

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2026年9月29日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 杉原 規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	積木 利浩
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型） マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型） マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型） 2兆円を上限とします。 マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型） 2兆円を上限とします。 マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型） 2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

（以下、総称して「マスターズ・マルチアセット・ファンド」、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）」／（バランス型）／（積極型）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）」は「安定型」、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）」は「バランス型」、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）」は「積極型」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「みらいへの羅針盤」または「みらいへの羅針盤（安定型）」／（バランス型）／（積極型）」という名称を用いる場合があります。また、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）」の愛称として「みらいへの羅針盤（安定型）」、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）」の愛称として「みらいへの羅針盤（バランス型）」、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）」の愛称として「みらいへの羅針盤（積極型）」を用いる場合があります。）

（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】

各ファンドにつき、2兆円を上限とします。

（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。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

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

- ・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】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

※償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

※「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2026年9月30日から2027年3月29日まで

※取得またはスイッチングの申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

（８）【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社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 <https://www.am-one.co.jp/>

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

（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。

ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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３０分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、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受

付を中止することおよびすでに受付けた取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を取り消すことができますものとします。

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

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

<スイッチングについて>

「マスターズ・マルチアセット・ファンド」を構成する各ファンド間でスイッチングを行うことができます。

スイッチングとは、すでに保有しているファンドを解約すると同時に他のファンドの取得の申込みを行うことをいい、ファンドの解約代金がそのまま買付代金に充当されます。

スイッチングの際には解約時と同様の費用（信託財産留保金）・税金がかかるほか、販売会社が定めるお申込手数料がかかる場合があります。スイッチングの際のお申込手数料は販売会社へお問い合わせください。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合や一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。

詳しくは販売会社までお問い合わせください。

○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各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
- ②各ファンドの信託金限度額は、各々5,000億円とします。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 世界の様々な資産に分散投資することにより、中長期的な信託財産の成長を目的として運用を行います。

- 実質的に国内株式、世界株式^(※1)、国内債券、世界債券^(※2)、国内REIT、世界REIT、コモディティ等の各資産に分散投資を行い、それぞれの配分比率を機動的に変更します。なお、各資産への投資は、主として、別に定めるマザーファンド受益証券(以下「指定マザーファンド^(※3)」といいます。)、上場投資信託証券、株価指数先物取引、債券先物取引、オプション取引等のデリバティブ取引等を通じて行います。

(※1)新興国の株式を含みます。

(※2)国債、政府機関債、地方債、新興国債券、社債、ハイイールド債券、物価連動債、MBS、貸付債権(バンクローン)等を含みます。

(※3)すべての指定マザーファンドへ投資するものではありません。なお、指定マザーファンドの詳細は、後述の追加的記載事項の「指定マザーファンドの概要」をご参照ください。

- 指定マザーファンドは、市場環境の変化への対応等の観点から、定量・定性評価等を勘案して、適宜見直します(指定マザーファンドの大幅な入れ替えを含みます)。この際、指定マザーファンドとしていたマザーファンド受益証券が指定から外れることや、新たなマザーファンド受益証券を指定マザーファンドとする場合もあります。
- 実質組入外貨建資産に対しては、対円で為替ヘッジを行う場合があります。

2 「安定型」、「バランス型」、「積極型」の3つのファンドから選択できます。

- お客さまのリスク許容度に応じて、基準価額の変動リスク^(※4)水準の異なる以下の3つのファンドから選択できます。

(※4)基準価額の変動の大きさを表し、この値が小さいほど、基準価額の変動が小さいことを意味します。

ファンド	基準価額の変動リスク水準
安定型	年率5%程度
バランス型	年率8%程度
積極型	年率14%程度

※基準価額の変動リスクは目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、基準価額の変動リスクは各ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、各ファンドが年率5%程度、8%程度、14%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。目標値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

- 各ファンド間でスイッチングが可能です。

※スイッチング時には、税金、購入時手数料、信託財産留保額がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合や一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社でご確認ください。

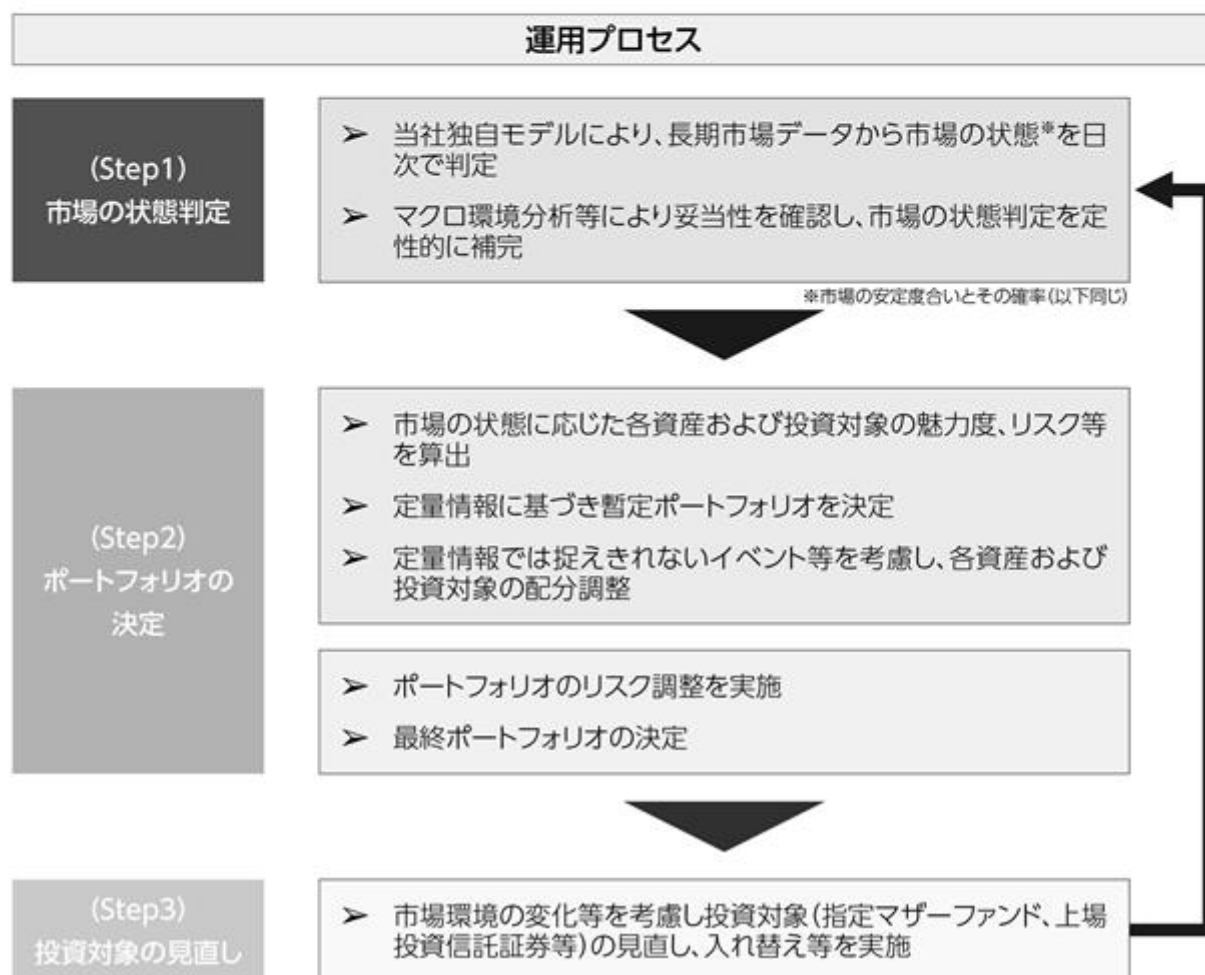
3 各資産および投資対象への実質投資割合は、独自の運用モデルから判断される市場の安定度合いとその確率に基づき、景気局面やマクロ環境等に関する定性的な判断も勘案して決定します。

- 各ファンドの基準価額の変動リスク水準に応じて、定量判断、定性判断を組み合わせ、市場環境の変化に応じた適切な資産配分をめざします。
- 独自の運用モデルにより、市場の安定度合いとその確率を判定します。
- 市場の状態に応じた各資産および投資対象の魅力度、リスク等を勘案し、定量判断・定性判断により各ファンドの基準価額の変動リスク水準に応じたポートフォリオを構築します。
- 上記に加えて、定性判断等により短期的な市場環境変化を考慮し、ポートフォリオの調整を適宜行います。

※市場環境等によっては、一部の資産や投資対象への投資割合がゼロとなる場合があります。

※「安定型」においては、債券への実質投資割合が高くなる傾向があります。

※「積極型」においては、株式への実質投資割合が高くなる傾向があります。



※運用プロセスは、2026年6月末時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年6月28日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

<商品分類>

- ・ 商品分類表
各ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型	国内	株式
		債券
	海外	不動産投信
追加型	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

- ・ 商品分類定義

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

＜属性区分＞

・属性区分表

各ファンド

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
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) 日々 その他 ()	北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり (適時ヘッジ※) なし
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、 商品等)資産配分変 更型)) 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

(注2) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※各ファンドは外貨建資産への投資にあたって、為替ヘッジを機動的に行います。

・属性区分定義

その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、債券、 不動産投信、商品等) 資産配分変更型))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(株式、債券、不動産投信、商品等)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う。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

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

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

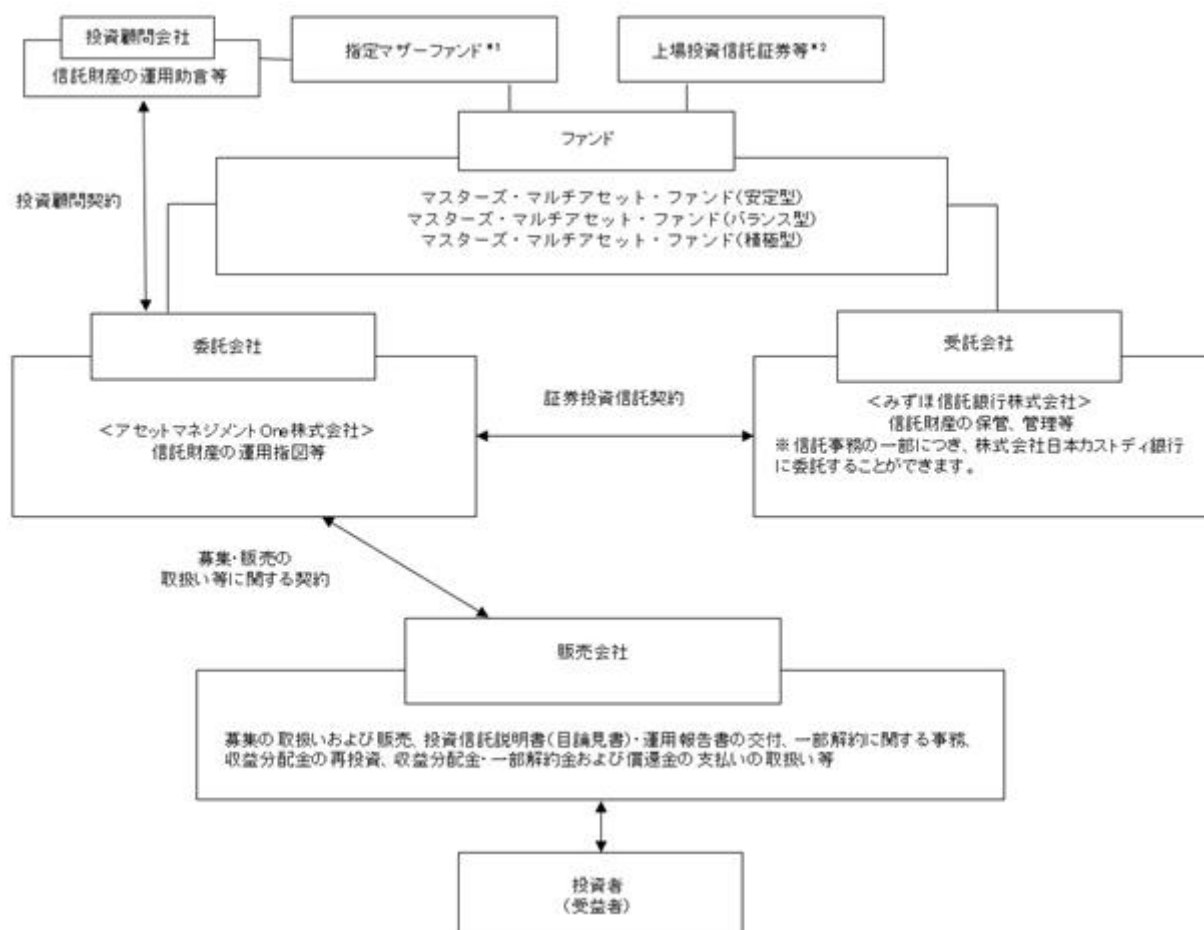
(注3) 各ファンドはマザーファンド受益証券(投資信託証券)への投資を通じて、株式、債券、不動産投信、商品等を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

