.000	1,509,510.240	
	VORNADO REALTY TRUST	13,610.000	633,001.100	
	WELLTOWER INC	36,680.000	2,725,690.800	
	WEYERHAEUSER CO	62,330.000	2,542,440.700	
	WP CAREY INC	15,529.000	1,165,140.870	
アメリカ・ドル 小計		1,119,617.000	86,839,986.020 (9,464,690,076)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	380,373.910	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	419,157.550	
	SEGRO PLC	100,188.000	1,020,414.780	
イギリス・ポンド 小計		225,850.000	1,819,946.240 (279,962,330)	

	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8, 220. 000	464, 923. 200	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13, 467. 000	285, 365. 730	
	カナダ・ドル 小計		21, 687. 000	750, 288. 930 (67, 518, 501)	
	ユーロ	COVIVIO	4, 663. 000	362, 408. 360	
		GECINA SA	3, 670. 000	478, 201. 000	
		KLEPIERRE	17, 099. 000	407, 640. 160	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12, 920. 000	950, 007. 600	
	ユーロ 小計		38, 352. 000	2, 198, 257. 120 (290, 543, 644)	
	香港・ドル	LINK REIT	183, 000. 000	13, 752, 450. 000	
	香港・ドル 小計		183, 000. 000	13, 752, 450. 000 (192, 946, 874)	
投資証券 合計			1, 588, 506	10, 295, 661, 425 (10, 295, 661, 425)	
合計				11, 230, 714, 609 (11, 230, 714, 609)	

(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 591銘柄	67.61	—	—	71.64
	投資証券 37銘柄	—	—	1.84	
イギリス・ポンド	株式 85銘柄	4.62	—	—	4.82
	投資証券 3銘柄	—	—	0.05	
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	0.10	—	—	0.11
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	2.17	—	—	2.38
	投資信託受益証券 7銘柄	—	0.14	—	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.47	—	—	3.59
	投資証券 2銘柄	—	—	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.29	—	—	0.35
	投資信託受益証券 5銘柄	—	0.05	—	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.91	—	—	3.00
スウェーデン・クローナ	株式 39銘柄	1.16	—	—	1.20
デンマーク・クローネ	株式 19銘柄	0.78	—	—	0.80
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08	—	—	0.08
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.20	—	—	0.20
ユーロ	株式 233銘柄	10.41	—	—	10.79

	投資証券	4銘柄	—	—	0.06	
香港・ドル	株式	33銘柄	0.97	—	—	1.04
	投資証券	1銘柄	—	—	0.04	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,694,408,640
国債証券	296,264,497,800
地方債証券	18,222,680,500
特殊債券	17,090,056,082
社債券	12,590,441,180
未収利息	448,447,524
前払費用	83,213,760
流動資産合計	347,393,745,486
資産合計	347,393,745,486
負債の部	
流動負債	
未払金	35,509,888,000
未払解約金	2,728,840,000
流動負債合計	38,238,728,000
負債合計	38,238,728,000
純資産の部	
元本等	
元本	236,574,874,490
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	72,580,142,996
元本等合計	309,155,017,486
純資産合計	309,155,017,486
負債純資産合計	347,393,745,486

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月12日
	至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	203,797,769,973円
同期中追加設定元本額	115,061,682,443円
同期中一部解約元本額	82,284,577,926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	22,838,915,573円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	74,200,842円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	66,948,042円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	14,730,710円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	739,041,315円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	158,106,666円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	20,854,960円
たわらノーロード 国内債券	13,806,034,198円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,640,150,170円
たわらノーロード バランス（堅実型）	572,254,828円
たわらノーロード バランス（標準型）	948,708,643円
たわらノーロード バランス（積極型）	115,047,383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）	44,338,367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）	935,108,076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）	991,498,707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）	317,829,147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）	115,263,936円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	14,213,615円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	8,109,601円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	24,787,753円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,775,900円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	3,140,662円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,474,300,641円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	8,249,291,538円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	11,127,604,818円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	4,478,898,620円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,030,775,409円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,183,888,352円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	343,240,718円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	92,027,879円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,946,750,943円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	13, 176, 727円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	3, 966, 351, 618円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	1, 316, 712, 571円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	273, 618, 300円
投資のソムリエ	27, 922, 615, 836円
クルーズコントロール	1, 057, 244, 764円
投資のソムリエ＜DC年金＞	1, 509, 313, 799円
D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	3, 863, 263, 512円
4資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	513, 980, 714円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	4, 123, 956円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	10, 270, 569円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	2, 915, 486, 723円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	31, 728, 896, 881円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	18, 302, 937円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	8, 642, 753円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	28, 552, 132円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	43, 474, 768円
4資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	723, 736, 337円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1, 540, 875, 892円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	4, 796, 362, 446円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	10, 472, 529円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	5, 223, 553円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	5, 389, 711円
4資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	40, 074, 227円
D I A Mエマージング債券ファンド	9, 450, 010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）	813, 731, 222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）	997, 353, 860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, 428, 088, 715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）	505, 583, 737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）	797, 014, 655円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ2021-04（適格機関投資家限定）	369, 455, 815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）	7, 790, 486, 396円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1, 431, 805, 359円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	623, 508, 550円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	313, 258, 044円
O n e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）	6, 464, 550, 464円
O n e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）	6, 440, 455, 834円
O n e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）	6, 535, 191, 474円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅤ（適格機関投資家限定）	6, 542, 790, 980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, 328, 998, 612円

D I A M グローバル・バランスファンド 2 5 V A (適格機関投資家限定)	184, 626, 342円
D I A M グローバル・バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限定)	103, 868, 536円
D I A M 国際分散バランスファンド 3 0 V A (適格機関投資家限定)	42, 844, 846円
D I A M 国際分散バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限定)	112, 226, 822円
D I A M 国内重視バランスファンド 3 0 V A (適格機関投資家限定)	45, 778, 227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)	6, 398, 308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)	50, 584, 248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)	139, 080, 024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)	4, 037, 195, 129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)	2, 474, 158, 089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)	4, 707, 386, 341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)	355, 738, 449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)	206, 761, 577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)	2, 457, 672, 626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)	219, 009, 558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)	11, 338, 296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)	2, 770, 742, 014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)	56, 048, 903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)	445, 303, 489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)	710, 153, 511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)	1, 175, 955, 438円
D I A M 世界バランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	335, 769, 441円
D I A M 国内バランス 3 0 V A (適格機関投資家限定)	106, 753, 765円
O n e コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド I (適格機関投資家限定)	1, 348, 346, 339円
コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	382, 409, 178円
計	236, 574, 874, 490円
2. 受益権の総数	236, 574, 874, 490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 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	670,278,400
地方債証券	324,500
特殊債券	2,588,383
社債券	△7,394,440
合計	665,796,843

(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(2021年2月16日から2021年5月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.3068円
(1万口当たり純資産額)	(13,068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

2021年5月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 1 4 回 利付国庫債券 (2年)	1,000,000,000	1,002,730,000	
	4 1 5 回 利付国庫債券 (2年)	700,000,000	702,051,000	
	4 1 6 回 利付国庫債券 (2年)	1,270,000,000	1,273,987,800	
	4 1 7 回 利付国庫債券 (2年)	2,400,000,000	2,408,016,000	
	4 1 9 回 利付国庫債券 (2年)	600,000,000	602,244,000	
	4 2 0 回 利付国庫債券 (2年)	4,300,000,000	4,316,598,000	
	4 2 1 回 利付国庫債券 (2年)	540,000,000	542,192,400	
	4 2 2 回 利付国庫債券 (2年)	1,200,000,000	1,205,304,000	
	4 2 3 回 利付国庫債券 (2年)	2,000,000,000	2,005,480,000	
	1 3 2 回 利付国庫債券 (5年)	2,500,000,000	2,506,225,000	
	1 3 3 回 利付国庫債券 (5年)	1,980,000,000	1,986,058,800	
	1 3 4 回 利付国庫債券 (5年)	1,690,000,000	1,696,253,000	
	1 3 5 回 利付国庫債券 (5年)	1,840,000,000	1,848,022,400	
	1 3 6 回 利付国庫債券 (5年)	1,250,000,000	1,256,200,000	
	1 3 7 回 利付国庫債券 (5年)	1,400,000,000	1,407,952,000	
	1 3 8 回 利付国庫債券 (5年)	4,350,000,000	4,377,883,500	
	1 3 9 回 利付国庫債券 (5年)	2,920,000,000	2,940,498,400	
	1 4 0 回 利付国庫債券 (5年)	1,690,000,000	1,702,641,200	
	1 4 1 回 利付国庫債券 (5年)	2,960,000,000	2,983,443,200	

1 4 2 回 利付国庫債券（5年）	2,820,000,000	2,843,490,600	
1 4 3 回 利付国庫債券（5年）	1,900,000,000	1,916,929,000	
1 4 4 回 利付国庫債券（5年）	3,050,000,000	3,078,944,500	
1 4 5 回 利付国庫債券（5年）	2,900,000,000	2,928,594,000	
1 4 6 回 利付国庫債券（5年）	3,000,000,000	3,029,160,000	
1 4 7 回 利付国庫債券（5年）	1,400,000,000	1,407,168,000	
2 回 利付国庫債券（4 0年）	480,000,000	676,200,000	
3 回 利付国庫債券（4 0年）	290,000,000	410,692,200	
4 回 利付国庫債券（4 0年）	750,000,000	1,067,340,000	
5 回 利付国庫債券（4 0年）	700,000,000	963,921,000	
6 回 利付国庫債券（4 0年）	670,000,000	909,009,100	
7 回 利付国庫債券（4 0年）	730,000,000	954,307,100	
8 回 利付国庫債券（4 0年）	820,000,000	1,003,179,800	
9 回 利付国庫債券（4 0年）	1,220,000,000	1,120,582,200	
1 0 回 利付国庫債券（4 0年）	1,200,000,000	1,290,984,000	
1 1 回 利付国庫債券（4 0年）	850,000,000	887,901,500	
1 2 回 利付国庫債券（4 0年）	850,000,000	802,723,000	
1 3 回 利付国庫債券（4 0年）	940,000,000	886,626,800	
3 2 3 回 利付国庫債券（1 0年）	1,100,000,000	1,112,496,000	
3 2 4 回 利付国庫債券（1 0年）	2,250,000,000	2,273,062,500	
3 2 5 回 利付国庫債券（1 0年）	1,700,000,000	1,721,403,000	
3 2 6 回 利付国庫債券（1 0年）	500,000,000	506,645,000	
3 2 7 回 利付国庫債券（1 0年）	1,200,000,000	1,217,880,000	
3 2 8 回 利付国庫債券（1 0年）	1,860,000,000	1,885,240,200	

3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 570, 000, 000	3, 640, 507, 500	
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 550, 000, 000	3, 628, 952, 000	
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	650, 000, 000	661, 381, 500	
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 860, 000, 000	2, 915, 398, 200	
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 650, 000, 000	3, 727, 927, 500	
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 480, 000, 000	3, 560, 353, 200	
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 140, 000, 000	3, 207, 258, 800	
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1, 060, 000, 000	1, 084, 199, 800	
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 840, 000, 000	2, 884, 247, 200	
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 430, 000, 000	3, 500, 417, 900	
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 340, 000, 000	3, 413, 079, 200	
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 650, 000, 000	3, 733, 950, 000	
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 310, 000, 000	3, 373, 618, 200	
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 280, 000, 000	3, 312, 800, 000	
3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 280, 000, 000	3, 312, 800, 000	
3 4 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 880, 000, 000	2, 909, 462, 400	
3 4 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 110, 000, 000	3, 142, 406, 200	
3 4 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 670, 000, 000	3, 708, 828, 600	
3 4 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 810, 000, 000	2, 840, 151, 300	
3 4 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 680, 000, 000	2, 709, 078, 000	
3 4 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 760, 000, 000	2, 790, 222, 000	
3 5 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	3, 700, 000, 000	3, 740, 737, 000	
3 5 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 660, 000, 000	2, 687, 477, 800	
3 5 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	2, 620, 000, 000	2, 646, 095, 200	

3 5 3 回 利付国庫債券 (10年)	2,440,000,000	2,463,228,800	
3 5 4 回 利付国庫債券 (10年)	2,570,000,000	2,593,232,800	
3 5 5 回 利付国庫債券 (10年)	2,420,000,000	2,440,594,200	
3 5 6 回 利付国庫債券 (10年)	2,180,000,000	2,197,287,400	
3 5 7 回 利付国庫債券 (10年)	2,260,000,000	2,276,498,000	
3 5 8 回 利付国庫債券 (10年)	2,300,000,000	2,315,226,000	
3 5 9 回 利付国庫債券 (10年)	3,060,000,000	3,078,054,000	
3 6 0 回 利付国庫債券 (10年)	3,190,000,000	3,206,332,800	
3 6 1 回 利付国庫債券 (10年)	2,600,000,000	2,609,932,000	
3 6 2 回 利付国庫債券 (10年)	600,000,000	601,758,000	
1 回 利付国庫債券 (30 年)	100,000,000	123,250,000	
2 回 利付国庫債券 (30 年)	100,000,000	120,855,000	
4 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	254,160,000	
6 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	248,172,000	
8 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	238,080,000	
1 1 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	237,002,000	
1 2 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	247,322,000	
1 3 回 利付国庫債券 (30 年)	100,000,000	122,740,000	
1 4 回 利付国庫債券 (30 年)	290,000,000	371,585,700	
1 5 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	259,746,000	
1 6 回 利付国庫債券 (30 年)	150,000,000	195,396,000	
1 7 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	258,632,000	
1 8 回 利付国庫債券 (30 年)	320,000,000	410,592,000	
1 9 回 利付国庫債券 (30 年)	200,000,000	257,270,000	