(2) 【ファンドの沿革】

2024年7月22日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2026年5月21日 各ファンドの投資態度および主要投資対象の変更、各ファンドの運用方式をファンド・オブ・ファンズ方式からファミリーファンド方式へ変更、「積極型」の基準価額の変動リスク水準を「年率11%程度」から「年率14%程度」に変更、「安定型」の信託報酬率(税抜)を「年率1.30%」から「年率0.90%」に引き下げ、「バランス型」の信託報酬率(税抜)を「年率1.30%」から「年率1.10%」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、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、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

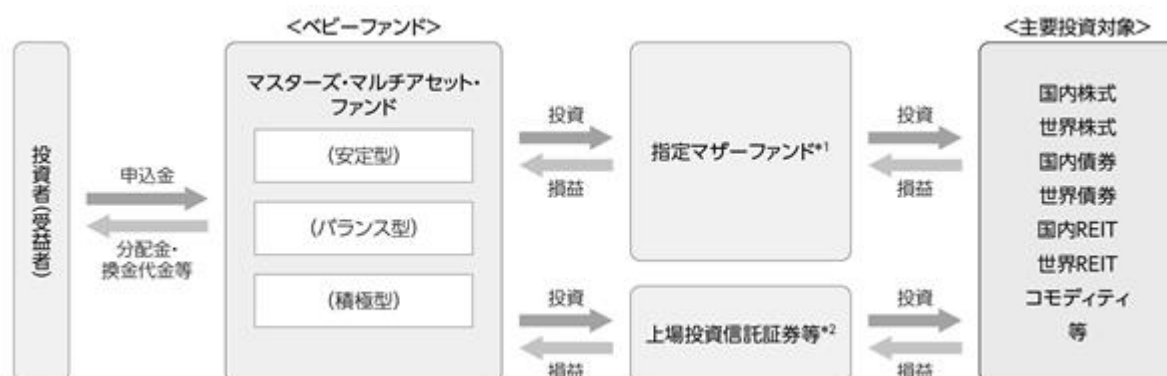
指定マザーファンドのうち、グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンドについては、委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）との間で運用にかかる助言契約が締結されております。

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●

各ファンドは「ファミリーファンド方式」による運用のほか、上場投資信託証券等を通じた運用を行います。

「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（各ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



※1 指定マザーファンドの詳細は、後掲「（参考）各ファンドが投資対象とする指定マザーファンドの概要」をご参照ください。

※2 指定マザーファンドのほか、上場投資信託証券、株価指数先物取引、債券先物取引、オプション取引等のデリバティブ取引等を通じて投資を行います。

○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（2026年6月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2026年6月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ^{※1}	70.0% ^{※2}
株式会社第一ライフグループ	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%、株式会社第一ライフグループ49.0%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

別に定めるマザーファンド受益証券、上場投資信託証券、デリバティブ取引を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

①実質的に国内株式、世界株式^{（※1）}、国内債券、世界債券^{（※2）}、国内REIT、世界REIT、コモディティ等の各資産に分散投資を行い、それぞれの配分比率を機動的に変更します。なお、各資産への投資は、主として、別に定めるマザーファンド受益証券（以下「指定マザーファンド^{（※3）}」といいます。）、上場投資信託証券、株価指数先物取引、債券先物取引、オプション取引等のデリバティブ取引等を通じて行います。

（※1）新興国の株式を含みます。

（※2）国債、政府機関債、地方債、新興国債券、社債、ハイイールド債券、物価連動債、MBS、貸付債権（バンクローン）等を含みます。

（※3）すべての指定マザーファンドへ投資するものではありません。

②基準価額の変動リスク^{（※4）}を（※）程度として、基準価額の上昇をめざします。

（※）は、下記の表より各々あてはめてご覧ください。

安定型	年率5%
バランス型	年率8%
積極型	年率14%

※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は各ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、各ファンドが年率5%程度、8%程度、14%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

（※4）価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

- ③各資産および投資対象への実質投資割合は、独自の運用モデルから判断される市場の安定度合いとその確率に基づき、景気局面やマクロ環境に関する定性的な判断も勘案して決定します。
- ④指定マザーファンドは、市場環境の変化への対応等の観点から、定性・定量評価等を勘案して、適宜見直します（指定マザーファンドの大幅な入れ替えを含みます）。この際、指定マザーファンドとしていたマザーファンド受益証券が指定から外れることや、新たなマザーファンド受益証券を指定マザーファンドとする場合もあります。
- ⑤実質組入外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行う場合があります。
- ⑥ファンドの資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条の3、第20条の4および第20条の5に定めるものに限りま。

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主として別に定めるマザーファンド受益証券を含む次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1.株券または新株引受権証書

- 2.国債証券

- 3.地方債証券

- 4.特別の法律により法人の発行する債券

- 5.社債券（新株引受権証書と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

- 6.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

- 7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

- 8.協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券

（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10.コマーシャル・ペーパー

11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12.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。）

13.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～12.の証券または証書の性質を有するもの

14.投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

15.投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、次の16.で定めるものを除きます。）

16.投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17.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。）

18.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

19.預託証券または預託証書（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。）

20.外国法人が発行する譲渡性預金証書

21.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。）

22.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

23.外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.および19.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに16.の証券ならびに13.および19.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

1.預金

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

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

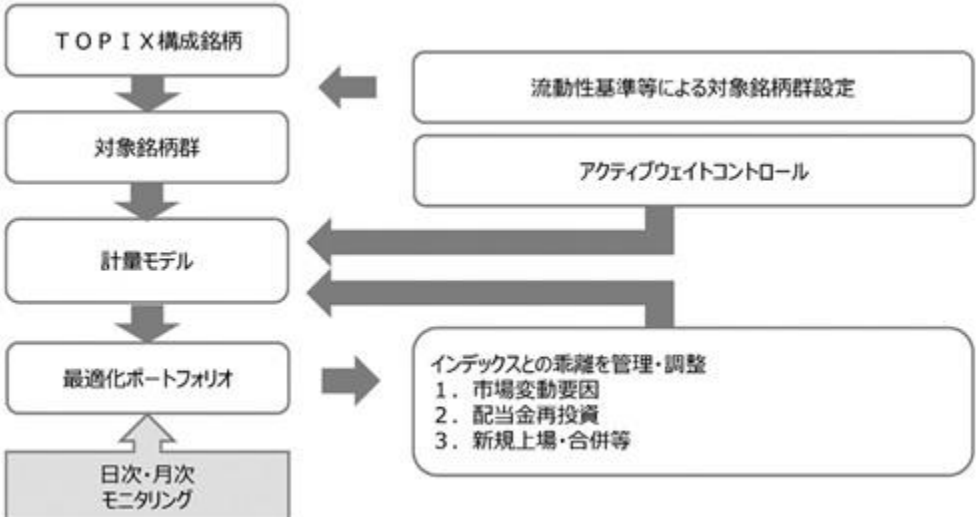
（参考）各ファンドが投資対象とする指定マザーファンドの概要

投資対象とする指定マザーファンドの概要は以下のとおりです。

※すべての指定マザーファンドへ投資するものではありません。

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

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

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

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-----------------------

基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

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

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

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

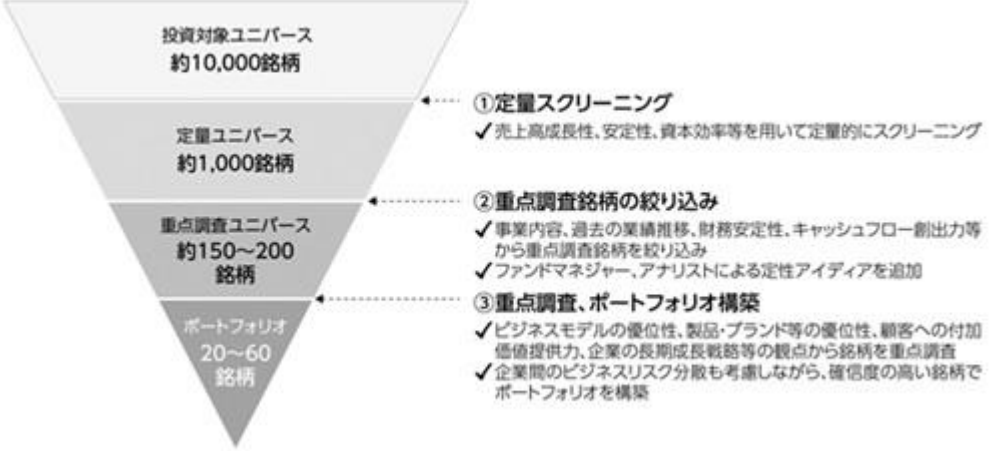
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、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

ファンド名	NASDAQ100インデックス・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NASDAQ100 [®] （配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を図ることを目的として、運用を行います。
主な投資対象	米国の金融商品取引所に上場する株式（上場予定を含みます。）^{（＊）}を主要投資対象とします。 （＊）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等（以下「DR等」といいます。）を含みます。

投資態度	1.主として、米国の金融商品取引所に上場する株式（DR等を含みます。）に投資を行います。 2.NASDAQ100[®]（配当込み、円換算ベース）[※]への連動性を高めるため、上場投資信託証券に投資を行う場合があります。また、有価証券先物取引等を活用する場合があります。 3.株式（DR等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。 4.組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※当ファンドは、Nasdaq, Inc.またはその関連会社（Nasdaq, Inc.およびその関連会社を「Nasdaq社」と総称します。）によって、資金提供、承認、販売または販売促進されるものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの合法性または適合性、もしくは当ファンドに関する説明や開示の正確性または妥当性について認定するものではありません。Nasdaq社は、当ファンドの受益者または公衆一般に対して、一般的な証券投資または特に当ファンドへの投資の妥当性や、NASDAQ-100 Index[®]の一般的な株式市場への追従能力について、明示的あるいは黙示的を問わず、表明または保証するものではありません。Nasdaq社とアセットマネジメントOne株式会社（以下「ライセンシー」といいます。）の関係は、Nasdaq[®]およびNASDAQ-100 Index[®]、Nasdaq社の一定の商標の使用許諾、およびNasdaq社がライセンシーまたは当ファンドとは無関係に決定、構築および計算を行うNASDAQ-100 Index[®]の使用許諾に限定されます。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Index[®]決定、構築および計算に関して、ライセンシーまたは当ファンドの受益者の要望を考慮する義務を負いません。Nasdaq社は、当ファンドの発行に関するタイミング、価格または数量の決定、もしくは当ファンドの換金に関する算式の決定または計算に関して責任を負わず、関与しません。Nasdaq社は、当ファンドの管理、マーケティングまたは取引について責任を負いません。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Index[®]またはそれに含まれるデータの正確性および/または中断のない計算を保証しません。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Index[®]またはそれに含まれるデータの利用によって、ライセンシー、当ファンドの受益者、またはその他のいかなる個人または組織に生じた結果について、明示的あるいは黙示的を問わず、保証するものではありません。Nasdaq社は、NASDAQ-100 Index[®]またはそれに含まれるデータに関して、特定の目的または利用のための商品性もしくは適合性について、明示的あるいは黙示的を問わず保証するものではなく、一切の保証を明示的に否認します。上記に限らず、いかなる場合もNasdaq社は一切の逸失利益または特別、付随的、懲罰的、間接的もしくは派生的な損害に関して、当該損失の可能性について通知されていたとしても、何らの責任を負いません。
------	---

運用プロセス	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「NASDAQ100[®]」を構成するすべての銘柄を、その時価構成比で組み入れること（完全法）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。また、インデックスへの連動性を高めるため、上場投資信託証券（ETF）・有価証券先物取引等を活用する場合があります。  <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[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	1.株式（DR等を含みます。）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.投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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。 6.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主な投資対象	日本を含む世界の中小型株式^{（*）}を主要投資対象とします。 （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等（以下「DR等」といいます。）を含みます。

投資態度	1.主として、日本を含む世界の中小型株式に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目的として、積極的な運用を行います。また、日本を含む世界の不動産投資信託（REIT）にも投資する場合があります。 2.徹底した企業分析、銘柄調査に基づき、企業のビジネスモデルの優位性、収益力の高さ、財務状況の安定性、キャッシュフロー創出力の高さ等について定量・定性の両面からスクリーニングし、組入候補銘柄群を選定します。 3.ポートフォリオの構築にあたっては、組入候補銘柄群の中から、安定した長期的な成長への期待が高いと考えられる銘柄を厳選して投資を行います。 4.株式（DR等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。 5.組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 6.銘柄選定にあたっては、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。
運用プロセス	 The diagram illustrates a four-stage investment process funnel. The stages and their corresponding actions are as follows: 投資対象ユニバース 約10,000銘柄 (Investment Target Universe, ~10,000 stocks) ① 定量スクリーニング (Quantitative Screening): 売上高成長性、安定性、資本効率等を用いて定量的にスクリーニング (Using sales growth, stability, capital efficiency, etc. for quantitative screening). Result: 定量ユニバース 約1,000銘柄 (Quantitative Universe, ~1,000 stocks). ② 重点調査銘柄の絞り込み (Narrowing down key investigation stocks): 事業内容、過去の業績推移、財務安定性、キャッシュフロー創出力等から重点調査銘柄を絞り込み (Narrowing down key investigation stocks based on business content, past performance, financial stability, etc.). Result: 重点調査ユニバース 約150～200銘柄 (Key Investigation Universe, ~150-200 stocks). ③ 重点調査、ポートフォリオ構築 (Key investigation, portfolio construction): ビジネスモデルの優位性、製品・ブランド等の優位性、顧客への付加価値提供力、企業の長期成長戦略等の観点から銘柄を重点調査 (Investigating stocks from the perspective of business model, product/brand, customer value, etc.). Result: ポートフォリオ 20～60銘柄 (Portfolio, 20-60 stocks).
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.外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 3.投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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。 6.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
-------	----------------------

基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式 ^{（＊）} に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。 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。
------	--

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

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

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

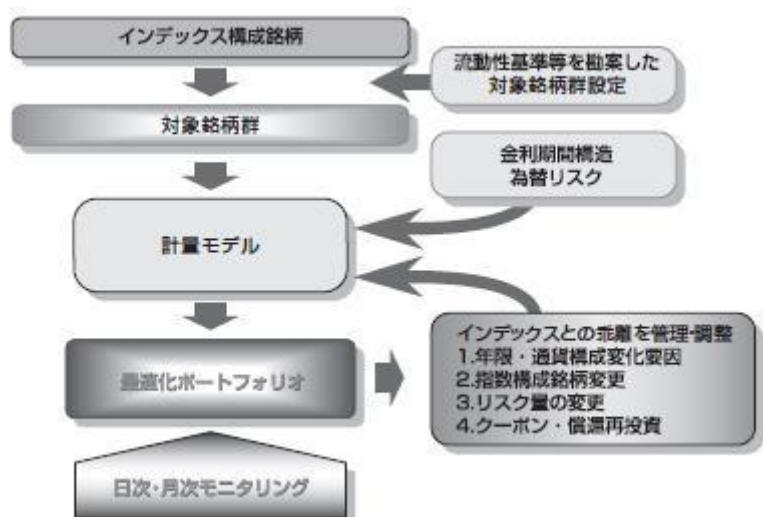
	るためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 <pre> graph TD A[MSCI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] F[アクティブウェイトコントロール] --> C G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D </pre>
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.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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。 6.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA－BP I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA－BPI総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※NOMURA－BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA－BPI総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2)が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資 <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] 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>

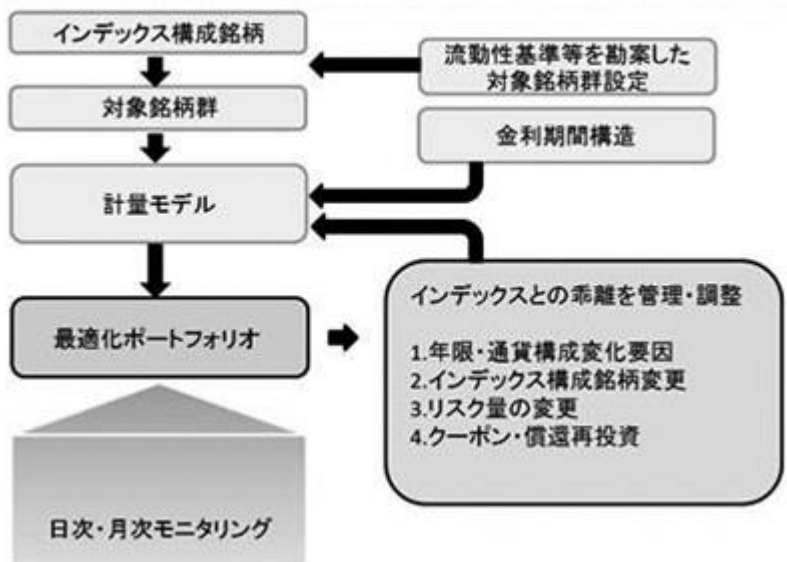
主な投資制限	1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	---

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

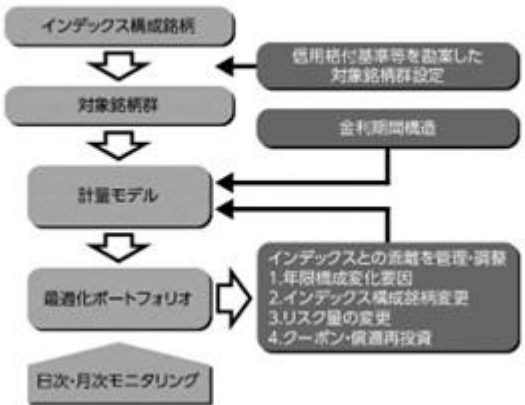
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資  <pre>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

主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	---

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

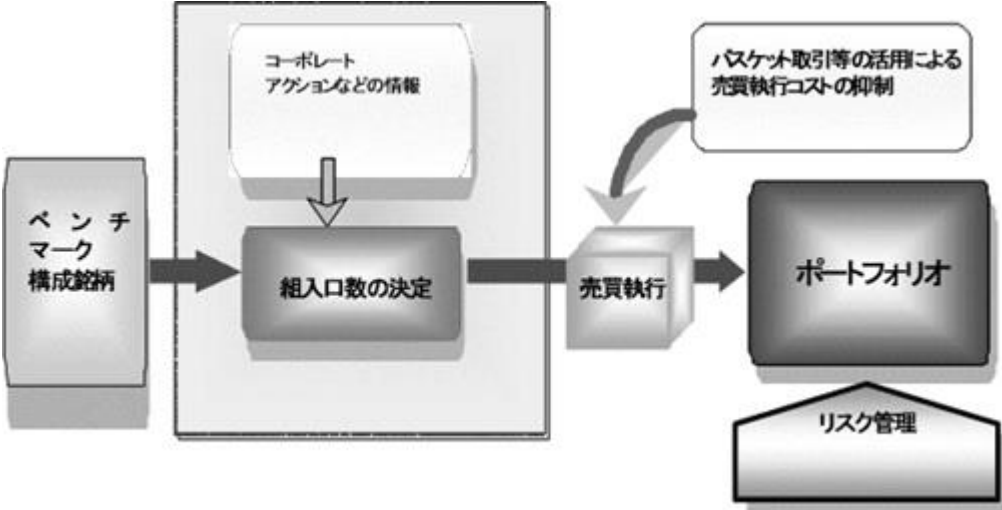
運用プロセス	流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C C --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> I["1. 年限・通貨構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資"] I --> D </pre>
主な投資制限	1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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等への投資は、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割合には、制限を設けません。 6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	1.主として新興国の債券に投資し、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3.組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはMoody ' s の外貨建て長期格付がB B ー格もしくはB a 3 格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4.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。 ※ J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス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。
運用プロセス	信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。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。  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> 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 --> A E --> B E --> C E --> D E --> F[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年際構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] F --> A F --> B F --> C F --> D </pre>
主な投資制限	1.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.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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。 6.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	J－REITインデックスファンド・マザーファンド
-------	--------------------------

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

運用プロセス	・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。 ・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。 ・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。  <pre> graph LR BM[ベンチマーク構成銘柄] --> ID[組入口数の決定] CA[コーポレートアクションなどの情報] --> ID ID --> BE[売買執行] BE --> PF[ポートフォリオ] PF --- RM[リスク管理] BE -.-> 抑制 BEC[バスケット取引等の活用による 売買執行コストの抑制] </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。 2.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 3.株式への投資は行いません。 4.外貨建資産への投資は行いません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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とします。
投資態度	1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 R E I T 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。

--	--	--

※ S & P 先進国 R E I T インデックスは S & P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社（以下「アセットマネジメントOne」）に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S & P Global, Inc. またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは SPDJI に付与されており、アセットマネジメントOneにより一定の目的でサブライセンスされています。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社（総称して「S & P Dow Jones Indices」）がスポンサーとなっており、推奨、販売、または販売促進されているものではありません。S & P Dow Jones Indices は、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、証券全般または具体的に本商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡する S & P 先進国 R E I T インデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I T インデックスに関する、S & P Dow Jones Indices とアセットマネジメントOne との間における唯一の関係は、当インデックスと S & P Dow Jones Indices および／またはそのライセンサーの一定の商標、サービスマーク、および／または商号をライセンス供与していることです。S & P 先進国 R E I T インデックスは、アセットマネジメントOne または本商品を考慮することなく、S & P Dow Jones Indices によって決定、構成、計算されます。S & P Dow Jones Indices は、S & P 先進国 R E I T インデックスの決定、構成または計算に際して、アセットマネジメントOne または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S & P Dow Jones Indices は、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 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リターンを提供する保証はありません。S & P Dow Jones Indices は、（改正米国1940年投資会社法に定義する）投資顧問、商品取引顧問、コモディティ・プール・オペレーター、ブローカー・ディーラー、受託者、プロモーターでも、合衆国法典第15巻第77条k項(a)に列記する「専門家」でも、税務顧問でもありません。S & P Dow Jones Indices が、証券、商品、暗号通貨又はその他資産を指数に採用した場合にも、それは、S & P Dow Jones Indices がかかる証券、商品、暗号通貨またはその他の資産を購入、売却または保有するよう推奨したことにはならず、また投資助言もしくは商品取引の助言とはみなされません。S & P DOW JONES INDICES または第三者ライセンサーは、S & P 先進国 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、アセットマネジメントOne、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られるべき結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、ライセンシーの商品の有価証券届出書、目論見書またはその他の募集資料を審査しておらず、いかなる部分も作成および／または証明しておらず、またS&P DOW JONES INDICESはそれらを管理していません。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESとアセットマネジメントOneとの間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

運用プロセス

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運動性を随時確認し、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。



主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 R E I T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 R E I T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。 7.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにC D、C P、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	1.国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がA A -格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のC D、C Pを主要投資対象とします。 （*）主要格付機関とは、R & I、J C R、M o o d y ' s、S & Pとします。 2.国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。 3.ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。

主な投資制限	1.株式への投資割合は、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は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 3.同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 5.投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 6.外貨建て資産への投資は行いません。 7.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。 8.一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

（参考）各ファンドが投資する可能性のある上場投資信託証券の概要

※以下は2026年6月時点で投資する可能性のある上場投資信託証券を記載していますが、適宜見直しを行うため変更される場合があります。

投資対象資産	投資対象ファンド	運用の方針	信託報酬 (税抜) %	運用会社／管理会社
--------	----------	-------	----------------	-----------