2 0 回 利付国庫債券（3 0 年）	200, 000, 000	263, 654, 000	
2 1 回 利付国庫債券（3 0 年）	200, 000, 000	258, 694, 000	
2 2 回 利付国庫債券（3 0 年）	220, 000, 000	291, 733, 200	
2 3 回 利付国庫債券（3 0 年）	200, 000, 000	265, 892, 000	
2 4 回 利付国庫債券（3 0 年）	190, 000, 000	253, 230, 100	
2 5 回 利付国庫債券（3 0 年）	200, 000, 000	261, 198, 000	
2 6 回 利付国庫債券（3 0 年）	400, 000, 000	529, 940, 000	
2 7 回 利付国庫債券（3 0 年）	420, 000, 000	565, 849, 200	
2 8 回 利付国庫債券（3 0 年）	480, 000, 000	649, 939, 200	
2 9 回 利付国庫債券（3 0 年）	560, 000, 000	752, 169, 600	
3 0 回 利付国庫債券（3 0 年）	570, 000, 000	759, 331, 200	
3 1 回 利付国庫債券（3 0 年）	460, 000, 000	606, 799, 800	
3 2 回 利付国庫債券（3 0 年）	610, 000, 000	818, 217, 400	
3 3 回 利付国庫債券（3 0 年）	730, 000, 000	943, 247, 600	
3 4 回 利付国庫債券（3 0 年）	820, 000, 000	1, 094, 511, 400	
3 5 回 利付国庫債券（3 0 年）	1, 300, 000, 000	1, 693, 159, 000	
3 6 回 利付国庫債券（3 0 年）	1, 450, 000, 000	1, 894, 744, 000	
3 7 回 利付国庫債券（3 0 年）	1, 290, 000, 000	1, 665, 841, 500	
3 8 回 利付国庫債券（3 0 年）	990, 000, 000	1, 262, 210, 400	
3 9 回 利付国庫債券（3 0 年）	910, 000, 000	1, 181, 243, 700	
4 0 回 利付国庫債券（3 0 年）	700, 000, 000	894, 698, 000	
4 1 回 利付国庫債券（3 0 年）	900, 000, 000	1, 133, 181, 000	
4 2 回 利付国庫債券（3 0 年）	810, 000, 000	1, 020, 875, 400	
4 3 回 利付国庫債券（3 0 年）	820, 000, 000	1, 034, 536, 600	

4 4 回 利付国庫債券（3 0 年）	890,000,000	1,123,954,300	
4 5 回 利付国庫債券（3 0 年）	880,000,000	1,073,749,600	
4 6 回 利付国庫債券（3 0 年）	1,050,000,000	1,281,976,500	
4 7 回 利付国庫債券（3 0 年）	810,000,000	1,008,190,800	
4 8 回 利付国庫債券（3 0 年）	910,000,000	1,091,390,300	
4 9 回 利付国庫債券（3 0 年）	900,000,000	1,079,847,000	
5 0 回 利付国庫債券（3 0 年）	810,000,000	858,972,600	
5 1 回 利付国庫債券（3 0 年）	820,000,000	773,063,200	
5 2 回 利付国庫債券（3 0 年）	980,000,000	968,014,600	
5 3 回 利付国庫債券（3 0 年）	700,000,000	707,056,000	
5 4 回 利付国庫債券（3 0 年）	800,000,000	846,224,000	
5 5 回 利付国庫債券（3 0 年）	700,000,000	739,949,000	
5 6 回 利付国庫債券（3 0 年）	920,000,000	971,823,600	
5 7 回 利付国庫債券（3 0 年）	790,000,000	833,900,300	
5 8 回 利付国庫債券（3 0 年）	1,070,000,000	1,128,625,300	
5 9 回 利付国庫債券（3 0 年）	680,000,000	699,930,800	
6 0 回 利付国庫債券（3 0 年）	660,000,000	711,546,000	
6 1 回 利付国庫債券（3 0 年）	860,000,000	882,454,600	
6 2 回 利付国庫債券（3 0 年）	800,000,000	779,040,000	
6 3 回 利付国庫債券（3 0 年）	870,000,000	823,194,000	
6 4 回 利付国庫債券（3 0 年）	840,000,000	793,514,400	
6 5 回 利付国庫債券（3 0 年）	710,000,000	669,601,000	
6 6 回 利付国庫債券（3 0 年）	720,000,000	677,908,800	
6 7 回 利付国庫債券（3 0 年）	890,000,000	883,431,800	

6 8 回 利付国庫債券（3 0 年）	910, 000, 000	902, 110, 300	
6 9 回 利付国庫債券（3 0 年）	900, 000, 000	915, 714, 000	
7 0 回 利付国庫債券（3 0 年）	500, 000, 000	508, 155, 000	
7 2 回 利付国庫債券（2 0 年）	350, 000, 000	376, 393, 500	
7 3 回 利付国庫債券（2 0 年）	340, 000, 000	366, 251, 400	
7 5 回 利付国庫債券（2 0 年）	140, 000, 000	152, 065, 200	
7 8 回 利付国庫債券（2 0 年）	190, 000, 000	205, 882, 100	
8 1 回 利付国庫債券（2 0 年）	240, 000, 000	262, 293, 600	
8 5 回 利付国庫債券（2 0 年）	440, 000, 000	487, 220, 800	
8 8 回 利付国庫債券（2 0 年）	350, 000, 000	393, 015, 000	
9 0 回 利付国庫債券（2 0 年）	300, 000, 000	336, 993, 000	
9 2 回 利付国庫債券（2 0 年）	870, 000, 000	977, 114, 400	
9 3 回 利付国庫債券（2 0 年）	250, 000, 000	280, 587, 500	
9 4 回 利付国庫債券（2 0 年）	450, 000, 000	507, 703, 500	
9 5 回 利付国庫債券（2 0 年）	350, 000, 000	400, 995, 000	
9 7 回 利付国庫債券（2 0 年）	500, 000, 000	572, 495, 000	
9 9 回 利付国庫債券（2 0 年）	450, 000, 000	514, 656, 000	
1 0 0 回 利付国庫債券（2 0 年）	600, 000, 000	693, 330, 000	
1 0 2 回 利付国庫債券（2 0 年）	360, 000, 000	422, 751, 600	
1 0 5 回 利付国庫債券（2 0 年）	400, 000, 000	463, 004, 000	
1 0 6 回 利付国庫債券（2 0 年）	350, 000, 000	407, 711, 500	
1 0 7 回 利付国庫債券（2 0 年）	400, 000, 000	464, 792, 000	
1 0 8 回 利付国庫債券（2 0 年）	400, 000, 000	458, 692, 000	
1 0 9 回 利付国庫債券（2 0 年）	220, 000, 000	253, 129, 800	

1 1 0 回 利付国庫債券 (20年)	330,000,000	384,885,600	
1 1 1 回 利付国庫債券 (20年)	290,000,000	341,857,800	
1 1 2 回 利付国庫債券 (20年)	550,000,000	643,890,500	
1 1 3 回 利付国庫債券 (20年)	770,000,000	904,780,800	
1 1 4 回 利付国庫債券 (20年)	550,000,000	648,582,000	
1 1 5 回 利付国庫債券 (20年)	200,000,000	237,568,000	
1 1 6 回 利付国庫債券 (20年)	320,000,000	381,491,200	
1 1 7 回 利付国庫債券 (20年)	650,000,000	769,164,500	
1 1 8 回 利付国庫債券 (20年)	310,000,000	365,462,100	
1 1 9 回 利付国庫債券 (20年)	300,000,000	348,225,000	
1 2 0 回 利付国庫債券 (20年)	400,000,000	457,032,000	
1 2 1 回 利付国庫債券 (20年)	540,000,000	633,646,800	
1 2 2 回 利付国庫債券 (20年)	350,000,000	407,435,000	
1 2 3 回 利付国庫債券 (20年)	650,000,000	777,042,500	
1 2 4 回 利付国庫債券 (20年)	390,000,000	462,497,100	
1 2 5 回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	435,261,600	
1 2 6 回 利付国庫債券 (20年)	340,000,000	404,419,800	
1 2 7 回 利付国庫債券 (20年)	520,000,000	613,433,600	
1 2 8 回 利付国庫債券 (20年)	1,020,000,000	1,206,721,200	
1 2 9 回 利付国庫債券 (20年)	590,000,000	692,087,700	
1 3 0 回 利付国庫債券 (20年)	1,080,000,000	1,270,188,000	
1 3 1 回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	699,498,000	
1 3 2 回 利付国庫債券 (20年)	820,000,000	958,219,200	
1 3 3 回 利付国庫債券 (20年)	790,000,000	931,457,400	

1 3 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 030, 000, 000	1, 217, 367, 300	
1 3 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	350, 000, 000	409, 913, 000	
1 3 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	440, 000, 000	510, 598, 000	
1 3 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	750, 000, 000	880, 365, 000	
1 3 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	780, 000, 000	898, 466, 400	
1 3 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	850, 000, 000	988, 422, 500	
1 4 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 490, 000, 000	1, 753, 804, 500	
1 4 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 250, 000, 000	1, 474, 412, 500	
1 4 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	900, 000, 000	1, 071, 873, 000	
1 4 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 260, 000, 000	1, 474, 515, 000	
1 4 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	930, 000, 000	1, 077, 488, 700	
1 4 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 410, 000, 000	1, 670, 864, 100	
1 4 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 550, 000, 000	1, 840, 392, 500	
1 4 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 580, 000, 000	1, 860, 039, 200	
1 4 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 390, 000, 000	1, 622, 560, 900	
1 4 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 630, 000, 000	1, 905, 502, 600	
1 5 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 530, 000, 000	1, 771, 189, 200	
1 5 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 510, 000, 000	1, 710, 029, 700	
1 5 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 570, 000, 000	1, 779, 249, 600	
1 5 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 470, 000, 000	1, 687, 207, 200	
1 5 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 530, 000, 000	1, 736, 274, 600	
1 5 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 530, 000, 000	1, 694, 107, 800	
1 5 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 240, 000, 000	1, 264, 824, 800	
1 5 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 250, 000, 000	1, 236, 400, 000	

	1 5 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 480, 000, 000	1, 527, 937, 200	
	1 5 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 450, 000, 000	1, 518, 251, 500	
	1 6 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 080, 000, 000	1, 146, 247, 200	
	1 6 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 150, 000, 000	1, 202, 083, 500	
	1 6 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 320, 000, 000	1, 378, 515, 600	
	1 6 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 070, 000, 000	1, 116, 363, 100	
	1 6 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 460, 000, 000	1, 498, 427, 200	
	1 6 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 090, 000, 000	1, 117, 282, 700	
	1 6 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 150, 000, 000	1, 215, 860, 500	
	1 6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 250, 000, 000	1, 277, 912, 500	
	1 6 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 150, 000, 000	1, 154, 807, 000	
	1 6 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 150, 000, 000	1, 132, 485, 500	
	1 7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 220, 000, 000	1, 199, 125, 800	
	1 7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 060, 000, 000	1, 039, 838, 800	
	1 7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 060, 000, 000	1, 057, 212, 200	
	1 7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 320, 000, 000	1, 314, 165, 600	
	1 7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 300, 000, 000	1, 293, 019, 000	
	1 7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1, 300, 000, 000	1, 316, 445, 000	
	1 7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	500, 000, 000	505, 935, 000	
国債証券 合計		278, 280, 000, 000	296, 264, 497, 800	
地方債証券	7 0 8 回 東京都公募公債	500, 000, 000	504, 885, 000	
	7 2 0 回 東京都公募公債	300, 000, 000	305, 442, 000	
	7 2 6 回 東京都公募公債	400, 000, 000	407, 516, 000	
	8 0 2 回 東京都公募公債	400, 000, 000	400, 000, 000	
	1 回 東京都公募公債 3 0 年	200, 000, 000	247, 094, 000	
	1 4 回 東京都公募公債 3 0 年	100, 000, 000	130, 990, 000	

5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,097,000	
9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	224,516,000	
10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	336,804,000	
30年度14回 北海道公募公債	300,000,000	302,178,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	99,952,000	
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	249,650,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	303,774,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	305,043,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	355,998,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	117,171,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	303,189,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	306,093,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	200,186,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	233,528,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	102,477,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	355,883,500	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,344,000	
1回 兵庫県公募公債 (12年)	300,000,000	310,122,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	325,830,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	212,596,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	109,455,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	349,446,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	305,205,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	182,880,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	200,232,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	102,192,000	

2 6 年度 5 回 埼玉県公募公債	400,000,000	407,728,000	
6 回 埼玉県公募公債 3 0 年	200,000,000	215,386,000	
1 4 回 埼玉県公募公債 2 0 年	300,000,000	348,720,000	
2 5 年度 1 1 回 福岡県公募公債	200,000,000	203,826,000	
3 0 年度 6 回 福岡県公募公債	200,000,000	201,754,000	
2 4 年度 2 回 福岡県公募公債 (2 0 年)	300,000,000	347,418,000	
2 4 年度 7 回 千葉県公募公債	300,000,000	303,537,000	
2 5 年度 5 回 千葉県公募公債	200,000,000	203,800,000	
1 4 回 千葉県公募公債 2 0 年	100,000,000	110,602,000	
1 8 回 千葉県公募公債 2 0 年	100,000,000	111,358,000	
5 回 群馬県公募公債 2 0 年	100,000,000	116,154,000	
1 1 1 回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	706,909,000	
1 1 9 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,075,000	
1 2 1 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,475,000	
1 2 8 回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,950,000	
1 4 2 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,210,000	
1 4 4 回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	407,132,000	
1 4 6 回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,760,000	
1 4 8 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,415,000	
1 6 6 回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,700,000	
2 9 年度 4 回 大阪市公募公債	200,000,000	201,140,000	
4 8 8 回 名古屋市公募公債 1 0 年	450,000,000	458,892,000	
4 回 京都市公募公債 2 0 年	100,000,000	113,230,000	
2 4 年度 1 2 回 神戸市公募公債	200,000,000	233,998,000	