株式	国内株式	NEXT FUNDS 日経平均高配当株50指数連動型上場投信	主としてわが国の株式の中から東京証券取引所プライム市場に上場する225銘柄のうち予想配当利回りが高いと判断される原則50銘柄に投資を行います。	0.28	野村アセットマネジメント株式会社
		iシェアーズ MSCI ジャパン高配当利回りETF	主としてわが国の取引所に上場する大型・中型株の中から配当利回りが高いと判断される銘柄に投資を行います。	0.19	ブラックロック・ジャパン株式会社
		グローバルX MSCI スーパーディビデンドー日本株式ETF	主としてわが国の株式および不動産投資信託証券の中から配当利回りが高いと判断される原則25銘柄に投資を行います。	0.39	Global X Japan 株式会社
		iシェアーズ MSCI 日本株最小分散ETF	主としてわが国の取引所に上場する大型・中型株の中から最適化によりポートフォリオのリスクが最小となると判断される銘柄に投資を行います。	0.19	ブラックロック・ジャパン株式会社
		iシェアーズ・コア 日経225 ETF	主としてわが国の株式の中から東京証券取引所プライム市場に上場する原則225銘柄に投資を行います。	0.045	ブラックロック・ジャパン株式会社
		iシェアーズ・コア TOPIX ETF	主としてわが国の株式の中から東京証券取引所の主要市場に上場する銘柄に投資を行います。	0.045	ブラックロック・ジャパン株式会社
	海外株式	バンガード・S&P500ETF	主として米国の取引所に上場する代表的な原則500銘柄に投資を行います。	0.03	Vanguard Capital Management
		バンガード・米国バリューETF	主として米国の大型株の中から割安と判断される銘柄に投資を行います。	0.03	Vanguard Portfolio Management

バンガード・米国高配当株式ETF	主として米国の株式の中から配当利回りが高いと判断される銘柄に投資を行います。	0.04	Vanguard Portfolio Management
iシェアーズMSCIEAFEバリュートETF	主として北米を除く先進国の大型および中型株式の中から割安と判断される銘柄に投資を行います。	0.31	BlackRock Fund Advisors
バンガード・米国スモールキャップ・バリュートETF	主として米国の小型株の中から割安と判断される銘柄に投資を行います。	0.05	Vanguard Portfolio Management
バンガード・米国グロースETF	主として米国の大型株の中から成長性が高いと判断される銘柄に投資を行います。	0.03	Vanguard Portfolio Management
インベスコNASDAQ100ETF	主として米国のナスダック市場に上場する株式に投資を行います。	0.15	Invesco Capital Management LLC
iシェアーズMSCIEAFEグロースETF	主として北米を除く先進国の大型および中型株式の中から成長性が高いと判断される銘柄に投資を行います。	0.34	BlackRock Fund Advisors
バンガード・米国スモールキャップ・グロースETF	主として米国の小型株の中から成長性が高いと判断される銘柄に投資を行います。	0.05	Vanguard Portfolio Management
iシェアーズMSCI米国ミニマム・ボラティリティ・ファクターETF	主として米国の大型および中型株式の中から価格変動性が低いと判断される銘柄に投資を行います。	0.15	BlackRock Fund Advisors
iシェアーズMSCIEAFEミニマム・ボラティリティ・ファクターETF	主として北米を除く先進国の大型および中型株式の中から価格変動性が低いと判断される銘柄に投資を行います。	0.20	BlackRock Fund Advisors
	主として米国の大型および中型株式の中から同業		

iシェアーズ M S C I 米 国クオリティ・ファクター E T F	他社と比較してより利益 の質が高いと判断される 銘柄に投資を行います。	0.15	BlackRock Fund Advisors
iシェアーズ M S C I 米 国モメンタム・ファクター E T F	主として米国の大型およ び中型株式の中から株価 が上昇トレンドにあると 判断される銘柄に投資を 行います。	0.15	BlackRock Fund Advisors
バンガード・スモール キャップ E T F	主として米国の小型株に 投資を行います。	0.03	Vanguard Portfolio Management
S t a t e S t r e e t [®] 一般消費財セレクト・セク ター S P D R [®] E T F	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中から一般消費財セク ターに属する銘柄に投資 を行います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
S t a t e S t r e e t [®] 生活必需品セレクト・セク ター S P D R [®] E T F	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中から生活必需品セク ターに属する銘柄に投資 を行います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
S t a t e S t r e e t [®] エネルギー・セレクト・セ クター S P D R [®] E T F	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中からエネルギーセク ターに属する銘柄に投資 を行います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
S t a t e S t r e e t [®] 金融セレクト・セクター S P D R [®] E T F	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中から金融セクターに 属する銘柄に投資を行 います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
S t a t e S t r e e t [®] 資本財セレクト・セクター S P D R [®] E T F	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中から資本財セクター に属する銘柄に投資を行 います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中からテクノロジーセ	0.08	State Street Global Advisors

		State Street [®] テクノロジー・セレクト・ セクター SPDR [®] ETF	クターに属する銘柄に投資を行います。		Funds Management Inc.
		State Street [®] ヘルスケア・セレクト・セ クター SPDR [®] ETF	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中からヘルスケアセク ターに属する銘柄に投資 を行います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		State Street [®] 公益事業セレクト・セク ター SPDR [®] ETF	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中から公益事業セク ターに属する銘柄に投資 を行います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		State Street [®] 素材セレクト・セクター SPDR [®] ETF	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中から素材セクターに 属する銘柄に投資を行 います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		State Street [®] コミュニケーション・サー ビス・セレクト・セクター SPDR [®] ETF	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中からコミュニケーション・サー ビスセクターに属する銘柄に投資 を行います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		State Street [®] 不動産セレクト・セクター SPDR [®] ETF	主として米国の取引所に 上場する代表的な500銘柄 の中から不動産セクター に属する銘柄に投資を行 います。	0.08	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		iシェアーズ ストックス欧 州600 UCITS ET F	主として欧州の先進国の 株式の中から原則主要600 銘柄に投資を行います。	0.20	BlackRock Asset Management Deutschland AG

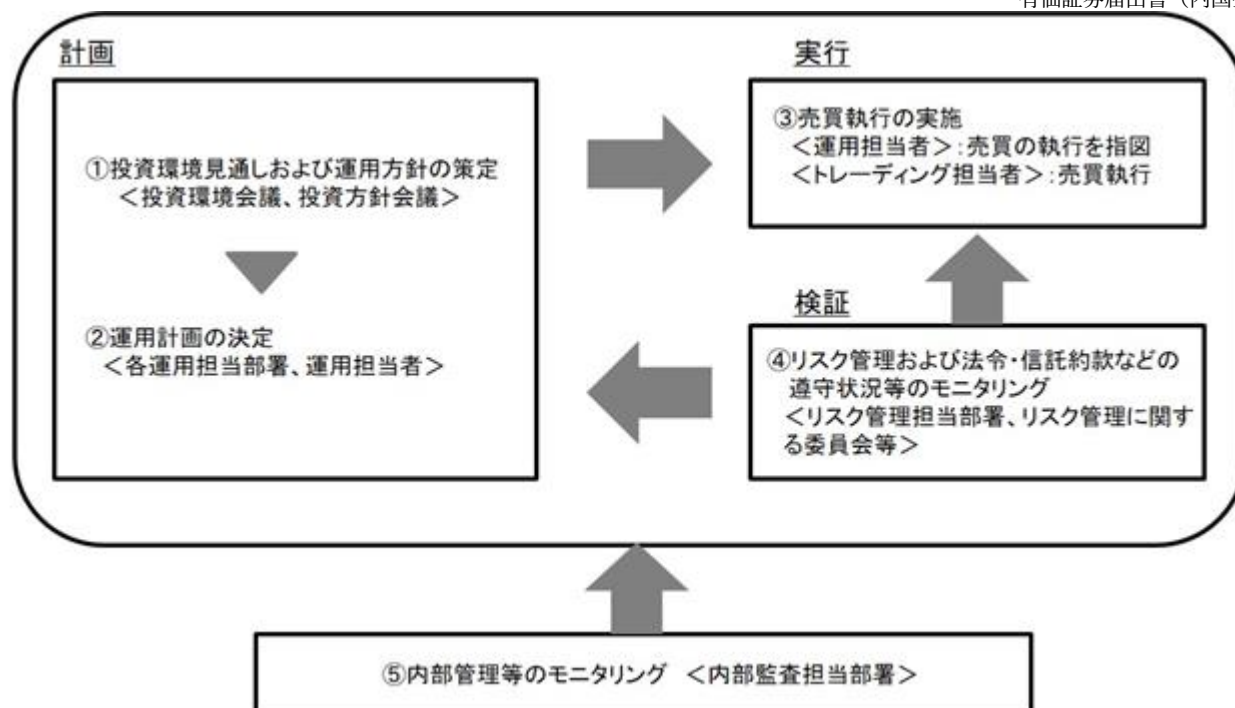
債券	世界債券	バンガード・米国短期債券ETF	主として残存期間が1-5年の米国の債券に投資を行います。	0.03	Vanguard Capital Management
		State Street® SPDR® ポートフォリオ 米国短期国債ETF	主として残存期間が1-3年の米国国債に投資を行います。	0.03	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		State Street® SPDR® ポートフォリオ 米国中期国債ETF	主として残存期間が3-10年の米国国債に投資を行います。	0.03	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		State Street® SPDR® ポートフォリオ 米国長期国債ETF	主として残存期間が10年以上の米国国債に投資を行います。	0.03	State Street Global Advisors Funds Management Inc.
		バンガード・超長期米国債ETF	主として残存期間が20-30年の米国のストリップス債に投資を行います。	0.05	Vanguard Capital Management
		iシェアーズ 米国国債 3－7年ETF	主として残存期間が3-7年の米国国債に投資を行います。	0.15	BlackRock Fund Advisors
		iシェアーズ 米国国債 7－10年ETF	主として残存期間が7-10年の米国国債に投資を行います。	0.15	BlackRock Fund Advisors
		iシェアーズ 米国地方債ETF	主として米国の投資適格地方債に投資を行います。	0.05	BlackRock Fund Advisors
	新興国債券	ヴァンエック J. P. モルガンEM現地通貨建て債券ETF	主として新興国の現地通貨建て国債に投資を行います。	0.30	Van Eck Associates Corporation
		iシェアーズ J. P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	主として新興国の米ドル建て債券に投資を行います。	0.39	BlackRock Fund Advisors 副投資顧問会社： BlackRock International Limited

	iシェアーズ J. P. モルガン・現地通貨建てエマージング・マーケット債券 E T F	主として新興国の現地通貨建て国債に投資を行います。	0.30	BlackRock Fund Advisors 副投資顧問会社： BlackRock International Limited、 BlackRock (Singapore) Limited
世界社債	iシェアーズ ブロード米ドル建て投資適格社債 E T F	主として米ドル建て投資適格社債に投資を行います。	0.04	BlackRock Fund Advisors
	バンガード・米国短期社債 E T F	主として残存期間が1-5年の米国の投資適格社債に投資を行います。	0.03	Vanguard Capital Management
	バンガード・米国中期社債 E T F	主として残存期間が5-10年の米国の投資適格社債に投資を行います。	0.03	Vanguard Capital Management
	バンガード・米国長期社債 E T F	主として残存期間が10年超の米国の投資適格社債に投資を行います。	0.03	Vanguard Capital Management
	iシェアーズ 米ドル建て社債 1－5年 E T F	主として残存期間が1-5年の米ドル建て投資適格社債に投資を行います。	0.04	BlackRock Fund Advisors
	iシェアーズ J. P. モルガン・新興国市場社債 E T F	主として新興国の米ドル建て社債に投資を行います。	0.50	BlackRock Fund Advisors 副投資顧問会社： BlackRock International Limited
ハイイールド債券	iシェアーズ ブロード米ドル建てハイイールド社債 E T F	主として米ドル建てハイイールド社債に投資を行います。	0.08	BlackRock Fund Advisors
	iシェアーズ 0－5年ハイイールド社債 E T F	主として残存期間が0-5年の米ドル建てハイイールド社債に投資を行います。	0.30	BlackRock Fund Advisors
物価				