	30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	303,930,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	407,636,000	
	2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	129,653,000	
	25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	203,332,000	
	第91回 川崎市公募公債	200,000,000	201,610,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	116,020,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	209,136,000	
	29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	207,078,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	303,348,000	
地方債証券 合計		17,400,000,000	18,222,680,500	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	216,282,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	214,698,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,530,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,183,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	221,890,500	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	270,484,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	707,490,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	101,656,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	111,554,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	196,678,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	103,573,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	579,465,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,460,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	509,365,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	336,642,900	
	239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	335,109,000	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,565,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	235,748,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	805,480,000	

3 1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,118,000	
4 1 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	198,708,000	
2 8 回 日本道路・機構承継債	400,000,000	524,556,000	
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	229,338,000	
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,068,000	
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	352,014,000	
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	233,644,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	232,258,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	405,760,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,855,000	
5 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	552,829,160	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,352,000	
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	225,550,000	
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,484,000	
1 5 回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	232,218,000	
1 0 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	213,320,000	
1 6 5 回 都市再生機構債券	100,000,000	99,518,000	
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	112,346,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	232,930,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	414,809,500	
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	319,345,000	
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,040,000	
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,024,000	
6 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,577,000	33,084,549	
8 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	22,974,000	23,485,401	

	9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	34,557,000	35,330,040	
	2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	36,660,000	37,760,533	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,234,000	12,633,562	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,148,000	48,328,114	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,397,000	36,505,634	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,070,000	59,486,327	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,860,000	132,765,534	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,928,000	204,218,146	
	1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	239,331,000	240,417,562	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	252,222,000	254,860,242	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	252,402,000	254,870,491	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,671,000	258,898,904	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	257,124,000	259,443,258	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,614,000	269,215,725	
	い第 8 2 8 号 利付商工債	100,000,000	100,243,000	
	3 6 9 回 利附信金中金債 (5 年)	400,000,000	400,256,000	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	116,330,000	
	7 2 回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,242,000	
	8 5 回 中日本高速道路債券	300,000,000	300,198,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	507,725,000	
	9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,820,000	
特殊債券 合計		16,041,769,000	17,090,056,082	
社債券	1 回 B P C E S A 円貨社債 (ソーシャルボンド)	200,000,000	200,004,000	
	6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	204,134,000	
	2 7 回 首都高速道路社債	300,000,000	300,066,000	
	3 7 回 成田国際空港社債	100,000,000	97,366,000	
	3 3 回 西日本高速道路債券	300,000,000	302,835,000	
	3 4 回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,694,000	
	1 4 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,900,000	

30回 東レ社債	300,000,000	301,272,000	
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,618,000	
6回 JXホールディングス社債	100,000,000	102,228,000	
14回 ブリヂストン社債	200,000,000	201,194,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	199,700,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,350,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,450,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	101,476,000	
47回 住友商事社債	100,000,000	101,820,000	
48回 クレディセゾン社債	100,000,000	102,315,000	
57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	206,284,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,152,000	
10回 セブン銀行社債	100,000,000	101,305,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	302,268,000	
18回 NTTファイナンス社債	200,000,000	202,164,000	
47回 日立キャピタル社債	200,000,000	202,966,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,958,000	
56回 三菱UFJリース社債	200,000,000	203,040,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	107,275,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	200,882,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	107,559,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	100,682,000	
21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,722,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	324,405,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	217,682,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	235,448,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,044,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,616,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,265,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,718,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,068,000	
11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	305,460,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	210,358,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,174,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	133,866,000	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	98,586,000	
30回 光通信社債	200,000,000	201,594,000	
518回 中部電力社債	200,000,000	200,494,000	

	5 0 8 回 関西電力社債	300,000,000	304,317,000	
	3 7 7 回 中国電力社債	400,000,000	409,796,000	
	3 0 1 回 北陸電力社債	100,000,000	102,049,000	
	3 0 7 回 北陸電力社債	100,000,000	104,653,000	
	4 7 1 回 東北電力社債	400,000,000	411,560,000	
	5 2 5 回 東北電力社債	200,000,000	200,254,000	
	2 5 3 回 四国電力社債	200,000,000	204,040,000	
	4 2 4 回 九州電力社債	200,000,000	205,922,000	
	4 2 6 回 九州電力社債	400,000,000	411,124,000	
	3 2 1 回 北海道電力社債	161,000,000	165,569,180	
	3 4 0 回 北海道電力社債	300,000,000	304,668,000	
	3 5 0 回 北海道電力社債	200,000,000	204,414,000	
	1 3 回 電源開発社債	200,000,000	215,766,000	
	3 8 回 電源開発社債	300,000,000	307,152,000	
	2 3 回 東京瓦斯社債	300,000,000	306,141,000	
	4 1 回 東京瓦斯社債	200,000,000	202,758,000	
	1 8 回 大阪ガス社債	100,000,000	102,335,000	
	2 7 回 N T T データ社債	100,000,000	101,662,000	
	7 回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	202,804,000	
社債券 合計		12,281,000,000	12,590,441,180	
合計			344,167,675,562	

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)

2021年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	1,053,432,569
コール・ローン	386,726,053
国債証券	137,325,916,911
未収利息	852,027,401
前払費用	53,580,963
流動資産合計	139,671,683,897
資産合計	139,671,683,897
負債の部	
流動負債	
未払金	163,626,775
未払解約金	114,979,000
流動負債合計	278,605,775
負債合計	278,605,775
純資産の部	
元本等	
元本	68,771,080,570
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	70,621,997,552
元本等合計	139,393,078,122
純資産合計	139,393,078,122
負債純資産合計	139,671,683,897

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	65,576,203,214円
同期中追加設定元本額	12,929,395,251円
同期中一部解約元本額	9,734,517,895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	7,633,897,075円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,449,860円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	17,623,749円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	14,470,613円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	64,472,243円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	41,203,277円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	20,590,356円
たわらノーロード 先進国債券	10,565,017,705円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	189,088,059円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,102,482,870円
たわらノーロード バランス（堅実型）	31,161,900円
たわらノーロード バランス（標準型）	148,200,972円
たわらノーロード バランス（積極型）	29,682,179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）	4,929,414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）	240,682,731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）	242,367,103円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	53,174,741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）	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	307,579円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,771,532円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	6,248,820円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,609,535円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,342,624円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,045,123,656円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	333,619,630円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	656,568,370円

D I A M バランス・ファンド<DC 年金> 2 安定・成長型	1, 895, 306, 500円
D I A M バランス・ファンド<DC 年金> 3 成長型	2, 098, 547, 603円
D I A M DC バランス 3 0 インデックスファンド	377, 234, 610円
D I A M DC バランス 5 0 インデックスファンド	778, 211, 021円
D I A M DC バランス 7 0 インデックスファンド	665, 380, 958円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14, 546, 557円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	454, 142, 483円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	38, 867, 719円
D I A M DC 8 資産バランスファンド (新興国 1 0)	125, 346, 778円
D I A M DC 8 資産バランスファンド (新興国 2 0)	102, 480, 032円
D I A M DC 8 資産バランスファンド (新興国 3 0)	176, 711, 918円
クルーズコントロール	1, 021, 185, 786円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC 年金>	112, 880, 979円
4 資産分散投資・ハイクラス<DC 年金>	241, 582, 997円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	3, 972, 125円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	9, 870, 374円
4 資産分散投資・スタンダード<DC 年金>	134, 527, 366円
9 資産分散投資・スタンダード<DC 年金>	164, 785, 477円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC 年金>	10, 468, 678円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1, 203, 086, 501円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 1 9 - 1 2 (適格機関投資家限定)	13, 799, 314円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 0 - 0 6 (適格機関投資家限定)	16, 620, 216円
マルチアセット・インカム戦略ファンド 2 0 - 0 8 (適格機関投資家限定)	102, 319, 415円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 0 - 0 9 (適格機関投資家限定)	8, 702, 646円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 1 - 0 3 (適格機関投資家限定)	13, 471, 895円
インカム重視マルチアセット運用ファンド II 2 0 2 1 - 0 4 (適格機関投資家限定)	1, 110, 793, 511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, 613, 709, 643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)	4, 212, 122, 780円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2, 323, 588, 834円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5, 413, 148, 738円
D I A M ワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	61, 562, 248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)	22, 156, 737円
D I A M グローバル・バランスファンド 2 5 V A (適格機関投資家限定)	477, 339, 226円
D I A M グローバル・バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限定)	268, 615, 601円
D I A M 国際分散バランスファンド 3 0 V A (適格機関投資家限定)	27, 679, 204円
D I A M 国際分散バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限定)	48, 326, 603円
D I A M 国内重視バランスファンド 3 0 V A (適格機関投資家限定)	11, 821, 162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)	1, 031, 482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)	32, 679, 120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)	59, 889, 643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)	2, 282, 064, 000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, 731, 633, 967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)	3, 041, 128, 809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)	383, 146, 026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)	187, 838, 258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)	2, 119, 329, 839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)	519, 095, 927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)	3, 648, 026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)	447, 328, 936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)	458, 783, 386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)	607, 705, 313円
D I A M 世界バランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	66, 133, 814円
計	68, 771, 080, 570円
2. 受益権の総数	68, 771, 080, 570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 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期

	間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
国債証券	△2,083,571,370
合計	△2,083,571,370

(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 (2021年2月23日から2021年5月11日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0269円 (20,269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

2021年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	5,000,000.000	4,983,984.350	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,000,000.000	3,986,562.480	
		US T N/B 0.125 04/30/22	1,000,000.000	1,000,556.300	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,998,125.000	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,597,812.490	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,997,265.620	
		US T N/B 0.125 08/31/22	4,000,000.000	4,003,125.000	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,996,796.860	
		US T N/B 0.125 11/30/22	5,340,000.000	5,342,085.910	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,000,000.000	1,994,687.500	
		US T N/B 0.25 03/15/24	4,810,000.000	4,807,745.310	

US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	2,004,062.400	
US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,412,553.480	
US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,804,265.600	
US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,958,750.000	
US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	985,000.000	
US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	983,945.310	
US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,948,437.500	
US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,962,812.500	
US T N/B 0.375 01/31/26	2,000,000.000	1,966,718.740	
US T N/B 0.375 04/15/24	5,000,000.000	5,011,914.050	
US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,986,562.500	
US T N/B 0.375 07/31/27	2,000,000.000	1,912,421.860	
US T N/B 0.375 09/30/27	1,700,000.000	1,619,648.420	
US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,553,274.600	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,953,828.110	
US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	2,013,437.400	
US T N/B 0.5 03/31/25	800,000.000	799,250.000	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,937,421.880	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,450,371.090	
US T N/B 0.5 06/30/27	1,700,000.000	1,641,496.080	
US T N/B 0.5 08/31/27	2,000,000.000	1,923,906.240	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,876,718.750	
US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,760,062.500	
US T N/B 0.625 05/15/30	6,220,000.000	5,739,893.750	
US T N/B 0.625 08/15/30	6,210,000.000	5,707,863.250	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,000,000.000	1,930,625.000	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,430,000.000	4,269,239.460	
US T N/B 0.75 01/31/28	3,390,000.000	3,290,418.750	
US T N/B 0.75 03/31/26	2,570,000.000	2,568,494.130	
US T N/B 0.875 11/15/30	6,400,000.000	6,001,499.960	
US T N/B 1.125 02/15/31	4,360,000.000	4,172,485.900	
US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	1,023,320.310	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,108,335.910	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,020,000.000	3,002,186.710	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,753,500.000	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,100,000.000	3,411,007.780	
US T N/B 1.25 03/31/28	2,910,000.000	2,913,410.140	
US T N/B 1.25 05/15/50	3,780,000.000	2,919,459.370	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,509,768.750	
US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,387,368.730	
US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,088,281.240	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,547,851.540	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,540,000.000	3,619,940.620	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,128,746.090	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,541,953.120	
US T N/B 1.375 11/15/40	3,810,000.000	3,313,211.690	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,563,241.000	

US T N/B 1.5 02/15/30	3,970,000.000	3,968,759.370	
US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,024,960.930	
US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,051,718.740	
US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,232,073.030	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,192,114.820	
US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	764,384.760	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,281,468.750	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	2,073,828.120	
US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,353,404.660	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,086,953.110	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,216,376.140	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,986,433.570	
US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,059,444.500	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,380,000.000	3,432,680.430	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	1,973,847.640	
US T N/B 1.625 10/31/23	4,000,000.000	4,139,218.720	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,438,583.970	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,750,621.050	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,400,000.000	3,743,437.490	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,020,000.000	1,058,130.460	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,120,257.010	
US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,491,968.750	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,704,024.210	
US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	845,238.270	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,399,305.460	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,854,464.440	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,370,996.060	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,940,000.000	1,986,832.790	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,674,687.480	
US T N/B 1.75 12/31/26	1,740,000.000	1,816,804.670	
US T N/B 1.875 02/15/41	2,120,000.000	2,013,254.660	
US T N/B 1.875 02/15/51	3,290,000.000	2,977,450.000	
US T N/B 1.875 06/30/26	450,000.000	473,941.400	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,495,721.080	
US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,766,825.000	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,273,440.600	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,514,926.940	
US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,598,746.050	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,270,000.000	3,052,723.790	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	5,013,903.500	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,485,336.700	
US T N/B 2.0 11/15/26	2,640,000.000	2,794,584.350	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,785,383.150	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,367,843.750	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,296,431.220	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,320,000.000	3,529,704.670	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,184,611.320	

US T N/B 2. 125 06/30/22	4, 530, 000. 000	4, 635, 552. 530	
US T N/B 2. 125 09/30/24	2, 930, 000. 000	3, 101, 908. 570	
US T N/B 2. 125 11/30/23	2, 000, 000. 000	2, 097, 031. 240	
US T N/B 2. 125 12/31/22	5, 520, 000. 000	5, 702, 203. 110	
US T N/B 2. 25 01/31/24	350, 000. 000	369, 031. 250	
US T N/B 2. 25 02/15/27	3, 550, 000. 000	3, 804, 878. 880	
US T N/B 2. 25 03/31/26	3, 090, 000. 000	3, 311, 610. 930	
US T N/B 2. 25 04/30/24	3, 300, 000. 000	3, 490, 523. 420	
US T N/B 2. 25 08/15/27	2, 690, 000. 000	2, 880, 611. 700	
US T N/B 2. 25 08/15/46	1, 550, 000. 000	1, 534, 863. 260	
US T N/B 2. 25 08/15/49	4, 400, 000. 000	4, 341, 390. 580	
US T N/B 2. 25 11/15/24	4, 690, 000. 000	4, 988, 987. 500	
US T N/B 2. 25 11/15/25	5, 190, 000. 000	5, 557, 760. 130	
US T N/B 2. 25 11/15/27	3, 270, 000. 000	3, 495, 962. 100	
US T N/B 2. 25 12/31/24	3, 000, 000. 000	3, 196, 171. 860	
US T N/B 2. 375 04/30/26	1, 760, 000. 000	1, 897, 568. 740	
US T N/B 2. 375 05/15/27	3, 100, 000. 000	3, 344, 246. 080	
US T N/B 2. 375 05/15/29	2, 810, 000. 000	3, 017, 347. 240	
US T N/B 2. 375 08/15/24	3, 920, 000. 000	4, 176, 790. 610	
US T N/B 2. 375 11/15/49	2, 770, 000. 000	2, 809, 602. 320	
US T N/B 2. 5 01/31/24	3, 890, 000. 000	4, 127, 806. 630	
US T N/B 2. 5 02/15/45	2, 080, 000. 000	2, 164, 743. 720	
US T N/B 2. 5 02/15/46	1, 970, 000. 000	2, 047, 645. 690	
US T N/B 2. 5 02/28/26	2, 550, 000. 000	2, 762, 267. 550	
US T N/B 2. 5 03/31/23	3, 020, 000. 000	3, 155, 192. 170	
US T N/B 2. 5 05/15/24	4, 240, 000. 000	4, 519, 409. 340	
US T N/B 2. 5 05/15/46	1, 810, 000. 000	1, 880, 420. 220	
US T N/B 2. 5 08/15/23	4, 330, 000. 000	4, 556, 648. 430	
US T N/B 2. 625 01/31/26	2, 180, 000. 000	2, 372, 793. 750	
US T N/B 2. 625 02/15/29	4, 110, 000. 000	4, 490, 656. 590	
US T N/B 2. 625 02/28/23	1, 800, 000. 000	1, 881, 070. 300	
US T N/B 2. 625 03/31/25	2, 150, 000. 000	2, 324, 603. 490	
US T N/B 2. 625 06/30/23	1, 820, 000. 000	1, 915, 265. 620	
US T N/B 2. 625 12/31/23	3, 060, 000. 000	3, 252, 325. 770	
US T N/B 2. 625 12/31/25	2, 290, 000. 000	2, 491, 448. 430	
US T N/B 2. 75 02/15/24	5, 320, 000. 000	5, 686, 373. 390	
US T N/B 2. 75 02/15/28	4, 370, 000. 000	4, 812, 633. 180	
US T N/B 2. 75 02/28/25	1, 660, 000. 000	1, 801, 618. 750	
US T N/B 2. 75 04/30/23	2, 490, 000. 000	2, 617, 320. 690	
US T N/B 2. 75 05/31/23	3, 270, 000. 000	3, 443, 718. 750	
US T N/B 2. 75 06/30/25	790, 000. 000	860, 513. 660	
US T N/B 2. 75 07/31/23	3, 270, 000. 000	3, 455, 598. 030	
US T N/B 2. 75 08/15/42	630, 000. 000	688, 373. 430	
US T N/B 2. 75 08/15/47	1, 880, 000. 000	2, 047, 657. 790	
US T N/B 2. 75 08/31/23	2, 170, 000. 000	2, 297, 996. 080	
US T N/B 2. 75 08/31/25	1, 640, 000. 000	1, 788, 304. 670	
US T N/B 2. 75 11/15/23	5, 520, 000. 000	5, 870, 821. 830	

US T N/B 2. 75 11/15/42	1, 220, 000. 000	1, 331, 896. 860	
US T N/B 2. 75 11/15/47	2, 140, 000. 000	2, 331, 095. 280	
US T N/B 2. 875 05/15/28	4, 430, 000. 000	4, 917, 819. 090	
US T N/B 2. 875 05/15/43	2, 000, 000. 000	2, 225, 859. 360	
US T N/B 2. 875 05/15/49	3, 090, 000. 000	3, 455, 730. 440	
US T N/B 2. 875 05/31/25	2, 530, 000. 000	2, 765, 705. 070	
US T N/B 2. 875 07/31/25	1, 860, 000. 000	2, 037, 135. 920	
US T N/B 2. 875 08/15/28	3, 680, 000. 000	4, 084, 800. 000	
US T N/B 2. 875 08/15/45	1, 890, 000. 000	2, 100, 262. 500	
US T N/B 2. 875 09/30/23	840, 000. 000	893, 615. 620	
US T N/B 2. 875 10/31/23	3, 690, 000. 000	3, 932, 156. 250	
US T N/B 2. 875 11/15/46	1, 440, 000. 000	1, 602, 112. 480	
US T N/B 3. 0 02/15/47	1, 640, 000. 000	1, 867, 229. 670	
US T N/B 3. 0 02/15/48	2, 540, 000. 000	2, 899, 667. 950	
US T N/B 3. 0 02/15/49	3, 070, 000. 000	3, 515, 150. 000	
US T N/B 3. 0 05/15/42	980, 000. 000	1, 114, 673. 430	
US T N/B 3. 0 05/15/45	300, 000. 000	340, 488. 270	
US T N/B 3. 0 05/15/47	1, 290, 000. 000	1, 470, 297. 640	
US T N/B 3. 0 08/15/48	2, 710, 000. 000	3, 097, 339. 400	
US T N/B 3. 0 09/30/25	1, 410, 000. 000	1, 554, 855. 450	
US T N/B 3. 0 10/31/25	1, 920, 000. 000	2, 118, 074. 990	
US T N/B 3. 0 11/15/44	1, 790, 000. 000	2, 031, 160. 530	
US T N/B 3. 0 11/15/45	650, 000. 000	738, 613. 270	
US T N/B 3. 125 02/15/42	680, 000. 000	788, 746. 870	
US T N/B 3. 125 02/15/43	1, 440, 000. 000	1, 667, 531. 240	
US T N/B 3. 125 05/15/48	2, 660, 000. 000	3, 107, 316. 380	
US T N/B 3. 125 08/15/44	1, 750, 000. 000	2, 026, 787. 100	
US T N/B 3. 125 11/15/28	2, 840, 000. 000	3, 204, 762. 500	
US T N/B 3. 125 11/15/41	760, 000. 000	880, 471. 870	
US T N/B 3. 375 05/15/44	2, 030, 000. 000	2, 446, 863. 650	
US T N/B 3. 375 11/15/48	2, 660, 000. 000	3, 253, 512. 500	
US T N/B 3. 5 02/15/39	900, 000. 000	1, 095, 187. 500	
US T N/B 3. 625 02/15/44	1, 630, 000. 000	2, 038, 455. 060	
US T N/B 3. 625 08/15/43	1, 670, 000. 000	2, 083, 846. 870	
US T N/B 3. 75 08/15/41	710, 000. 000	897, 983. 580	
US T N/B 3. 75 11/15/43	1, 360, 000. 000	1, 730, 015. 620	
US T N/B 3. 875 08/15/40	1, 110, 000. 000	1, 421, 927. 320	
US T N/B 4. 25 05/15/39	810, 000. 000	1, 079, 831. 250	
US T N/B 4. 25 11/15/40	510, 000. 000	685, 272. 650	
US T N/B 4. 375 02/15/38	550, 000. 000	737, 945. 310	
US T N/B 4. 375 05/15/40	1, 200, 000. 000	1, 633, 125. 000	
US T N/B 4. 375 05/15/41	1, 040, 000. 000	1, 423, 906. 240	
US T N/B 4. 375 11/15/39	910, 000. 000	1, 233, 903. 120	
US T N/B 4. 5 02/15/36	730, 000. 000	978, 257. 020	
US T N/B 4. 5 05/15/38	540, 000. 000	734, 737. 500	
US T N/B 4. 5 08/15/39	790, 000. 000	1, 085, 632. 800	
US T N/B 4. 625 02/15/40	750, 000. 000	1, 049, 121. 080	

	US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,714,781.240	
	US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	711,289.060	
	US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	632,214.840	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,090,921.870	
	US T N/B 5.375 02/15/31	700,000.000	944,562.500	
	US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	841,800.770	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,047,900.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,183,605.460	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	998,437.500	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,137,304.680	
アメリカ・ドル 小計		534,360,000.000 (58,239,896,400)	555,486,524.030 (60,542,476,251)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,200,000.000	1,188,600.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,502,430.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,000,000.000	1,000,170.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	971,460.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	750,000.000	702,352.500	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,000,000.000	997,400.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	1,171,139.000	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	470,000.000	362,468.700	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,250,000.000	1,271,573.240	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,200,000.000	1,117,296.000	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	860,000.000	713,868.800	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,584,991.200	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	250,000.000	225,430.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	922,194.000	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,120,000.000	1,149,840.160	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	700,000.000	733,418.000	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,020,000.000	1,012,217.400	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	953,305.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	910,000.000	945,547.500	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	1,000,665.120	

UK TREASURY 1.625 10/22/54	520,000.000	565,111.560	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	500,000.000	596,605.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	810,000.000	890,848.350	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,110,000.000	1,267,045.020	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,565,040.060	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,559,249.280	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	850,923.220	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,240,858.500	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,413,728.400	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	521,826.040	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,310,000.000	1,811,572.800	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,852,163.070	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,764,192.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	940,000.000	1,529,229.600	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	870,000.000	1,611,666.300	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	940,000.000	1,342,564.960	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,010,000.000	1,363,639.380	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,381,389.200	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	969,633.910	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,462,188.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,733,855.140	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	850,000.000	1,445,739.500	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,869,741.600	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	760,000.000	1,086,674.890	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,180,000.000	1,896,909.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	870,000.000	1,187,602.360	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,380,535.200	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,669,210.170	

	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,062,340.610	
イギリス・ポンド 小計		47,850,000.000 (7,360,765,500)	58,418,449.940 (8,986,510,154)	
イスラエル・シ ュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	300,000.000	302,347.200	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,350,000.000	1,324,348.650	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,017,228.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,000,000.000	938,441.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,138,852.660	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,798,152.290	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,856,113.000	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,260,000.000	1,588,614.300	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,920,000.000	3,143,146.400	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,353,606.500	
イスラエル・シュケル 小計		16,570,000.000 (553,762,772)	18,460,850.000 (616,954,223)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,438,006.610	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,428,500.250	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,980,000.000	1,949,877.270	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,491,105.760	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,740,000.000	1,646,457.600	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	990,000.000	940,630.430	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,616,763.460	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,000,000.000	814,400.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	980,000.000	1,053,794.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,223,815.400	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,135,033.600	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	778,293.810	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	578,371.560	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,806,773.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,160,000.000	1,286,588.480	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,860,000.000	2,060,694.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	938,775.760	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,200,000.000	1,331,911.800	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,840,000.000	2,109,441.870	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	706,640.970	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	924,499.870	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,360,902.780	

	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	980,000.000	1,268,076.090	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,315,628.500	
オーストラリア・ドル 小計		34,050,000.000 (2,903,784,000)	36,204,983.370 (3,087,560,982)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	500,000.000	500,051.000	
	CANADA 0.25 03/01/26	1,100,000.000	1,067,374.000	
	CANADA 0.25 05/01/23	1,000,000.000	999,168.000	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,350,000.000	2,324,737.500	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,100,000.000	1,001,080.300	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	697,934.300	
	CANADA 1.0 09/01/22	1,500,000.000	1,515,553.500	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	716,353.400	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,779,519.600	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,240,058.820	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	823,916.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	3,160,000.000	3,244,719.600	
	CANADA 2.0 06/01/28	720,000.000	759,496.320	
	CANADA 2.0 09/01/23	920,000.000	955,077.760	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,730,000.000	1,685,743.140	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	557,089.890	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,000,000.000	1,063,043.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	654,422.640	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,698,358.400	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,300,885.440	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	969,029.750	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	409,576.300	
	CANADA 3.5 12/01/45	820,000.000	1,050,228.940	
	CANADA 4.0 06/01/41	540,000.000	724,138.920	
	CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	562,417.830	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,338,678.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,035,658.080	
カナダ・ドル 小計		29,950,000.000 (2,695,200,500)	31,674,310.430 (2,850,371,196)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	200,000.000	204,623.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	320,000.000	320,177.600	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	310,000.000	328,073.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	504,069.600	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	362,678.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	192,924.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	130,000.000	141,635.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	487,200.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	434,530.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	733,740.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	470,000.000	522,875.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	413,523.100	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	592,570.000	

	SINGAPORE 3.125 09/01/22	700,000.000	724,850.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	566,640.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	827,820.000	
シンガポール・ドル 小計		6,760,000.000 (555,334,000)	7,357,928.300 (604,453,810)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,200,000.000	2,140,059.700	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,603,347.900	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	3,294,644.400	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,482,496.250	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	8,200,000.000	8,569,242.720	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	1,300,000.000	1,550,445.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,980,000.000	8,836,803.020	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,774,494.300	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	3,000,000.000	3,121,710.000	
スウェーデン・クローナ 小計		34,910,000.000 (455,575,500)	38,373,243.290 (500,770,825)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	3,660,000.000	3,699,528.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,150,000.000	1,981,225.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,495,269.900	
	DENMARK 0.5 11/15/29	2,670,000.000	2,807,691.900	
	DENMARK 1.5 11/15/23	3,500,000.000	3,683,137.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,854,567.430	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,680,000.000	13,522,291.200	
デンマーク・クローネ 小計		32,110,000.000 (570,915,800)	39,043,710.930 (694,197,180)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,800,000.000	1,769,220.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,730,690.050	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,868,448.270	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,000,000.000	1,037,470.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,933,323.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,700,000.000	1,758,922.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,179,606.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,856,025.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,612,114.000	
ノルウェー・クローネ 小計		25,870,000.000 (340,449,200)	26,745,818.820 (351,974,976)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,100,000.000	1,055,670.000	
	POLAND 07/25/22	1,200,000.000	1,199,212.170	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,050,000.000	2,930,819.670	
	POLAND 2.25 10/25/24	600,000.000	636,290.280	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,966,299.660	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,435,889.030	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,080,000.000	2,243,696.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,550,000.000	2,749,085.120	