	連動債	シュワブ米国TIPS ETF	主として米国の物価連動国債に投資を行います。	0.03	Charles Schwab Investment Management, Inc.
		バンガード・米国短期インフレ連動債ETF	主として残存期間が0-5年の米国のインフレ連動国債に投資を行います。	0.03	Vanguard Capital Management
	MBS	iシェアーズ 米国MBS ETF	主として米国政府機関が発行もしくは保証する投資適格モーゲージ・パススルー証券に投資を行います。	0.04	BlackRock Fund Advisors
	バンクローン	インベスコ・シニア・ローンETF	主として米国のレバレッジドローン（貸付債権）に投資を行います。	0.65	Invesco Capital Management LLC 副投資顧問会社： Invesco Senior Secured Management, Inc.
コモディティ	コモディティ	アバディーン・ブルームバーグ全商品ストラテジーK-1フリーETF	主としてケイマン籍外国投資法人を通じて、上場商品先物契約に投資を行います。	0.26	abrdn Inc. 副投資顧問会社： Vident Asset Management
		SPDR [®] ゴールド・ミニシェアーズ・トラスト	主として金現物に投資を行います。	0.10	WGC USA Asset Management Company, LLC

（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原則として月次で開催する「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、運用担当部署の部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リスク管理担当部署（人数20～40人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数5～15人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2026年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年6月28日（休業日の場合は翌営業日。））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）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。

「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（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には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（３）投資制限）

③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）

④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）

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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（３）投資制限）

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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（３）投資制限）

⑦一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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）

⑧投資する株式等の範囲（約款第19条の2）

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。

⑨信用取引の指図範囲（約款第20条の2）

- 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との指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証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（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑩先物取引等の運用指図（約款第20条の3）

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

⑪スワップ取引の運用指図（約款第20条の4）

- 1) 委託会社は、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または価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。

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

⑫金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第20条の5）

- 1)委託会社は、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または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑬デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第20条の6）

デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業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。

⑭有価証券の貸付の指図および範囲（約款第20条の7）

- 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、投資信託証券（金融商品取引所に上場されているものに限り、以下⑭において同じ。）および公社債を次の1.～3.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - 1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2.投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 - 3.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2)上記1)1.～3.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑮公社債の空売りの指図および範囲（約款第20条の8）

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

⑯公社債の借入れの指図および範囲（約款第21条）

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

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

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

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑰特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第22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。

⑱外国為替予約取引の指図（約款第23条）

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

2)委託会社は、外国為替の売買の予約取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑲資金の借入れ（約款第29条）

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

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

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑳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>

各ファンドは、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、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。各ファンドは、国内外の株式、債券、リートおよびコモディティ等に資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数またはすべての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

○不動産投資信託証券（リート）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、関係法令・規制等の変更等の影響を受けます。また、老朽化・災害等の発生による保有不動産の滅失・損壊等が発生する可能性があります。各ファンドが実質的に投資するリーートの市場価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

○コモディティ市況の変動リスク

コモディティ価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

コモディティ価格は商品の需給関係の変化、為替、金利の変化等様々な要因で変動します。需給関係は、天候、作況、生産国の政治・経済情勢等の変化、貿易動向等の影響を大きく受けます。各ファンドが、実質的にコモディティに投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が変動します。

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。各ファンドおよび指定マザーファンド等は、各々の運用方針に基づき、実質組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行う場合があります。

為替ヘッジを行わない実質組入外貨建資産については、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基準価額が下がる要因となります。

為替ヘッジを行う場合は、為替リスクは低減されますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジには、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

○信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。各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、各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、基準価額が下落する要因となります。

○流動性リスク

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

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

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。各ファンドは実質的に新興国の株式、債券にも投資を行う場合があります。新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式市場、債券市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々の規制の導入や政策の変更等の要因も株式市場、債券市場や為替市場に著しい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＞

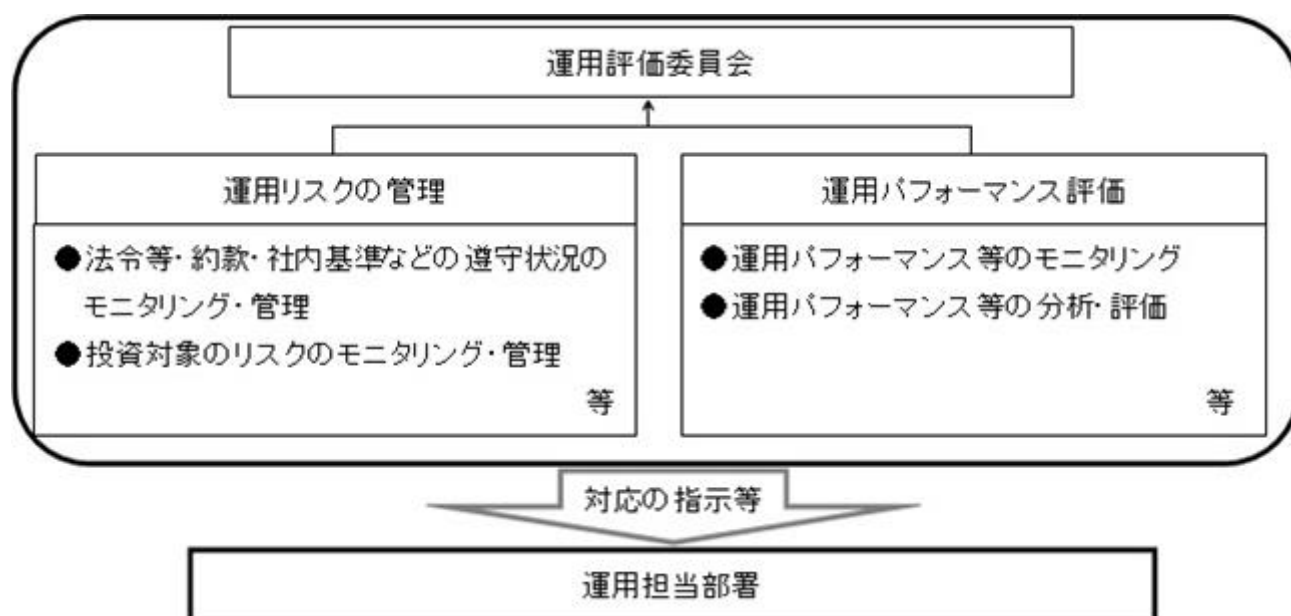
- 各ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 各ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。
 - ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
 - ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。
 - ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
- 各ファンドは、一部マザーファンドに投資を行います。そのため、各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、各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、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）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（スイッチングのお申込みを含みます。）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。
- 各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。
- 「マスターズ・マルチアセット・ファンド」を構成する各ファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 注意事項
 - ・各ファンドは、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。

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



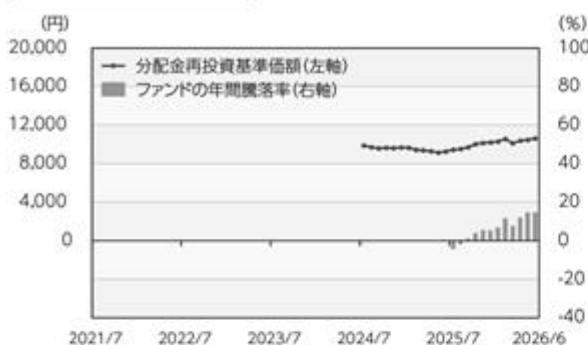
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2026年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

安 定 型



バ ラ ン ス 型



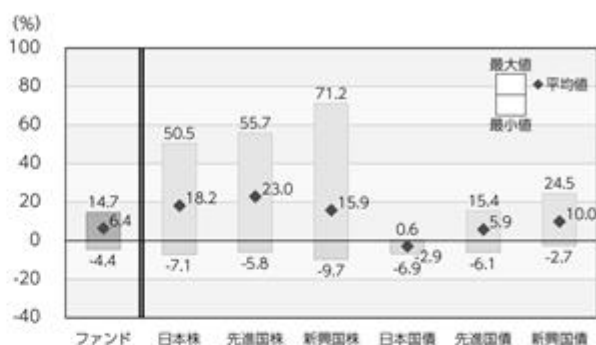
積 極 型



*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。

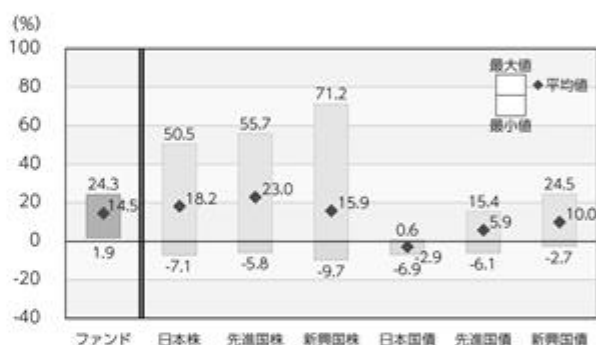
*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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



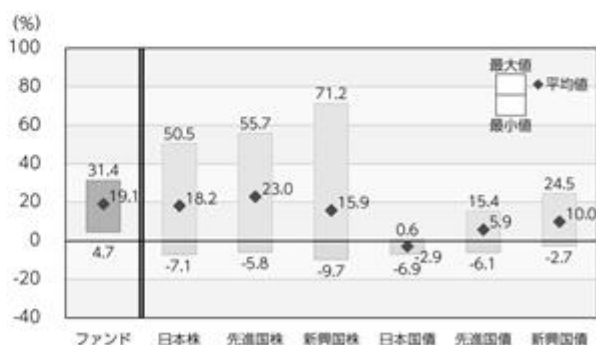
ファンド:2025年7月～2026年6月

代表的な資産クラス:2021年7月～2026年6月



ファンド:2025年7月～2026年6月

代表的な資産クラス:2021年7月～2026年6月



ファンド:2025年7月～2026年6月

代表的な資産クラス:2021年7月～2026年6月

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

※償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

※「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

各ファンド

以下により計算される①と②の合計額とします。

①各ファンドの日々の純資産総額に対して、それぞれ以下の率を乗じて得た額

信託報酬率	安定型	バランス型	積極型
総額	年率0.99% (税抜0.90%)	年率1.21% (税抜1.10%)	年率1.43% (税抜1.30%)
内訳（税抜）			
委託会社	年率0.435%	年率0.535%	年率0.635%
販売会社	年率0.435%	年率0.535%	年率0.635%
受託会社	年率0.030%	年率0.030%	年率0.030%

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※委託会社の信託報酬には、指定マザーファンドの投資顧問会社に対する報酬が含まれます。

②投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合は、マザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に55%（税抜50%）未満の率^{*}を乗じて得た額

※2026年9月29日現在は、品貸料の49.5%（税抜45%）以内になります。

委託会社と受託会社が受け取る品貸料の配分は1:1の割合となります。

品貸料はファンドの収益として計上され、その収益の一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取ります。

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

上場投資信託証券

投資対象とする上場投資信託証券の純資産総額に対して最大年率0.65%^{*}

※2026年6月現在。投資する銘柄・組入比率などは固定されておらず、実際の組入銘柄・組入状況等により変動する場合があります。

実質的な負担	各ファンドの日々の純資産総額に対して、それぞれ以下のとおりの料率を乗じて得た額	
	ファンド	料率
	安定型	最大年率1.64%（税抜1.55%）
	バランス型	最大年率1.86%（税抜1.75%）
	積極型	最大年率2.08%（税抜1.95%）
※2026年6月現在。上記はファンドの信託報酬率と投資対象とする上場投資信託証券の信託報酬を合わせた実質的な信託報酬率です。ただし、投資対象とする上場投資信託証券の信託報酬は、投資対象とする上場投資信託証券のうち信託報酬率が最も高いものを最大まで組み入れる条件で算出したものであり、実際の組入銘柄・組入状況等により変動する場合があります。 なお、投資対象とする上場投資信託証券は適宜見直しを行うため変更される可能性があることなどから、実質的な信託報酬率は変動する場合があります。 ※有価証券の貸付を行った場合は、上記の各ファンド欄に記載の②が加算されます。		