	POLAND 2.75 04/25/28	3,010,000.000	3,298,809.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	229,824.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,627,727.060	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,440,000.000	4,857,759.600	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,909,152.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	820,000.000	884,276.520	
ポーランド・ズロチ 小計		28,020,000.000 (811,431,180)	30,024,510.610 (869,479,803)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,055,113.300	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,251,361.930	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,100,207.800	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,500,000.000	1,498,866.310	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,217,351.960	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	846,143.520	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,564,601.830	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,313,258.810	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,972,804.860	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,293,490.320	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	2,818,136.880	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,181,742.200	
マレーシア・リンギット 小計		22,830,000.000 (605,152,527)	24,113,079.720 (639,162,993)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	20,000,000.000	20,661,352.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,163,847.540	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	25,876,035.360	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	14,765,982.660	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	19,310,535.060	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	11,000,000.000	11,812,391.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	13,775,182.930	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,424,253.900	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,000,000.000	21,529,888.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	9,454,000.000	9,735,634.660	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,985,600.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	19,273,119.120	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	8,125,000.000	8,923,211.370	

メキシコ・ペソ 小計		183,942,000.000 (1,004,783,175)	198,237,034.400 (1,082,869,800)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	690,000.000	693,895.050	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	110,000.000	109,635.900	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	202,547.400	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	200,000.000	181,580.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	820,000.000	863,182.840	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	547,836.120	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	620,000.000	664,238.860	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	440,000.000	448,876.120	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	680,000.000	724,472.000	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	170,000.000	151,500.600	
	AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	659,002.500	
	AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	815,500.000	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	474,265.250	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	689,652.480	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	594,659.100	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	191,505.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	582,517.440	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	870,000.000	921,358.710	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	566,246.100	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	616,188.910	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	470,000.000	743,302.220	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	786,361.740	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	432,084.660	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,419,995.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	745,546.420	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	947,266.100	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	500,000.000	509,268.000	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	570,000.000	561,760.080	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	808,000.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	673,629.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	320,000.000	304,858.880	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	550,030.600	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	240,000.000	195,249.270	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,203,309.900	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	840,000.000	898,002.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	930,000.000	997,425.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,170,000.000	1,266,536.700	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	520,000.000	558,610.520	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	930,000.000	1,017,159.600	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	796,833.710	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	230,000.000	263,414.830	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	670,000.000	783,091.310	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	490,000.000	586,361.830	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	670,774.500	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	573,678.000	

BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	881,497.760	
BELGIUM 2.25 06/22/57	350,000.000	482,451.820	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,156,078.350	
BELGIUM 3.0 06/22/34	590,000.000	794,318.770	
BELGIUM 3.75 06/22/45	650,000.000	1,070,599.520	
BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	752,088.020	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,060,000.000	1,768,902.560	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,271,556.650	
BELGIUM 4.5 03/28/26	430,000.000	535,716.360	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,777,885.570	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,739,391.400	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	500,000.000	514,810.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,282,543.750	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,300,000.000	1,337,063.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	300,000.000	308,874.000	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,571,670.100	
BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,044,269.620	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,413,678.000	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,302,592.000	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,156,739.190	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,735,579.300	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,100,000.000	1,123,089.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,600,000.000	1,594,016.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	700,000.000	691,012.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,048,580.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	514,635.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,220,000.000	1,100,211.110	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,500,000.000	1,547,385.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,051,590.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,190,000.000	1,250,124.750	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,512,648.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,860,000.000	1,943,625.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,908,138.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,430,000.000	1,525,638.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,800,000.000	1,916,028.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,732,189.200	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,610,000.000	1,656,144.210	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,415,385.720	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,896,501.900	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,820,000.000	2,263,908.920	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,475,806.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,724,327.050	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,410,000.000	1,504,914.150	

DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,698,034.800	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,750,000.000	2,939,473.620	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,583,260.140	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,930,000.000	3,112,310.460	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,674,425.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,860,000.000	2,879,592.840	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,100,000.000	1,810,237.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,330,000.000	2,159,814.930	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	1,999,799.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	828,312.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,420,000.000	2,336,510.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,180,000.000	2,224,205.600	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,945,597.200	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,642,594.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	997,374.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,124,576.100	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,023,152.600	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	183,718.980	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	170,506.600	
FINLAND 0.125 04/15/36	210,000.000	203,747.460	
FINLAND 0.125 04/15/52	210,000.000	180,281.010	
FINLAND 0.25 09/15/40	170,000.000	163,011.810	
FINLAND 0.5 04/15/26	430,000.000	451,195.130	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	253,113.840	
FINLAND 0.5 09/15/29	570,000.000	600,159.840	
FINLAND 0.75 04/15/31	250,000.000	268,322.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	390,000.000	414,286.080	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	233,629.760	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	323,796.020	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	336,730.520	
FINLAND 1.5 04/15/23	470,000.000	489,777.600	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	412,509.200	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	302,019.620	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	503,354.950	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	463,506.900	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	512,526.460	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,215,718.270	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,112,749.000	

FRANCE OAT 0.0 02/25/24	500,000.000	508,242.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,300,000.000	2,346,496.800	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,450,000.000	2,456,313.650	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,700,000.000	2,681,864.100	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,550,000.000	2,636,679.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	1,920,000.000	1,999,507.770	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,166,244.650	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,120,000.000	2,220,295.080	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	700,000.000	680,508.080	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	300,000.000	229,223.700	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	940,000.000	891,340.900	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,750,000.000	2,936,037.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,830,000.000	1,728,292.260	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,340,000.000	2,499,588.000	
FRANCE OAT 03/25/23	2,700,000.000	2,732,987.250	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,767,120.170	
FRANCE OAT 03/25/25	2,470,000.000	2,519,560.550	
FRANCE OAT 05/25/22	1,590,000.000	1,600,708.650	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,350,000.000	2,538,108.100	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,369,208.420	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,340,000.000	2,612,380.680	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	2,442,507.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,523,962.690	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,870,000.000	2,154,090.400	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,130,000.000	3,283,805.070	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	820,000.000	1,023,704.400	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,990,000.000	2,399,741.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,901,437.680	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,157,788.620	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,152,725.300	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,030,000.000	2,116,587.620	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,940,000.000	3,606,718.500	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,280,000.000	3,929,276.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,600,000.000	2,475,865.600	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,375,963.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,060,000.000	1,991,952.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,140,920.120	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,404,574.640	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,730,000.000	3,060,458.310	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,310,000.000	3,994,318.020	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,650,000.000	2,643,600.300	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,685,878.070	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,100,000.000	3,432,216.900	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,328,082.200	
IRISH 0.0 10/18/31	360,000.000	352,967.970	
IRISH 0.2 05/15/27	280,000.000	288,118.600	
IRISH 0.2 10/18/30	450,000.000	454,448.700	

IRISH 0.4 05/15/35	240,000.000	239,177.760	
IRISH 0.55 04/22/41	230,000.000	223,580.640	
IRISH 0.9 05/15/28	600,000.000	645,501.000	
IRISH 1.0 05/15/26	640,000.000	684,958.720	
IRISH 1.1 05/15/29	380,000.000	415,099.080	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	380,614.020	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	235,691.610	
IRISH 1.5 05/15/50	400,000.000	459,437.600	
IRISH 1.7 05/15/37	390,000.000	461,625.060	
IRISH 10/18/22	220,000.000	221,932.040	
IRISH 2.0 02/18/45	560,000.000	711,284.000	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	764,801.730	
IRISH 3.4 03/18/24	560,000.000	623,599.200	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	617,914.200	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	982,509.600	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	1,005,000.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,012,300.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,094,657.760	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	2,100,000.000	2,134,125.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	509,350.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	610,000.000	590,759.600	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,001,364.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,400,000.000	1,442,280.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,000,000.000	1,001,460.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	995,288.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	941,068.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	600,000.000	561,840.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,094,824.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,185,444.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,200,000.000	1,239,960.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,422,137.110	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,585,555.870	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,036,626.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,415,894.920	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	900,000.000	921,929.130	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,094,860.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	200,000.000	190,500.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,790,090.250	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,177,110.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,840,000.000	1,965,856.360	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,588,944.280	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	700,000.000	663,960.500	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,270,080.000	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	600,000.000	616,620.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	858,519.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	966,330.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,529,545.010	

ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,052,886.500	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,540,000.000	1,696,149.070	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,580,000.000	1,732,433.660	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	500,000.000	478,000.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	920,000.000	1,021,568.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,146,888.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,340,000.000	1,542,220.740	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	970,000.000	1,086,885.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	989,884.180	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,384,572.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,275,470.820	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,202,580.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	684,341.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,200,000.000	1,395,467.880	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,143,416.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,576,560.720	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,230,000.000	1,536,124.860	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,278,336.900	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	610,000.000	770,674.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,364,482.560	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,900,290.390	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,010,000.000	1,138,169.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	840,000.000	1,202,918.640	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,265,900.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	490,000.000	554,138.060	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,969,040.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,533,191.100	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,113,180.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,390,000.000	1,804,866.620	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,529,772.450	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,131,242.020	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,352,854.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,069,214.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,150,000.000	1,802,625.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,750,000.000	2,404,850.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,238,127.370	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,128,326.170	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,940,864.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,443,748.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,481,835.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,489,968.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,461,677.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	900,000.000	922,658.400	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	140,000.000	134,183.700	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	510,000.000	445,948.270	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	950,000.000	963,505.200	

NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,420,000.000	1,470,623.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	821,601.580	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	590,000.000	616,119.300	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	989,444.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,020,000.000	1,093,846.980	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	930,000.000	1,002,361.440	
NETHERLANDS 01/15/24	2,330,000.000	2,373,776.040	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	890,483.920	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	980,000.000	1,013,996.200	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	780,000.000	1,009,268.520	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	990,000.000	1,577,153.720	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	390,000.000	419,601.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,160,000.000	1,976,040.280	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,518,480.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,188,980.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,418,130.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	500,000.000	505,291.200	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	999,949.500	
SPAIN 0.1 04/30/31	600,000.000	578,604.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	940,000.000	960,651.800	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,420,000.000	1,447,536.640	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,584,553.900	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,360,042.380	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,150,000.000	1,166,573.800	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,180,000.000	1,212,241.140	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,261,200.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	600,000.000	587,521.200	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,170,000.000	1,045,242.900	
SPAIN 1.2 10/31/40	970,000.000	978,909.450	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,770,000.000	1,908,945.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,550,000.000	1,674,426.250	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,240,000.000	1,354,588.400	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,650,732.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,284,625.480	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,360,000.000	1,487,706.720	
SPAIN 1.45 10/31/71	300,000.000	261,836.400	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,240,000.000	2,451,904.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,562,827.400	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,290,000.000	1,467,354.360	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,407,373.360	

		SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,671,152.500	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,531,794.480	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,481,180.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,119,591.000	
		SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,709,956.860	
		SPAIN 2.9 10/31/46	870,000.000	1,166,276.580	
		SPAIN 3.45 07/30/66	920,000.000	1,404,879.180	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,431,984.690	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,110,000.000	1,650,198.150	
		SPAIN 4.4 10/31/23	480,000.000	538,797.360	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,659,610.190	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,270,000.000	2,089,311.160	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,293,748.070	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,943,955.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	1,180,000.000	1,621,202.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	910,000.000	1,634,428.060	
		SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,610,135.740	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,520,000.000	2,382,899.440	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,370,000.000	1,807,615.120	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,288,150.150	
	ユーロ 小計		366,920,000.000 (48,495,816,400)	427,473,214.180 (56,499,134,718)	
国債証券 合計			124,592,866,954 (124,592,866,954)	137,325,916,911 (137,325,916,911)	
合計				137,325,916,911 (137,325,916,911)	

(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 209銘柄	43.43	44.09
イギリス・ポンド	国債証券 49銘柄	6.45	6.54
イスラエル・シェケル	国債証券 10銘柄	0.44	0.45
オーストラリア・ドル	国債証券 24銘柄	2.22	2.25
カナダ・ドル	国債証券 27銘柄	2.04	2.08
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.43	0.44
スウェーデン・クローナ	国債証券 9銘柄	0.36	0.36
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.50	0.51
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.25	0.26
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.62	0.63
マレーシア・リンギット	国債証券 12銘柄	0.46	0.47
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.78	0.79
ユーロ	国債証券 326銘柄	40.53	41.14

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,392,879,998
投資証券	76,518,921,950
派生商品評価勘定	135,683,640
未収配当金	673,664,962
差入委託証拠金	92,124,000
流動資産合計	79,813,274,550
資産合計	79,813,274,550
負債の部	
流動負債	
前受金	123,408,970
未払金	30,235,182
未払解約金	1,213,193,000
流動負債合計	1,366,837,152
負債合計	1,366,837,152
純資産の部	
元本等	
元本	32,426,571,903
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	46,019,865,495
元本等合計	78,446,437,398
純資産合計	78,446,437,398
負債純資産合計	79,813,274,550

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	24,485,467,090円
同期中追加設定元本額	25,937,715,759円
同期中一部解約元本額	17,996,610,946円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド（安定型）	269,889円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	729,533円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	870,227円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	2,693,926円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,751,456円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,239,047円
たわらノーロード 国内リート	4,436,846,681円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	910,710,362円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	923,423,470円
たわらノーロード バランス（堅実型）	17,514,964円
たわらノーロード バランス（標準型）	312,371,259円
たわらノーロード バランス（積極型）	325,174,301円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	110,050,285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）	290,122,277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）	179,548,022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）	233,744,930円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,318,520円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	7,200,008円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,922,673円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	5,726,697円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,233,129円

マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	387,435,662円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	130,509,613円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	147,057,515円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	277,479,584円
投資のソムリエ	8,637,189,830円
投資のソムリエ＜DC年金＞	470,575,485円
D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	118,464,447円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	341,852,103円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,683,702,079円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	9,839,421円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	4,647,894円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	3,313,089円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	21,269,784円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,060,995,887円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	104,388,907円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	5,626,965円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	2,810,264円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	2,899,970円
Jリートインデックスファンド（DC）	41,461,271円
D I A M J－R E I Tインデックス私募ファンド201212（適格機関投資家限定）	82,539,527円
D I A M J－R E I Tインデックス私募ファンド201401（適格機関投資家限定）	745,865,657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）	6,368,638円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）20－04（適格機関投資家限定）	158,500,539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）	7,749,693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）	91,725,469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）	4,021,095円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	212,081,935円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	83,568,801円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）21－03（適格機関投資家限定）	46,469,693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）	6,178,777円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ2021－04（適格機関投資家限定）	25,002,179円
D I A M J－R E I Tインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,620,652,271円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	197,812,399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）	616,049,902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）	10,384,997円

D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,279,881,203円
計	32,426,571,903円
2. 受益権の総数	32,426,571,903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 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （2）デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。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	2021年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
投資証券	9,510,440,750
合計	9,510,440,750

(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 (2020年6月9日から2021年5月11日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2021年5月11日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	1,626,947,030	—	1,762,724,500	135,777,470
合計	1,626,947,030	—	1,762,724,500	135,777,470

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
 - 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	2.4192円
(1万口当たり純資産額)	(24,192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

2021年5月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
----	----	-------------	------------	----

投資証券

CRE ロジスティクスファン ド投資法人	2, 191	384, 082, 300	
GLP 投資法人	21, 395	3, 876, 774, 000	
NTT 都市開発リート投資法 人	6, 184	986, 348, 000	
One リート投資法人	1, 067	326, 502, 000	
SOSILA 物流リート投資 法人	1, 800	263, 340, 000	
いちごオフィスリート投資法 人	5, 680	543, 008, 000	
いちごホテルリート投資法人	1, 197	105, 216, 300	
アクティビア・プロパティ ーズ投資法人	3, 431	1, 732, 655, 000	
アドバンス・レジデンス投資 法人	6, 504	2, 308, 920, 000	
イオンリート投資法人	6, 945	1, 057, 029, 000	
インベスコ・オフィス・ジェ イリート投資法人	43, 511	946, 364, 250	
インヴィンシブル投資法人	28, 629	1, 229, 615, 550	
エスコンジャパンリート投資 法人	1, 119	146, 700, 900	
オリックス不動産投資法人	13, 642	2, 646, 548, 000	
グローバル・ワン不動産投資 法人	4, 755	594, 375, 000	
ケネディクス・オフィス投資 法人	2, 118	1, 709, 226, 000	
ケネディクス・レジデンシャ ル・ネクスト投資法人	4, 667	1, 044, 941, 300	
ケネディクス商業リート投資 法人	2, 723	757, 538, 600	
コンフォリア・レジデンシャ ル投資法人	3, 078	1, 086, 534, 000	
サムティ・レジデンシャル投 資法人	1, 318	155, 392, 200	
サンケイリアルエステート投 資法人	1, 675	202, 172, 500	
ザイマックス・リート投資法 人	1, 049	121, 159, 500	
ジャパン・ホテル・リート投 資法人	22, 058	1, 431, 564, 200	
ジャパンエクセレント投資法 人	6, 353	973, 914, 900	
ジャパンリアルエステイト投 資法人	6, 847	4, 676, 501, 000	
スターアジア不動産投資法人	7, 035	397, 477, 500	
スターツプロシード投資法人	1, 066	240, 596, 200	
タカラレーベン不動産投資法 人	2, 057	241, 286, 100	

トーセイ・リート投資法人	1,515	203,767,500	
ヒューリックリート投資法人	5,676	995,570,400	
フロンティア不動産投資法人	2,272	1,108,736,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,460	204,984,000	
マリモ地方創生リート投資法人	641	84,419,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	14,643	2,397,059,100	
ラサールロジポート投資法人	8,282	1,438,583,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,656	368,387,200	
阪急阪神リート投資法人	3,093	481,580,100	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,390	1,324,060,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,722	781,788,000	
産業ファンド投資法人	9,678	1,944,310,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,483	198,722,000	
森トラスト総合リート投資法人	4,893	769,668,900	
森ヒルズリート投資法人	8,043	1,286,075,700	
星野リゾート・リート投資法人	1,042	663,754,000	
積水ハウス・リート投資法人	20,139	1,826,607,300	
大江戸温泉リート投資法人	1,105	92,046,500	
大和ハウスリート投資法人	9,769	2,955,122,500	
大和証券オフィス投資法人	1,459	1,148,233,000	
大和証券リビング投資法人	8,941	1,011,227,100	
投資法人みらい	7,395	363,464,250	
東急リアル・エステート投資法人	4,591	858,976,100	
日本アコモデーションファンド投資法人	2,360	1,524,560,000	
日本ビルファンド投資法人	7,706	5,417,318,000	
日本プライムリアルティ投資法人	4,263	1,835,221,500	
日本プロロジスリート投資法人	10,825	3,783,337,500	
日本リート投資法人	2,224	964,104,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,474	1,429,443,000	
日本都市ファンド投資法人	34,104	3,724,156,800	
福岡リート投資法人	3,541	631,360,300	
平和不動産リート投資法人	4,201	692,744,900	
野村不動産マスターファンド投資法人	22,141	3,823,750,700	
投資証券 合計	428,821	76,518,921,950	

合計		76,518,921,950	
----	--	----------------	--

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	112,105,529
コール・ローン	1,509,218,699
投資信託受益証券	7,671,697,372
投資証券	62,598,123,190
派生商品評価勘定	23,552
未収入金	41,950,125
未収配当金	95,434,768
流動資産合計	72,028,553,235
資産合計	72,028,553,235
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,884
未払金	316,506,124
未払解約金	1,472,766,000
流動負債合計	1,789,276,008
負債合計	1,789,276,008
純資産の部	
元本等	
元本	48,371,251,129
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	21,868,026,098
元本等合計	70,239,277,227
純資産合計	70,239,277,227
負債純資産合計	72,028,553,235

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</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>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本となる重要な事項	<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	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	37,037,959,546円
同期中追加設定元本額	55,570,454,432円
同期中一部解約元本額	44,237,162,849円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	78,355,323円
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	40,494,256円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	4,315,746円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	11,703,647円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	13,966,733円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	43,118,229円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	27,335,766円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	19,861,958円
たわらノーロード 先進国リート	8,527,437,404円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,422,160,630円

たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	334,748,207円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,568,695,417円
たわらノーロード バランス（堅実型）	14,704,625円
たわらノーロード バランス（標準型）	263,216,203円
たわらノーロード バランス（積極型）	506,782,760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）	2,849,915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）	48,439,032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）	99,804,312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）	210,377,136円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	2,185,305円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,251,990円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	5,835,461円
O n e D C 先進国リートインデックスファンド	490,255,946円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	18,707,227円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	584,044,636円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,826,726円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	227,868,421円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	258,547,175円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	473,697,908円
投資のソムリエ	12,528,618,644円
投資のソムリエ＜D C年金＞	677,072,661円
D I A M 8資産バランスファンドN＜D C年金＞	208,590,169円
投資のソムリエ＜D C年金＞リスク抑制型	428,026,925円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,606,724,836円
ワールドアセットバランス（基本コース）	681,168,431円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,227,066,658円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	15,003,112円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	7,103,014円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（D C）	4,143,576円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	36,108,958円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,596,928,955円
9資産分散投資・スタンダード＜D C年金＞	175,061,381円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	8,580,386円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	4,320,516円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	4,399,209円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	503,548,696円
D I A M外国リートインデックスファンド＜D C年金＞	150,042,486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）	181,662,674円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）20-04（適格機関投資家限定）	182,354,426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）	222,747,122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）	87,622,646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）	112,913,068円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）21-03（適格機関投資家限定）	14,584,701円

インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ 2021-03（適格機関投資家限定）	178,235,653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）	758,859,724円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	279,629,571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）	297,275,502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）	131,922,693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）	312,760,291円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,979,717,609円
P-O n eマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	852,733,298円
D I A M海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	555,008,469円
計	48,371,251,129円
2. 受益権の総数	48,371,251,129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 2020年11月12日 至 2021年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （2）デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。
	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。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	2021年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	445,844,297
投資証券	7,945,437,798
合計	8,391,282,095

(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（2020年6月23日から2021年5月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	351,620,457	—	351,640,125	19,668
アメリカ・ドル	261,553,680	—	261,573,600	19,920
イギリス・ポンド	15,382,600	—	15,382,900	300
オーストラリア・ドル	26,438,970	—	26,436,800	△2,170
カナダ・ドル	7,199,392	—	7,199,176	△216
シンガポール・ドル	15,604,700	—	15,607,759	3,059
ニュージーランド・ドル	2,372,280	—	2,372,082	△198
ユーロ	17,182,035	—	17,182,308	273
韓国・ウォン	975,600	—	975,000	△600
香港・ドル	4,911,200	—	4,910,500	△700
合計	351,620,457	—	351,640,125	19,668

(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。

(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)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4521円 (14,521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

2021年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	276,800.000	204,832.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	586,700.000	440,025.000	
		PRIME US REIT	232,000.000	198,360.000	
	アメリカ・ドル	小計	1,168,200.000	843,217.000 (91,902,221)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	162,857.000	498,342.420	
		APN INDUSTRIA REIT	84,914.000	267,479.100	
		ARENA REIT	164,238.000	560,051.580	
		AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	154,524.000	446,574.360	
		BWP TRUST	220,799.000	933,979.770	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	204,153.000	549,171.570	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	193,663.000	681,693.760	
		CENTURIA OFFICE REIT	188,552.000	418,585.440	
		CHARTER HALL GROUP	207,368.000	2,996,467.600	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	230,013.000	1,108,662.660	

	CHARTER HALL RETAIL REIT	223,509.000	815,807.850	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	135,493.000	443,062.110	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	860,691.000	787,532.260	
	DEXUS	480,702.000	4,927,195.500	
	GDI PROPERTY GROUP	251,524.000	275,418.780	
	GOODMAN GROUP	749,568.000	14,639,063.040	
	GPT GROUP	865,906.000	3,983,167.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	141,623.000	535,334.940	
	HOME CONSORTIUM LTD	89,100.000	437,481.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	121,900.000	155,422.500	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,965.000	233,729.400	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	122,727.000	672,543.960	
	IRONGATE GROUP	292,701.000	430,270.470	
	MIRVAC GROUP	1,743,611.000	4,899,546.910	
	NATIONAL STORAGE REIT	423,304.000	863,540.160	
	RURAL FUNDS GROUP	148,517.000	363,866.650	
	SCENTRE GROUP	2,309,986.000	6,283,161.920	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	483,828.000	1,185,378.600	
	STOCKLAND	1,056,429.000	4,922,959.140	
	VICINITY CENTRES	1,710,121.000	2,642,136.940	
	WAYPOINT REIT LTD	357,000.000	913,920.000	
オーストラリア・ドル 小計		14,453,286.000	58,871,547.990 (5,020,565,614)	
シンガポール・ ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	210,895.000	301,579.850	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	457,580.000	356,912.400	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,402,560.000	4,221,705.600	
	ASCOTT TRUST	781,216.000	828,088.960	
	CAPITALAND CHINA TRUST	404,580.000	546,183.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,005,809.000	4,232,256.990	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	311,300.000	389,125.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	127,400.000	93,639.000	
	ESR REIT	1,148,130.000	459,252.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	466,600.000	284,626.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	608,800.000	161,332.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	601,700.000	1,438,063.000	

		FRASERS HOSPITALITY TRUST	391,800.000	209,613.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,191,164.000	1,762,922.720	
		IREIT GLOBAL	214,500.000	139,425.000	
		KEPPEL DC REIT	569,100.000	1,479,660.000	
		KEPPEL REIT	879,900.000	1,047,081.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	355,900.000	274,043.000	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,920,200.000	192,733.200	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	984,000.000	2,056,560.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	733,620.000	2,024,791.200	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,274,520.000	2,523,549.600	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	926,500.000	982,090.000	
		QUE COMMERCIAL REIT	1,148,155.000	459,262.000	
		PARKWAY LIFE REIT	161,900.000	691,313.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	313,200.000	129,978.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	260,800.000	242,544.000	
		SPH REIT	475,900.000	414,033.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	559,800.000	307,890.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	959,390.000	1,439,085.000	
		シンガポール・ドル 小計	22,846,919.000	29,689,337.520 (2,438,979,077)	
	ユーロ	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	158,840.000	379,627.600	
	ユーロ 小計		158,840.000	379,627.600 (50,175,380)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	622,000.000	4,994,660.000	
	香港・ドル 小計		622,000.000	4,994,660.000 (70,075,080)	
投資信託受益証券 合計			39,249,245	7,671,697,372 (7,671,697,372)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	39,173.000	852,012.750	
		AGREE REALTY CORP	28,201.000	1,982,530.300	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	30,306.000	552,478.380	
		ALEXANDER'S INC.	1,082.000	296,587.020	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	56,979.000	10,207,218.060	