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

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。

・その他の費用

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

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

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

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

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

※上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

※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）の費用は表示していません。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇各ファンドは、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%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%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%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

○法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%）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、2026年6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、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

… (参考情報) ファンドの総経費率 …

ファンド名	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①		その他費用の比率②
		運用管理費用の比率①		
安定型	1.04%	0.99%		0.05%
バランス型	1.25%	1.21%		0.03%
積極型	1.47%	1.43%		0.04%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2025年7月1日～2026年6月29日

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

※投資対象とする上場投資信託証券(以下、投資先ファンドといいます。)にかかる費用は、その他費用(②)に含めています。

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

※なお、各ファンドについては、投資先ファンドも含め入手し得る情報において計算に含まれていない費用は認識しておりません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

（１）【投資状況】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	640,902,259	55.07
内 アメリカ	640,902,259	55.07
親投資信託受益証券	232,639,476	19.99
内 日本	232,639,476	19.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	290,178,422	24.94
純資産総額	1,163,720,157	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。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	939,177,594	24.24
内 アメリカ	939,177,594	24.24
親投資信託受益証券	2,332,875,822	60.21
内 日本	2,332,875,822	60.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	602,561,736	15.55
純資産総額	3,874,615,152	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。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	524,925,611	37.63
内 アメリカ	524,925,611	37.63
親投資信託受益証券	853,215,208	61.16
内 日本	853,215,208	61.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	16,972,490	1.22
純資産総額	1,395,113,309	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

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	865,142,801,870	97.05
内 日本	865,142,801,870	97.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	26,262,556,384	2.95
純資産総額	891,405,358,254	100.00

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	26,499,860,000	2.97

内 日本	26,499,860,000	2.97
------	----------------	------

（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

2026年6月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		2,781,104,135,112	97.10
	内 アメリカ	2,061,914,641,439	71.99
	内 カナダ	101,843,570,049	3.56
	内 イギリス	100,731,274,478	3.52
	内 スイス	77,620,692,472	2.71
	内 フランス	63,694,302,566	2.22
	内 ドイツ	62,495,453,851	2.18
	内 オランダ	57,872,489,647	2.02
	内 アイルランド	46,615,121,378	1.63
	内 オーストラリア	45,104,077,798	1.57
	内 スペイン	27,968,493,125	0.98
	内 スウェーデン	21,942,480,848	0.77
	内 イタリア	21,597,957,059	0.75
	内 デンマーク	12,310,759,429	0.43
	内 シンガポール	12,116,235,240	0.42
	内 香港	9,354,248,797	0.33
	内 フィンランド	8,712,660,049	0.30
	内 イスラエル	8,165,866,689	0.29
	内 ケイマン諸島	7,060,464,728	0.25
	内 ベルギー	6,448,951,950	0.23
	内 ジャージー	4,587,378,055	0.16
	内 ノルウェー	4,229,797,034	0.15
	内 ルクセンブルグ	4,205,027,548	0.15
	内 バミューダ	3,994,486,972	0.14
	内 リベリア	2,754,626,714	0.10
	内 オーストリア	2,594,126,514	0.09
	内 オランダ領キュラソー	2,337,273,790	0.08
	内 ニュージーランド	1,562,260,210	0.05
	内 ポルトガル	1,269,416,683	0.04
新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		3,079,943,810	0.11
	内 オーストラリア	2,438,818,008	0.09
	内 シンガポール	641,125,802	0.02
投資証券		40,292,350,866	1.41
	内 アメリカ	38,216,919,309	1.33
	内 フランス	975,462,461	0.03
	内 イギリス	719,655,030	0.03
	内 香港	380,314,066	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		39,782,586,254	1.39
純資産総額		2,864,259,016,042	100.00

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	41,792,858,170	1.46
内 アメリカ	32,093,393,494	1.12
内 ドイツ	5,503,293,576	0.19
内 カナダ	2,016,096,753	0.07
内 イギリス	1,540,355,839	0.05
内 オーストラリア	639,718,508	0.02

（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。

NASDAQ100インデックス・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,341,701,231	94.83
内 アメリカ	1,271,536,725	89.87
内 アイルランド	26,839,419	1.90
内 オランダ	20,662,363	1.46
内 イギリス	11,308,680	0.80
内 カナダ	8,308,859	0.59
内 ケイマン諸島	3,045,185	0.22
投資信託受益証券	98,534,848	6.96
内 アメリカ	98,534,848	6.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	△25,377,959	△1.79
純資産総額	1,414,858,120	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。

グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	5,158,584,931	98.59
内 アメリカ	3,282,018,106	62.73
内 日本	690,027,800	13.19
内 カナダ	551,477,743	10.54
内 イギリス	205,225,483	3.92
内 アイルランド	153,110,418	2.93
内 ノルウェー	105,335,122	2.01
内 オーストラリア	74,648,421	1.43
内 イタリア	60,547,672	1.16
内 台湾	36,194,166	0.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	73,627,140	1.41
純資産総額	5,232,212,071	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		210,203,592,891	96.70
	内 台湾	56,066,245,640	25.79
	内 韓国	49,895,949,097	22.95
	内 インド	23,898,601,645	10.99
	内 ケイマン諸島	20,855,996,647	9.59
	内 中国	18,839,048,763	8.67
	内 ブラジル	6,707,487,418	3.09
	内 南アフリカ	5,334,799,268	2.45
	内 サウジアラビア	5,131,010,615	2.36
	内 メキシコ	2,609,456,697	1.20
	内 アラブ首長国連邦	2,434,821,237	1.12
	内 タイ	2,042,075,542	0.94
	内 マレーシア	1,931,369,883	0.89
	内 ポーランド	1,913,855,779	0.88
	内 香港	1,714,421,791	0.79
	内 クエート	1,101,705,522	0.51
	内 ギリシャ	1,038,630,181	0.48
	内 カタール	1,021,913,634	0.47
	内 インドネシア	953,636,227	0.44
	内 チリ	940,745,847	0.43
	内 トルコ	793,711,048	0.37
	内 ハンガリー	715,324,079	0.33
	内 イギリス	694,797,830	0.32
	内 バミューダ	678,717,243	0.31
	内 フィリピン	608,611,203	0.28
	内 アメリカ	508,624,099	0.23
	内 スイス	357,754,722	0.16
	内 コロンビア	302,785,504	0.14
	内 ルクセンブルグ	242,564,907	0.11
	内 チェコ	224,428,697	0.10
	内 ロシア	157,627,942	0.07
	内 オランダ	148,650,745	0.07
	内 エジプト	122,603,560	0.06
	内 ペルー	76,012,037	0.03
	内 カナダ	62,460,324	0.03
	内 シンガポール	41,808,312	0.02
	内 イギリス領バージン諸島	35,339,206	0.02
	内 キプロス	0	0.00
投資信託受益証券		1,105,853,115	0.51
	内 メキシコ	808,496,925	0.37
	内 ブラジル	297,356,190	0.14
投資証券		154,913,702	0.07
	内 メキシコ	154,913,702	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,912,629,534	2.72
純資産総額		217,376,989,242	100.00

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,075,906,292	2.80
内 アメリカ	6,075,906,292	2.80

（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

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	392,921,714,600	87.74
内 日本	392,921,714,600	87.74
地方債証券	22,419,210,022	5.01
内 日本	22,419,210,022	5.01
特殊債券	16,616,943,175	3.71
内 日本	16,616,943,175	3.71
社債券	13,770,420,000	3.08
内 日本	13,475,022,000	3.01
内 フランス	295,398,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,076,811,246	0.46
純資産総額	447,805,099,043	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

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	335,469,453,833	98.61
内 アメリカ	151,210,788,919	44.45
内 中国	42,533,190,792	12.50
内 フランス	23,547,360,416	6.92
内 イタリア	21,778,518,809	6.40
内 イギリス	19,123,784,157	5.62
内 ドイツ	18,961,093,700	5.57
内 スペイン	13,952,687,429	4.10
内 カナダ	6,993,628,522	2.06
内 ベルギー	5,100,065,045	1.50
内 オーストラリア	4,297,233,495	1.26
内 オランダ	4,081,157,343	1.20
内 オーストリア	3,473,792,036	1.02
内 メキシコ	3,080,540,063	0.91
内 ポーランド	2,389,526,253	0.70
内 韓国	2,239,094,496	0.66
内 ポルトガル	1,895,633,229	0.56
内 フィンランド	1,751,987,119	0.51
内 マレーシア	1,630,068,505	0.48
内 イスラエル	1,447,454,327	0.43
内 アイルランド	1,370,536,855	0.40
内 シンガポール	1,211,829,561	0.36
内 ニュージーランド	927,450,818	0.27

内 スロバキア	693,051,883	0.20
内 デンマーク	659,294,016	0.19
内 スウェーデン	587,115,728	0.17
内 ノルウェー	532,570,317	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,745,667,984	1.39
純資産総額	340,215,121,817	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	264,331,589,329	99.65
内 アメリカ	118,907,690,294	44.83
内 中国	33,680,629,778	12.70
内 フランス	18,542,449,761	6.99
内 イタリア	17,209,714,839	6.49
内 イギリス	15,004,388,931	5.66
内 ドイツ	14,929,329,783	5.63
内 スペイン	11,001,631,950	4.15
内 カナダ	5,499,464,718	2.07
内 ベルギー	3,993,869,137	1.51
内 オーストラリア	3,411,684,377	1.29
内 オランダ	3,215,384,063	1.21
内 オーストリア	2,712,289,858	1.02
内 メキシコ	2,425,580,732	0.91
内 ポーランド	1,891,263,561	0.71
内 韓国	1,840,042,032	0.69
内 ポルトガル	1,463,958,288	0.55
内 フィンランド	1,388,543,455	0.52
内 マレーシア	1,333,694,887	0.50
内 イスラエル	1,166,831,657	0.44
内 アイルランド	1,086,633,770	0.41
内 シンガポール	977,770,320	0.37
内 ニュージーランド	737,293,037	0.28
内 デンマーク	529,158,629	0.20
内 スロバキア	509,174,637	0.19
内 スウェーデン	456,492,433	0.17
内 ノルウェー	416,624,402	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	938,890,416	0.35
純資産総額	265,270,479,745	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

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	191,892,918,250	97.37
内 日本	191,892,918,250	97.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,193,162,304	2.63

純資産総額	197,086,080,554	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	5,106,887,500	2.59
内 日本	5,106,887,500	2.59

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	ISHARES BROAD USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	30,498	6,000.31 182,997,469	6,013.30 183,393,675	— —	15.76
2	為替フルヘッジ外国債券 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	157,152,462	1.1512 180,929,629	1.1513 180,929,629	— —	15.55
3	ISHARES J.P. MORGAN EM CORPORATE BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	18,923	7,413.10 140,278,157	7,426.90 140,539,353	— —	12.08
4	ISHARES NATIONAL MUNI BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	4,020	17,473.16 70,242,119	17,491.02 70,313,928	— —	6.04
5	ISHARES 1-5 YEAR INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	8,000	8,518.97 68,151,835	8,522.22 68,177,817	— —	5.86
6	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	46,915,122	1.1065 51,916,274	1.1022 51,709,847	— —	4.44
7	ISHARES 3-7 YEAR TREASURY BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	2,272	19,131.16 43,466,008	19,126.29 43,454,940	— —	3.73
8	ISHARES 7-10 YEAR TREASURY BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	2,638	15,431.92 40,709,409	15,436.79 40,722,260	— —	3.50
9	SPDR PORTFOLIO LONG TERM TREASURY ETF アメリカ	投資信託受益証券	9,073	4,301.71 39,029,424	4,306.58 39,073,625	— —	3.36
10	VANECK J. P. MORGAN EM LOCAL CURRENCY BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	8,536	4,145.81 35,388,691	4,155.56 35,471,861	— —	3.05

11	SPDR GOLD MINISHARES TRUST アメリカ	投資信託受益証券	1,195	13,090.25 15,642,858	12,901.88 15,417,753	— —	1.32
12	SPDR PORTFOLIO SHORT TERM TREASURY ETF アメリカ	投資信託受益証券	920	4,714.18 4,337,047	4,714.18 4,337,047	— —	0.37