AMERICAN ASSETS TRUST INC	21,162.000	738,765.420	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	61,501.000	2,855,491.430	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	45,386.000	437,974.900	
AMERICAN HOMES 4 RENT	120,674.000	4,461,317.780	
AMERICOLD REALTY TRUST	113,353.000	4,374,292.270	
APARTMENT INCOME REIT CORP	66,487.000	2,956,676.890	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	64,197.000	444,243.240	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	92,846.000	1,434,470.700	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,757.000	385,056.230	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	62,205.000	12,253,762.950	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	10,643.000	104,301.400	
BOSTON PROPERTIES INC	63,274.000	6,846,879.540	
BRANDYWINE REALTY TRUST	77,158.000	1,048,577.220	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	132,585.000	2,984,488.350	
BROADSTONE NET LEASE INC	18,100.000	368,335.000	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	15,748.000	283,778.960	
BRT APARTMENTS CORP	3,832.000	67,596.480	
CAMDEN PROPERTY TRUST	43,791.000	5,398,116.570	
CARETRUST REIT INC	43,145.000	997,512.400	
CENTERSPACE	6,223.000	440,961.780	
CHATHAM LODGING TRUST	23,276.000	296,536.240	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,617.000	48,432.330	
CITY OFFICE REIT INC	22,599.000	245,877.120	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	43,129.280	
COLONY CAPITAL INC	219,994.000	1,451,960.400	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	52,028.000	933,382.320	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,658.000	521,495.940	
COREPOINT LODGING INC	20,970.000	209,909.700	
CORESITE REALTY CORP	19,274.000	2,280,692.420	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	50,188.000	1,392,215.120	
COUSINS PROPERTIES INC	66,929.000	2,410,782.580	
CTO REALTY GROWTH INC	3,446.000	176,710.880	
CUBESMART	88,723.000	3,784,035.950	

CYRUSONE INC	53,506.000	3,778,058.660	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	95,095.000	928,127.200	
DIGITAL REALTY TRUST INC	125,908.000	19,015,885.240	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	99,533.000	395,146.010	
DOUGLAS EMMETT INC	73,914.000	2,430,292.320	
DUKE REALTY TRUST	166,762.000	7,691,063.440	
EAST GROUP	17,759.000	2,753,888.130	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,652.000	730,117.640	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	58,923.000	695,291.400	
EPR PROPERTIES	33,273.000	1,598,767.650	
EQUINIX INC	39,979.000	28,784,880.000	
EQUITY COMMONWEALTH	53,647.000	1,461,880.750	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	76,099.000	5,342,149.800	
EQUITY RESIDENTIAL	153,643.000	11,461,767.800	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	50,911.000	1,290,084.740	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	28,931.000	8,429,336.160	
EXTRA SPACE STORAGE INC	59,088.000	8,735,569.920	
FARMLAND PARTNERS INC	14,198.000	200,475.760	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	31,042.000	3,608,011.660	
FIRST INDUSTRIAL RT	57,697.000	2,862,925.140	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	34,424.000	948,725.440	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	52,759.000	275,929.570	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	98,261.000	4,529,832.100	
GEO GROUP INC	59,561.000	356,770.390	
GETTY REALTY CORP	17,398.000	546,993.120	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	18,631.000	394,790.890	
GLADSTONE LAND CORP	11,331.000	256,873.770	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,182.000	313,209.840	
GLOBAL NET LEASE INC	38,191.000	729,448.100	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	62,084.000	1,964,337.760	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	97,466.000	2,767,059.740	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	239,811.000	8,036,066.610	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,618.000	181,302.380	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	45,477.000	2,008,719.090	

HOST HOTELS & RESORTS INC	316,567.000	5,416,461.370	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	67,081.000	1,843,385.880	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	42,906.000	701,513.100	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	27,493.000	691,174.020	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,492.000	1,838,827.920	
INVITATION HOMES INC	254,291.000	8,943,414.470	
IRON MOUNTAIN INC	129,458.000	5,412,638.980	
JBG SMITH PROPERTIES	49,199.000	1,582,731.830	
KILROY REALTY CORP	46,837.000	3,157,750.540	
KIMCO REALTY	192,085.000	4,116,381.550	
KITE REALTY GROUP TRUST	38,467.000	811,653.700	
LEXINGTON REALTY TRUST	124,114.000	1,561,354.120	
LIFE STORAGE INC	33,603.000	3,239,329.200	
LTC PROPERTIES INC	16,547.000	676,275.890	
MACK CALI	36,207.000	615,156.930	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	258,946.000	5,567,339.000	
MID AMERICA	50,926.000	8,116,585.880	
MONMOUTH RE INVEST CP – CL A	44,816.000	856,881.920	
NATIONAL HEALTH INVS INC	20,197.000	1,422,676.680	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	77,878.000	3,680,514.280	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	28,772.000	1,316,031.280	
NETSTREIT CORP	10,996.000	232,015.600	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	43,397.000	291,193.870	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,678.000	537,957.640	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	20,286.000	557,662.140	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	102,565.000	3,736,442.950	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,525.000	215,767.750	
PARAMOUNT GROUP INC	70,229.000	744,427.400	
PARK HOTELS & RESORTS INC	106,499.000	2,350,432.930	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	58,716.000	1,322,284.320	
PHYSICIANS REALTY TRUST	93,648.000	1,737,170.400	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	55,782.000	1,021,926.240	

PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,046.000	254,397.000	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	26,202.000	256,779.600	
PROLOGIS INC	331,065.000	38,469,753.000	
PS BUSINESS PARKS	8,973.000	1,400,416.110	
PUBLIC STORAGE	68,108.000	18,876,813.280	
QTS REALTY TRUST INC	28,675.000	1,796,202.000	
REALTY INCOME CORP	167,329.000	11,301,400.660	
REGENCY CENTERS CORP	70,925.000	4,640,622.750	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	53,491.000	948,395.430	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	96,336.000	1,135,801.440	
RETAIL VALUE INC	8,794.000	157,500.540	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	58,514.000	3,187,842.720	
RLJ LODGING TRUST	73,948.000	1,137,320.240	
RPT REALTY	38,643.000	493,857.540	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24,434.000	1,872,377.420	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	93,728.000	1,666,483.840	
SAFEHOLD INC	5,982.000	413,774.940	
SAUL CENTERS INC	6,739.000	294,696.470	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	18,527.000	295,690.920	
SERVICE PROPERTIES TRUST	74,681.000	841,654.870	
SIMON PROPERTY GROUP INC	147,133.000	18,649,107.750	
SITE CENTERS CORP	75,014.000	1,078,701.320	
SL GREEN	31,255.000	2,265,049.850	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	51,741.000	2,418,374.340	
STAG INDUSTRIAL INC	70,632.000	2,579,480.640	
STORE CAPITAL CORP	106,566.000	3,641,360.220	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	44,097.000	423,772.170	
SUN COMMUNITIES INC	49,691.000	8,247,712.180	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	96,581.000	1,182,151.440	
TANGER FACTORY OUTLET	42,529.000	725,544.740	
TERRENO REALTY CORP	30,506.000	1,946,282.800	
THE MACERICH COMPANY	50,631.000	718,453.890	
UDR INC	132,493.000	6,182,123.380	
UMH PROPERTIES INC	18,767.000	414,750.700	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,162.000	403,549.380	
URBAN EDGE PROPERTIES	49,830.000	948,264.900	

	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	15,612.000	291,163.800	
	VENTAS INC	167,954.000	9,225,713.220	
	VEREIT INC	102,833.000	4,783,791.160	
	VICI PROPERTIES INC	239,452.000	7,490,058.560	
	VORNADO REALTY TRUST	69,880.000	3,250,118.800	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,926.000	20,745.340	
	WASHINGTON REIT	38,339.000	897,515.990	
	WEINGARTEN REALTY INVST	53,679.000	1,766,039.100	
	WELLTOWER INC	186,994.000	13,895,524.140	
	WHITESTONE REIT	17,850.000	163,863.000	
	WP CAREY INC	78,314.000	5,875,899.420	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	51,516.000	970,561.440	
アメリカ・ドル 小計		9,725,670.000	476,285,178.740 (51,910,321,628)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	90,746.000	88,840.330	
	ASSURA PLC	1,170,085.000	864,692.810	
	BIG YELLOW GROUP PLC	73,795.000	944,576.000	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	384,546.000	308,790.430	
	BRITISH LAND CO PLC	417,100.000	2,272,360.800	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	383,378.000	714,233.210	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	258,157.000	301,527.370	
	CUSTODIAN REIT PLC	169,210.000	171,240.520	
	DERWENT LONDON PLC	50,434.000	1,774,268.120	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	296,016.000	258,125.950	
	GCP STUDENT LIVING PLC	204,750.000	339,066.000	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	113,505.000	837,099.370	
	HAMMERSON PLC	1,785,355.000	683,790.960	
	HOME REIT PLC	109,841.000	126,317.150	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	176,518.000	197,347.120	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	1,848.320	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	337,748.000	2,535,136.480	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	397,914.000	923,160.480	
	LXI REIT PLC	215,976.000	293,295.400	
	NEWRIVER REIT PLC	161,120.000	158,703.200	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	223,580.000	198,091.880	

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	592,356.000	899,788.760	
	REGIONAL REIT LTD	211,479.000	184,409.680	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	93,007.000	875,195.870	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	255,156.000	117,882.070	
	SEGR0 PLC	534,370.000	5,442,558.450	
	SHAFTESBURY PLC	135,523.000	884,965.190	
	STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179,591.000	125,713.700	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	372,756.000	424,941.840	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	178,993.000	190,090.560	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	762,069.000	1,479,937.990	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	304,151.000	236,933.620	
	UNITE GROUP PLC	177,139.000	2,086,697.420	
	WORKSPACE GROUP PLC	58,651.000	530,205.040	
イギリス・ポンド 小計		11,106,055.000	27,471,832.090 (4,225,991,930)	
イスラエル・シ ュケル	REIT 1 LTD	76,605.000	1,371,229.500	
イスラエル・シュケル 小計		76,605.000	1,371,229.500 (45,825,941)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	27,640.000	1,187,414.400	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,548.000	351,843.880	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,088.000	87,324.160	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,313.000	348,958.110	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	37,360.000	2,113,081.600	
	CHOICE PROPERTIES REIT	71,967.000	1,033,446.120	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	36,537.000	372,312.030	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	22,389.000	383,523.570	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,063.000	351,962.730	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	42,459.000	600,370.260	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	12,553.000	275,036.230	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	48,353.000	858,265.750	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,567.000	1,104,625.140	

	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	63,249.000	981,624.480	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	31,603.000	503,435.790	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,803.000	402,954.110	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,736.000	191,842.560	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	141,447.840	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	42,500.000	566,950.000	
	PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	82,650.110	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	68,475.000	1,450,985.250	
	SLATE GROCERY REIT	10,657.000	132,679.650	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	52,236.660	
	SMARTCENTRES REIT	30,697.000	902,798.770	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	35,908.000	575,964.320	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	25,378.000	185,766.960	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,855.000	409,608.650	
カナダ・ドル 小計		781,526.000	15,649,109.130 (1,408,263,331)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	418,233.000	635,714.160	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	478,575.000	1,100,722.500	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	702,814.000	885,545.640	
	PRECINCT PROPERTIES	467,995.000	783,891.620	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	159,321.000	469,996.950	
ニュージーランド・ドル 小計		2,226,938.000	3,875,870.870 (306,465,110)	
ユーロ	AEDIFICA	14,710.000	1,553,376.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	78,473.000	1,148,059.990	
	ALTAREA	1,482.000	251,347.200	
	BEFIMMO	11,586.000	418,833.900	
	CARE PROPERTY INVEST NV	12,522.000	315,554.400	
	CARMILA SA	23,729.000	355,460.420	
	COFINIMMO SA	12,665.000	1,654,049.000	
	COVIVIO	21,454.000	1,667,404.880	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18,200.000	426,972.000	
	GECINA SA	24,381.000	3,176,844.300	
	HAMBORNER REIT AG	31,890.000	290,964.360	

	HIBERNIA REIT PLC	295,849.000	346,735.020	
	ICADE	14,046.000	1,028,869.500	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	25,990.000	111,107.250	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	111,958.000	1,021,616.750	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	11,218.000	249,039.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	188,236.000	294,777.570	
	KLEPIERRE	88,868.000	2,118,613.120	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	32,245.000	185,086.300	
	MERCIALYS	20,259.000	220,417.920	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	148,063.000	1,381,427.790	
	MONTEA SCA	4,526.000	423,633.600	
	NSI NV	7,085.000	244,432.500	
	RETAIL ESTATES	4,482.000	292,674.600	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	61,566.000	4,526,947.980	
	VASTNED RETAIL	7,700.000	191,345.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	60,346.000	1,789,862.360	
	WERELDHAVE NV	17,687.000	269,373.010	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	7,890.000	375,564.000	
ユーロ 小計		1,359,106.000	26,330,390.320 (3,480,087,689)	
韓国・ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,958.000	49,690,420.000	
	JR REIT XXVII	43,907.000	224,364,770.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	19,970.000	124,013,700.000	
	LOTTE REIT CO LTD	49,128.000	272,660,400.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	41,533.000	199,566,065.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	16,057.000	131,667,400.000	
韓国・ウォン 小計		180,553.000	1,001,962,755.000 (97,691,369)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	877,070.000	3,990,668.500	
	LINK REIT	925,920.000	69,582,888.000	
	PROSPERITY REIT	662,000.000	1,853,600.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	471,000.000	2,095,950.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	640,000.000	2,553,600.000	
香港・ドル 小計		3,575,990.000	80,076,706.500 (1,123,476,192)	

投資証券 合計	29,032,443	62,598,123,190 (62,598,123,190)	
合計		70,269,820,562 (70,269,820,562)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	0.13	—	74.00
	投資証券 152銘柄	—	73.90	
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	—	6.02	6.01
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	—	0.07	0.07
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	7.15	—	7.14
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	—	2.00	2.00
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	3.47	—	3.47
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	—	0.44	0.44
	投資信託受益証券 1銘柄	0.07	—	
ユーロ	投資証券 29銘柄	—	4.95	5.02
	投資信託受益証券 1銘柄	0.10	—	
韓国・ウォン	投資証券 6銘柄	—	0.14	0.14
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.10	—	1.70
	投資証券 5銘柄	—	1.60	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年5月31日現在

I 資産総額	421,460,955円
II 負債総額	754,841円
III 純資産総額（I－II）	420,706,114円
IV 発行済数量	338,635,453口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2424円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	356,607,350,708円
II 負債総額	246,172,862円
III 純資産総額（I－II）	356,361,177,846円
IV 発行済数量	113,156,439,520口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.1493円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	548,777,257,323円
II 負債総額	16,186,469,023円
III 純資産総額（I－II）	532,590,788,300円
IV 発行済数量	101,044,239,957口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	5.2709円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	357,221,170,553円
II 負債総額	5,812,856,000円
III 純資産総額（I－II）	351,408,314,553円
IV 発行済数量	269,203,485,511口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3054円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	140,674,360,196円
II 負債総額	1,163,667,604円
III 純資産総額（I－II）	139,510,692,592円
IV 発行済数量	68,130,853,761口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.0477円

J－REITインデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	86,814,578,131円
II 負債総額	135,088,561円
III 純資産総額（I－II）	86,679,489,570円
IV 発行済数量	35,694,217,185口

V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4284円
------------------	---------

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

I 資産総額	73,284,130,869円
II 負債総額	483,521,413円
III 純資産総額（I－II）	72,800,609,456円
IV 発行済数量	49,335,489,411口
V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4756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はない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2021年5月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2021年5月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,456,996,517,130
追加型株式投資信託	833	15,634,860,948,038
単位型公社債投資信託	29	64,928,430,507
単位型株式投資信託	210	1,297,503,990,239
合計	1,098	18,454,289,885,914

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第36期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2021年5月26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 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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2021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。

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) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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：千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	—
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産	1,278,455	1,119,327
建物	※1 1,006,793	※1 915,815
器具備品	※1 270,768	※1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産	3,524,781	3,991,834
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産	9,482,127	11,153,554
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位：千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△7	△6
評価・換算差額等計	△7	△6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		—	
為替差益	—		7,314	
金銭の信託運用益	—		1,229,697	
受取負担金	297,886		—	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		—	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		—	
システム解約料	31,680		—	
早期割増退職金	—		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		—	
特別利益計		1,169,758		—
特別損失				
固定資産除却損	※1 16,085		※1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		△385,835		△1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	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, 000	2, 428, 478	17, 124, 479	19, 552, 957	123, 293	31, 680, 000	14, 146, 079	45, 949, 372	67, 502, 329
当期変動額									
剰余金の配当							△11, 280, 000	△11, 280, 000	△11, 280, 000
当期純利益							15, 005, 011	15, 005, 011	15, 005, 011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									—
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	3, 725, 011	3, 725, 011	3, 725, 011
当期末残高	2, 000, 000	2, 428, 478	17, 124, 479	19, 552, 957	123, 293	31, 680, 000	17, 871, 090	49, 674, 383	71, 227, 341

	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	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	△ 846,763	△ 846,763	△ 846,763
当期変動額合計	△ 846,763	△ 846,763	2,878,247
当期末残高	△ 7	△ 7	71,227,333

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	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	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							△12,000,000	△12,000,000	△12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	△ 7	△ 7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			△12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	△ 6	△ 6	73,353,137

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 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。</p> <p>(2) 無形固定資産 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>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、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) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 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。

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

※1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウェア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

第35期 (自 2019年4月1日 至 2020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 (千円)	1株当たり配 当額 (円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21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 (千円)	1株当たり配 当額 (円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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
2021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（千円）	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	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17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。

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第35期（2020年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	32,932,013	—
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	—
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	—
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	—
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,988	2,988	—
資産計	77,644,787	77,644,787	—
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	—
負債計	4,582,140	4,582,140	—

第36期（2021年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	36,734,502	—
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	—
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	—
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	—
(5) 投資有価証券 その他有価証券	1,990	1,990	—
資産計	85,026,130	85,026,130	—
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	—
負債計	6,889,193	6,889,193	—

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（5）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

（1）未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
①非上場株式	259,369	259,369
②関係会社株式	5,299,196	5,299,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 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35期 (2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	—	—	—
(2) 金銭の信託	28,548,165	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	—	—	—
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	—

第36期 (2021年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	—	—	—
(2) 金銭の信託	25,670,526	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	—	—	—
(5) 投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	—	1,990	—	—

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第35期（2020年3月31日現在）

(千円)

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			
①株式	—	—	—
②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			
①株式	—	—	—
②投資信託	2,988	3,000	△ 11
小計	2,988	3,000	△ 11
合計	2,988	3,000	△ 11

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額259,369千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第36期（2021年3月31日現在）

(千円)

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			
①株式	—	—	—
②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			
①株式	—	—	—
②投資信託	1,990	2,000	△ 9
小計	1,990	2,000	△ 9
合計	1,990	2,000	△ 9

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額259,369千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	1,298,377	1,169,758	—
投資信託	159,526	5,528	1

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	996	—	3

（注）投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、償還によるものであります。

（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

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	△4,319
退職給付の支払額	△187,749	△245,143
過去勤務費用の発生額	—	△1,567
その他	△1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

（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

(千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	△130,155	△84,264
未認識過去勤務費用	△173,798	△102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	△11,303	△7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～4.42%	1.00%～3.76%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	—
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	11,532	△5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	—	—
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	—	—
繰延税金負債合計	—	—
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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
 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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(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	76,224,837千円
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	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(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	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	－千円	－千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	－千円	－千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	一千円	一千円
営業利益	△8,954,439千円	△8,823,626千円
経常利益	△8,954,439千円	△8,823,626千円
税引前当期純利益	△9,111,312千円	△8,823,626千円
当期純利益	△7,536,465千円	△7,288,834千円
1株当たり当期純利益	△188,411円64銭	△182,220円85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	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,149,555千円	5,016,672千円

(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。

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021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。

(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35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第35期（自 2019年4月1日 至 2020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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (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。

追加型証券投資信託
マネックス資産設計ファンド
〈隔月分配型〉
約 款

アセットマネジメント One 株式会社

運用の基本方針

約款第 18 条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

- 1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 70% 未満とします。

- 3) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 20%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 6) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- 7) 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。
- 8) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

（４）収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>
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は信託銀行株式会社を受託者とします。
- 2) この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正 11 年法律第 62 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 26 条第 1 項に基づく信託事務の委任として、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、金額および限度額>

- 第 3 条 委託者は、金 1,000,000 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。
- 2) 委託者は、受託者と合意の上、金 3,000 億円を限度として信託金を追加することができるものとします。
- 3) 追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。
- 4) 委託者は、受託者と合意のうえ、第 2 項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

- 第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 48 条第 6 項、第 49 条第 1 項、第 50 条第 1 項、第 51 条第 1 項および第 53 条第 2 項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

<受益権の分割および再分割>

- 第 5 条 委託者は、第 3 条第 1 項による受益権について 1,000,000 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 8 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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、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 5 条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。

＜追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法＞

第 8 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係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 30 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します。

＜信託日時の異なる受益権の内容＞

第 9 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 10 条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）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。）及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5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、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

<受益権の設定に係る受託者の通知>

第11条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、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取得価額等>

第12条 委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第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（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第5条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、1口以上1口単位または1円以上1円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。ただし、取得申込日がニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所、オーストラリア証券取引所の休業日（以下、「海外休業日」といいます。）に該当する場合には、受益権の取得申込みに応じません。

- 2) 前項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、当該基準価額に委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税ならびに地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額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かかる取得価額は、1口につき1円に委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める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加算した価額とします。
- 3) 第1項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込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、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第2項の受益権の価額に当該取得申込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) 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所(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「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。)等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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13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え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14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15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものを行い、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第 16 条 委託者は、信託金を主として第 1 号から第 6 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、それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券ならびに第 7 号以降の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
2. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. J－R E I T インデックスファンド・マザーファンド
6. 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
7. 株券または新株引受権証書
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
13. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
14. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
15. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
16. コマーシャル・ペーパー
17. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
18. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 7 号から第 17 号までの証券または証書の性質を有するもの
19. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
20. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
21. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）

22. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りします。）
 23. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
 24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 25. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします。）
 26. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
 27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 28. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第 7 号の証券または証書、第 18 号ならびに第 23 号の証券または証書のうち第 7 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 8 号から第 12 号までの証券および第 18 号ならびに第 23 号の証券または証書のうち第 8 号から第 12 号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第 19 号の証券および第 20 号の証券を以下「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
 - 3) 第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、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、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式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 70 以上となる投資の指図をしません。
 - 5) 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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、取得時において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。

- 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の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株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<受託者の自己または利害関係人等との取引>

第17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、受託者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。以下この条および第31条において同じ。）、第31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、第15条、第16条第1項および第2項に定める資産への投資を、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限り行うことができます。

- 2) 前項の取扱い、第22条から第28条、第30条、第35条、第36条における委託者の指図による取引についても同様とします。

<運用の基本方針>

第18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19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、証券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、証券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。

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の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当該新株引受権証券および当該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5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の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および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<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。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに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ならびに転換社債型新株予約権付社債の定めがあるもの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 21 条の 2 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、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。

<信用取引の指図および範囲>

第 22 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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2) 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・範囲>

第 23 条 委託者は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

- 2) 委託者は、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先物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、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・範囲>

第 24 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、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 4 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基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あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

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、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 4 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あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第 25 条の 2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

＜有価証券の貸付けの指図および範囲＞

第 26 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けの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 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、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

＜公社債の空売りの指図および範囲＞

第 27 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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

＜公社債の借入れ＞

第 28 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、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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 項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

＜特別の場合の外貨建有価証券への投資制限＞

第 29 条 外貨建有望証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

＜外国為替予約の指図および範囲＞

第 30 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

＜信託業務の委託等＞

第 31 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す。）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な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（裁量性のないものに限りま
- す。）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. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第 32 条 （削除）

<混蔵寄託>

第 33 条 金融機関または証券会社(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。以下本条において同じ。)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証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社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 34 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 35 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係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第 36 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、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 37 条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を

含みます。)を目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

<損益の帰属>

第38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39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も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り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40条 この信託の計算期間は、原則として1月12日から3月11日まで、3月12日から5月11日まで、5月12日から7月11日まで、7月12日から9月11日まで、9月12日から11月11日まで、11月12日から翌年1月11日までとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成19年5月11日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

- 2) 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<信託財産に関する報告>

第41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。

<信託事務の諸費用>

- 第 42 条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- 2) 信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第 40 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一定率を乗じて計算し、毎計算期末または信託終了のとき当該消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

- 第 43 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 40 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 50 の率を乗じて得た額とします。
- 2) 前項の信託報酬は、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、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
 - 3) 第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、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 44 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（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
 - 2) 前項第 1 号および第 2 号におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 - 3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

＜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 45 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までに、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。）については第 46 条第 2 項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第 48 条第 3 項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第 46 条第 3 項に規定する支払開始日までに、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、その責に任じません。

＜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、毎計算期間終了後 1 ヶ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（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関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します。）に支払います。

- 2) 償還金は、信託終了後 1 ヶ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な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委託者の指定する証券会社または登録金融機関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なうものとし、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なわれます。
- 3) 一部解約金は、第 48 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。
- 4) 前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとしします。
- 5) 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、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します。
- 6) 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します。また、同条同項に規定する「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ます。

<収益分配金および償還金の時効>

第 47 条 受益者が、収益分配金について第 46 条第 1 項に規定する支払い開始日から 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第 46 条第 2 項に規定する支払い開始日から 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。

<信託の一部解約>

第 48 条 受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に、1 口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。受益者が一部解約の実行を請求するときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。ただし、一部解約の実行の請求日が海外休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- 2) 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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なうのと引き換えに、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なうものとし、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なわれます。
- 3) 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に 10,000 分の 30 の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- 4) 委託者は、証券取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- 5) 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中止以前に行った当日の一部解約の実行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、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第 3 項の規定に準じて算出した価額とします。
- 6) 委託者は、信託財産の純資産総額が 10 億円を下回ることとなった場合には、受託者と合意の上、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、第 49 条の規定を準用するものとします。

<信託契約の解約>

第 49 条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、

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、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- 5) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 6) 第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第50条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- 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54条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第51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54条第4項に該当する場合を除き、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52条 委託者は、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53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

務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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 54 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- 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>

第 54 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ができますものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- 2) 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 3) 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- 4) 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託約款の変更をしません。
- 5) 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第 55 条 第 49 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第 49 条第 3 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第 49 条第 2 項または前条第 2 項に規定する公告または書面に付記します。

<公 告>

第 56 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。

<http://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。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第 57 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、これを交付します。

<質権口記載または記録の受益権の取り扱い>

第 58 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 59 条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

<付則>

第 1 条 第 25 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。

第 2 条 第 25 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19年1月26日 (信託契約締結日)

委 託 者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受 託 者 み ず ほ 信 託 銀 行 株 式 会 社

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

東京証券取引所第 1 部に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主として東京証券取引所第 1 部に上場されている株式に投資し、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) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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します。
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) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、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。

J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

（１）投資対象

東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

（２）投資態度

- ①東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ②不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することを目指します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- ③但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証R E I T指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（３）運用制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証R E I T指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証R E I T指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することがで

きるものとします。

③株式への投資は行いません。

④外貨建資産への投資は行いません。

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

⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用の基本方針

約款第 18 条に基づき委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

（1）投資対象

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。

※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。）とします。

（2）投資態度

- ①主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ②不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- ③外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
- ④市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（3）運用制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③株式への直接投資は行いません。
- ④同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の 30% 以内とします。ただし、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が 30% を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券を S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
- ⑤デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動

および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

- ⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。