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	55.07
親投資信託受益証券	19.99
合計	75.06

（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。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	国内株式パッシブ・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	126,587,151	7.3737 933,428,334	7.3973 936,403,132	— —	24.17
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	45,489,299	13.5446 616,138,908	13.7372 624,895,598	— —	16.13
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	458,581,413	1.1512 527,964,780	1.1513 527,964,780	— —	13.63
4	ISHARES BROAD USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	45,000	6,000.31 270,013,972	6,013.30 270,598,576	— —	6.98
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	46,523,027	3.1114 144,756,398	3.1234 145,310,022	— —	3.75
6	ISHARES MSCI USA MOMENTUM FACTOR ETF アメリカ	投資信託受益証券	1,522	52,896.91 80,509,110	54,563.03 83,044,946	— —	2.14
7	SPDR GOLD MINISHARES TRUST アメリカ	投資信託受益証券	6,384	13,090.25 83,568,206	12,901.88 82,365,637	— —	2.13
8	VANGUARD VALUE ETF アメリカ	投資信託受益証券	2,182	35,538.82 77,545,724	35,503.32 77,468,256	— —	2.00

9	STATE STREET TECHNOLOGY SELECT SECTOR SPDR ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	2,105	29,410.45 61,909,003	30,108.72 63,378,876	— —	1.64
10	ENERGY SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	7,081	8,717.44 61,728,251	8,700.85 61,610,762	— —	1.59
11	REAL ESTATE SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	7,373	7,346.52 54,165,918	7,294.55 53,782,782	— —	1.39
12	MATERIALS SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	6,464	8,379.32 54,163,950	8,226.67 53,177,242	— —	1.37
13	HEALTH CARE SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	1,931	26,037.61 50,278,629	26,102.56 50,404,059	— —	1.30
14	UTILITIES SELECT SECTOR SPDR FUND ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	6,704	7,492.99 50,233,006	7,473.18 50,100,251	— —	1.29
15	CONSUMER STAPLES SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	2,812	13,724.11 38,592,201	13,700.84 38,526,774	— —	0.99
16	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	12,725,900	2.7754 35,320,735	2.7882 35,482,354	— —	0.92
17	FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	4,003	8,708.48 34,860,079	8,723.59 34,920,533	— —	0.90
18	J－REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12,974,847	2.6458 34,330,147	2.6357 34,197,804	— —	0.88
19	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	25,806,163	1.1065 28,557,099	1.1022 28,443,552	— —	0.73
20	CONSUMER DISCRETIONARY SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	1,041	18,572.54 19,334,018	19,019.11 19,798,900	— —	0.51
21	グローバル中小型株式クオ リティグロースマザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	55,223	3.1982 176,619	3.2338 178,580	— —	0.00

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	24.24
親投資信託受益証券	60.21
合計	84.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・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	67,049,994	7.3737 494,413,245	7.3973 495,988,920	— —	35.55
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	15,834,354	13.5446 214,471,574	13.7372 217,519,687	— —	15.59
3	STATE STREET TECHNOLOGY SELECT SECTOR SPDR ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	2,316	29,410.45 68,114,608	30,108.72 69,731,818	— —	5.00
4	ENERGY SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	7,950	8,725.11 69,364,669	8,700.85 69,171,806	— —	4.96
5	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	21,597,204	3.1114 67,199,700	3.1234 67,456,706	— —	4.84
6	ISHARES MSCI USA MOMENTUM FACTOR ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	1,051	52,896.91 55,594,661	54,563.03 57,345,755	— —	4.11
7	為替フルヘッジ外国債券 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	49,154,213	1.1512 56,591,245	1.1513 56,591,245	— —	4.06
8	HEALTH CARE SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	2,082	26,037.61 54,210,309	26,102.56 54,345,547	— —	3.90
9	UTILITIES SELECT SECTOR SPDR FUND ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	7,227	7,488.79 54,121,503	7,473.18 54,008,728	— —	3.87
10	REAL ESTATE SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	7,380	7,346.52 54,217,344	7,294.55 53,833,843	— —	3.86
11	MATERIALS SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	6,304	8,336.57 52,553,770	8,226.67 51,860,974	— —	3.72
12	SPDR GOLD MINISHARES TRUST アメリカ	投資信 託受益 証券	3,144	13,090.25 41,155,770	12,901.88 40,563,528	— —	2.91
13	CONSUMER STAPLES SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	2,122	13,723.93 29,122,191	13,700.84 29,073,191	— —	2.08
14	FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信 託受益 証券	3,036	8,709.43 26,441,833	8,723.59 26,484,821	— —	1.90

15	CONSUMER DISCRETIONARY SELECT SECTOR SPDR FUND アメリカ	投資信託受益証券	973	18,572.54 18,071,085	19,019.11 18,505,600	— —	1.33
16	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,347,711	2.6458 14,149,508	2.6357 14,094,961	— —	1.01
17	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	447,717	2.7754 1,242,638	2.7882 1,248,324	— —	0.09
18	グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	95,964	3.1982 306,921	3.2338 310,328	— —	0.02
19	NASDAQ100インデックス・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,508	1.9565 4,907	2.0085 5,037	— —	0.00

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	37.63
親投資信託受益証券	61.16
合計	98.78

（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

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,637,800	2,955.24 28,482,079,931	3,207.00 30,908,424,600	— —	3.47
2	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	325,700	40,693.56 13,253,895,104	77,150.00 25,127,755,000	— —	2.82
3	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,246,500	3,717.78 30,658,736,358	2,725.00 22,471,712,500	— —	2.52
4	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,330,100	5,973.17 19,891,279,519	6,346.00 21,132,814,600	— —	2.37
5	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	2,982,100	4,246.01 12,662,051,291	5,963.00 17,782,262,300	— —	1.99
6	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,945,200	5,793.02 22,854,622,909	4,471.00 17,638,989,200	— —	1.98

7	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,188,200	3,452.67 17,913,147,541	3,280.00 17,017,296,000	— —	1.91
8	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,480,500	3,299.45 4,884,845,360	11,395.00 16,870,297,500	— —	1.89
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,124,800	7,535.90 16,012,293,020	7,743.00 16,452,326,400	— —	1.85
10	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	467,000	27,322.38 12,759,552,681	32,340.00 15,102,780,000	— —	1.69
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,012,300	4,935.36 14,866,809,643	4,347.00 13,094,468,100	— —	1.47
12	キーエンス 日本	株式 電気機器	155,200	55,525.61 8,617,575,542	81,060.00 12,580,512,000	— —	1.41
13	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,110,100	7,154.69 7,942,421,519	11,330.00 12,577,433,000	— —	1.41
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,570,400	6,157.81 9,670,238,767	7,202.00 11,310,020,800	— —	1.27
15	三菱重工業 日本	株式 機械	2,935,500	4,961.43 14,564,297,946	3,666.00 10,761,543,000	— —	1.21
16	三井物産 日本	株式 卸売業	2,325,700	5,388.39 12,531,801,503	4,497.00 10,458,672,900	— —	1.17
17	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	5,516,400	2,067.15 11,403,279,759	1,854.00 10,227,405,600	— —	1.15
18	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,716,200	5,753.18 9,873,612,300	5,876.00 10,084,391,200	— —	1.13
19	信越化学工業 日本	株式 化学	1,381,700	5,314.11 7,342,515,058	7,008.00 9,682,953,600	— —	1.09
20	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	110,600	67,940.29 7,514,196,709	82,810.00 9,158,786,000	— —	1.03
21	キオクシアホールディングス 日本	株式 電気機器	95,000	19,304.31 1,833,910,248	89,680.00 8,519,600,000	— —	0.96
22	パナソニックホールディングス 日本	株式 電気機器	1,851,100	2,484.52 4,599,110,680	4,502.00 8,333,652,200	— —	0.93
23	フジクラ 日本	株式 非鉄金属	1,235,500	3,711.97 4,586,139,269	6,238.00 7,707,049,000	— —	0.86
24	HOYA 日本	株式 精密機器	291,200	27,447.76 7,992,789,164	25,950.00 7,556,640,000	— —	0.85
25	ルネサスエレクトロニクス 日本	株式 電気機器	1,519,100	3,089.23 4,692,861,502	4,807.00 7,302,313,700	— —	0.82
26	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,384,500	5,511.72 7,630,979,384	5,155.00 7,137,097,500	— —	0.80
27	任天堂 日本	株式 その他製品	970,500	8,656.02 8,400,671,160	6,815.00 6,613,957,500	— —	0.74
28	住友電気工業 日本	株式 非鉄金属	2,210,400	2,106.73 4,656,717,574	2,927.00 6,469,840,800	— —	0.73

29	NTT 日本	株式 情報・通信業	42,718,700	152.55 6,516,793,826	145.00 6,194,211,500	— —	0.69
30	ディスコ 日本	株式 機械	75,600	72,100.60 5,450,805,731	81,260.00 6,143,256,000	— —	0.69

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.05
合計	97.05

（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

2026年6月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
電気機器	国内	22.43
銀行業		11.14
卸売業		6.73
機械		6.00
情報・通信業		5.96
輸送用機器		4.71
化学		4.62
小売業		3.79
サービス業		3.32
保険業		3.21
医薬品		3.08
非鉄金属		2.78
食料品		2.62
建設業		2.10
精密機器		1.79
その他製品		1.75
陸運業		1.73
不動産業		1.61
その他金融業		1.17
電気・ガス業		1.14
ガラス・土石製品		0.87
証券、商品先物取引業		0.86
鉄鋼		0.60
ゴム製品		0.51
金属製品		0.49
海運業		0.46
石油・石炭製品		0.43
鉱業		0.31
繊維製品		0.29
空運業		0.25
倉庫・運輸関連業		0.12
パルプ・紙		0.11
水産・農林業		0.07

合計	97.05
----	-------

（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

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	4,815,572	29,799.94 143,503,780,290	31,661.17 152,466,683,708	— —	5.32
2	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	3,062,506	41,887.23 128,279,921,193	45,751.75 140,115,035,223	— —	4.89
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,471,791	65,266.55 96,058,721,514	59,852.08 88,089,756,060	— —	3.08
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	2,019,073	32,920.29 66,468,469,976	38,996.33 78,736,446,289	— —	2.75
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	1,214,935	50,261.86 61,064,901,738	57,429.22 69,772,773,652	— —	2.44
6	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	938,361	53,625.45 50,320,036,045	60,482.15 56,754,095,917	— —	1.98
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	964,659	50,029.78 48,261,681,226	57,044.35 55,028,354,501	— —	1.92
8	MICRON TECH INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	235,331	70,924.50 16,690,734,332	185,982.01 43,767,334,560	— —	1.53
9	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	458,229	103,678.96 47,508,706,175	91,360.61 41,864,082,792	— —	1.46

10	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	587,196	67,679.96 39,741,405,114	66,878.69 39,270,903,715	— —	1.37
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	167,590	168,867.64 28,300,527,880	199,728.33 33,472,471,277	— —	1.17
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	559,467	49,180.80 27,515,038,266	53,489.64 29,925,689,596	— —	1.04
13	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	340,250	35,916.72 12,220,663,990	87,607.78 29,808,547,519	— —	1.04
14	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	81,060	222,902.39 18,068,468,268	298,784.20 24,219,447,252	— —	0.85
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	290,122	80,597.07 23,382,984,174	80,545.43 23,368,004,143	— —	0.82
16	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	502,577	39,396.30 19,799,674,784	41,979.43 21,097,900,464	— —	0.74
17	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	917,020	7,951.74 7,291,911,539	21,390.01 19,615,067,703	— —	0.68
18	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	350,509	51,062.40 17,897,830,915	55,480.54 19,446,429,821	— —	0.68
19	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	867,201	24,085.32 20,886,817,928	22,094.78 19,160,618,259	— —	0.67
20	APPLIED MATERIALS INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	165,868	58,723.66 9,740,377,100	112,802.58 18,710,339,931	— —	0.65
21	LAM RESEARCH CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	260,931	38,919.97 10,155,426,919	66,727.67 17,411,318,939	— —	0.61
22	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	914,544	21,626.25 19,778,165,732	18,609.89 17,019,566,898	— —	0.59
23	CATERPILLAR INC アメリカ	株式 機械	97,107	126,596.65 12,293,421,639	167,779.72 16,292,585,668	— —	0.57
24	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	824,874	12,756.99 10,522,913,268	19,113.30 15,766,066,698	— —	0.55
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	369,382	37,420.76 13,822,557,407	41,297.40 15,254,516,539	— —	0.53

26	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	92,596	165,045.50 15,282,553,823	153,731.36 14,234,909,492	— —	0.50
27	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	170,622	84,056.95 14,341,965,971	82,760.43 14,120,751,725	— —	0.49
28	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,416,742	8,536.33 12,093,777,449	9,399.13 13,316,146,768	— —	0.46
29	GE AEROSPACE アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	218,268	51,266.10 11,189,750,904	60,686.76 13,245,979,237	— —	0.46
30	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	189,518	48,321.55 9,157,803,889	68,174.56 12,920,308,119	— —	0.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.10
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.11
投資証券	1.41
合計	98.61

（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。

投資株式の業種別投資比率

2026年6月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
半導体・半導体製造装置	外国	15.03
銀行		6.94
ソフトウェア		5.94
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.86
コンピュータ・周辺機器		5.77
医薬品		4.46
石油・ガス・消耗燃料		3.52
大規模小売り		3.16
資本市場		3.06
航空宇宙・防衛		2.69
保険		2.66
金融サービス		2.54
機械		1.97
電気設備		1.72
自動車		1.71
生活必需品流通・小売り		1.66

電力	1.64
バイオテクノロジー	1.58
金属・鉱業	1.57
ホテル・レストラン・レジャー	1.48
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	1.30
ヘルスケア機器・用品	1.28
専門小売り	1.28
化学	1.17
通信機器	1.13
飲料	1.01
各種電気通信サービス	1.00
電子装置・機器・部品	0.99
娯楽	0.96
情報技術サービス	0.96
陸上運輸	0.86
食品	0.77
総合公益事業	0.73
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.68
家庭用品	0.67
タバコ	0.66
繊維・アパレル・贅沢品	0.61
コングロマリット	0.54
建設・土木	0.52
建設関連製品	0.52
専門サービス	0.48
商業サービス・用品	0.44
商社・流通業	0.42
消費者金融	0.41
航空貨物・物流サービス	0.36
パーソナルケア用品	0.36
建設資材	0.29
エネルギー設備・サービス	0.22
不動産管理・開発	0.19
家庭用耐久財	0.18
無線通信サービス	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.16
容器・包装	0.14
メディア	0.13
ガス	0.11
運送インフラ	0.09
旅客航空輸送	0.08
自動車用部品	0.07
水道	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
海上運輸	0.04
紙製品・林産品	0.03
販売	0.02
各種消費者サービス	0.01
合計	97.10

（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。

NASDAQ100インデックス・マザーファンド

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	3,190	32,006.54 102,100,893	31,661.17 100,999,158	— —	7.14
2	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1 アメリカ	投資信 託受益 証券 —	838	116,279.95 97,442,605	117,583.35 98,534,848	— —	6.96
3	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,936	44,462.86 86,080,098	45,751.75 88,575,404	— —	6.26
4	MICRON TECH INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	410	92,589.84 37,961,838	185,982.01 76,252,627	— —	5.39
5	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	979	73,045.52 71,511,569	59,852.08 58,595,188	— —	4.14
6	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,418	38,288.48 54,293,074	38,996.33 55,296,802	— —	3.91
7	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	593	55,577.00 32,957,162	87,607.78 51,951,414	— —	3.67
8	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	768	50,856.48 39,057,784	57,429.22 44,105,643	— —	3.12
9	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	659	67,033.28 44,174,938	66,878.69 44,073,061	— —	3.12
10	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	719	50,701.31 36,454,242	57,044.35 41,014,894	— —	2.90

11	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,829	12,188.80 22,293,323	21,390.01 39,122,329	— —	2.77
12	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	625	61,518.24 38,448,903	60,482.15 37,801,347	— —	2.67
13	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	390	103,783.44 40,475,545	91,360.61 35,630,639	— —	2.52
14	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	1,775	19,660.57 34,897,529	18,609.89 33,032,561	— —	2.33
15	APPLIED MATERIALS INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	289	60,288.92 17,423,500	112,802.58 32,599,948	— —	2.30
16	LAM RESEARCH CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	455	39,296.55 17,879,933	66,727.67 30,361,092	— —	2.15
17	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	1,435	15,058.73 21,609,286	19,113.30 27,427,589	— —	1.94
18	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	161	156,006.37 25,117,026	153,731.36 24,750,749	— —	1.75
19	KLA CORPORATION アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	475	26,452.56 12,564,970	45,207.75 21,473,682	— —	1.52
20	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	1,533	16,209.57 24,849,284	11,981.13 18,367,078	— —	1.30
21	SANDISK CORP/DE アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	54	211,467.27 11,419,233	332,962.81 17,979,992	— —	1.27
22	PALO ALTO NETWORKS INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	297	36,814.13 10,933,799	53,913.47 16,012,303	— —	1.13
23	PALANTIR TECHNOLOGIES INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	836	25,370.68 21,209,889	18,788.52 15,707,205	— —	1.11

24	TEXAS INSTRUMENTS INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	331	38,477.66 12,736,106	46,359.09 15,344,861	— —	1.08
25	MARVELL TECHNOLOGY INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	318	28,452.82 9,047,998	45,103.82 14,343,015	— —	1.01
26	LINDE PLC アイルランド	株式 化学	168	78,465.57 13,182,217	82,991.02 13,942,493	— —	0.99
27	WESTERN DIGITAL CORP アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	125	61,573.88 7,696,735	105,858.79 13,232,349	— —	0.94
28	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC アイルランド	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	82	99,295.34 8,142,218	157,279.58 12,896,926	— —	0.91
29	QUALCOMM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	384	29,549.90 11,347,163	30,646.23 11,768,156	— —	0.83
30	AMGEN INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	196	52,393.15 10,269,058	58,549.71 11,475,744	— —	0.81

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	94.83
投資信託受益証券	6.96
合計	101.79

（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

2026年6月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
半導体・半導体製造装置	外国	34.06
ソフトウェア		10.87
コンピュータ・周辺機器		9.38
インタラクティブ・メディアおよびサービス		8.53
大規模小売り		4.47
生活必需品流通・小売り		4.08
自動車		3.12
バイオテクノロジー		2.43
通信機器		2.21

ホテル・レストラン・レジャー	2.08
娯楽	1.99
飲料	1.58
電力	1.13
ヘルスケア機器・用品	1.02
化学	0.99
無線通信サービス	0.79
情報技術サービス	0.77
航空宇宙・防衛	0.71
専門サービス	0.66
専門小売り	0.60
陸上運輸	0.56
食品	0.44
商業サービス・用品	0.40
各種電気通信サービス	0.36
コングロマリット	0.30
機械	0.26
エネルギー設備・サービス	0.24
商社・流通業	0.23
石油・ガス・消耗燃料	0.21
建設・土木	0.21
金融サービス	0.17
合計	94.83

（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。

グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド

2026年6月30日現在							
順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	STERLING INFRASTRUCTURE INC アメリカ	株式 建設・土木	2,456	50,110.30 123,070,912	132,148.10 324,555,758	— —	6.20
2	MASTEC INC アメリカ	株式 建設・土木	3,698	35,430.25 131,021,065	69,679.92 257,676,363	— —	4.92
3	ATI INC アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	7,730	18,395.53 142,197,518	32,106.12 248,180,360	— —	4.74
4	JABIL CIRCUIT INC アメリカ	株式 電子装置・機器・部品	3,521	36,800.82 129,575,693	60,665.65 213,603,775	— —	4.08
5	TTM TECHNOLOGIES アメリカ	株式 電子装置・機器・部品	5,839	21,713.03 126,782,415	30,334.45 177,122,865	— —	3.39
6	WOODWARD INC アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	2,521	49,686.46 125,259,586	68,742.93 173,300,938	— —	3.31

7	HAMMOND POWER SOLUTIONS INC カナダ	株式 電気設備	4,250	28,054.86 119,233,187	38,638.63 164,214,192	— —	3.14
8	上村工業 日本	株式 化学	5,900	21,050.75 124,199,462	27,440.00 161,896,000	— —	3.09
9	NVENT ELECTRIC PLC アイルランド	株式 電気設備	5,772	17,963.88 103,687,551	26,526.40 153,110,418	— —	2.93
10	NPK INTERNATIONAL INC アメリカ	株式 商社・流通業	59,291	2,321.07 137,618,837	2,577.12 152,800,573	— —	2.92
11	DOLLARAMA INC カナダ	株式 大規模小売り	6,798	23,216.96 157,828,951	21,827.76 148,385,132	— —	2.84
12	KODIAK GAS SERVICES INC アメリカ	株式 エネルギー設備・サービス	11,841	9,507.60 112,579,542	12,086.68 143,118,469	— —	2.74
13	IES HOLDINGS INC アメリカ	株式 建設・土木	1,188	102,066.20 121,254,656	117,403.09 139,474,880	— —	2.67
14	RALPH LAUREN CORP アメリカ	株式 繊維・アパレル・贅沢品	2,124	58,871.24 125,042,527	64,567.88 137,142,193	— —	2.62
15	CONSTRUCTION PARTNERS INC アメリカ	株式 建設・土木	7,012	17,721.62 124,264,004	19,520.90 136,880,564	— —	2.62
16	レゾナック・ホールディングス 日本	株式 化学	7,500	9,710.79 72,830,991	17,700.00 132,750,000	— —	2.54
17	古河電気工業 日本	株式 非鉄金属	28,000	4,760.38 133,290,788	4,730.00 132,440,000	— —	2.53
18	DT MIDSTREAM INC アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	5,447	22,197.83 120,911,617	24,012.60 130,796,682	— —	2.50
19	SANMINA CORP アメリカ	株式 電子装置・機器・部品	3,345	24,605.33 82,304,838	39,040.17 130,589,401	— —	2.50
20	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES アメリカ	株式 ライフサイエンス・ツール／サービス	2,138	44,257.77 94,623,113	57,596.48 123,141,285	— —	2.35
21	GAMES WORKSHOP GROUP PLC イギリス	株式 レジャー用品	2,498	41,848.72 104,538,127	47,138.95 117,753,122	— —	2.25

22	LEGENGE CORP アメリカ	株式 建設・土木	8,935	13,713.01 122,525,832	13,088.63 116,946,944	— —	2.24
23	ELEMENT SOLUTIONS INC アメリカ	株式 化学	14,021	6,962.63 97,623,127	7,518.65 105,419,089	— —	2.01
24	KITRON ASA ノルウェー	株式 電子装置・機器・部品	63,387	1,743.06 110,487,355	1,661.77 105,335,122	— —	2.01
25	堀場製作所 日本	株式 電気機器	3,700	27,411.74 101,423,470	27,410.00 101,417,000	— —	1.94
26	CELESTICA INC カナダ	株式 電子装置・機器・部品	1,728	47,464.97 82,019,473	55,740.36 96,319,355	— —	1.84
27	LITTELFUSE INC アメリカ	株式 電子装置・機器・部品	1,209	71,438.47 86,369,118	72,916.35 88,155,876	— —	1.68
28	HALMA PLC イギリス	株式 電子装置・機器・部品	10,505	8,519.52 89,497,564	8,326.73 87,472,361	— —	1.67
29	MATERION CORP アメリカ	株式 金属・鉱業	1,808	26,076.26 47,145,888	47,016.77 85,006,332	— —	1.62
30	VICOR CORP アメリカ	株式 電気設備	1,400	42,813.67 59,939,149	59,563.02 83,388,239	— —	1.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	98.59
合計	98.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2026年6月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
化学	国内	6.60
非鉄金属		3.77
電気機器		1.94
卸売業		0.88
建設・土木	外国	18.64
電子装置・機器・部品		17.17
航空宇宙・防衛		8.06
電気設備		7.66
化学		4.85
金属・鉱業		2.96
商社・流通業		2.92

大規模小売り		2.84
エネルギー設備・サービス		2.74
繊維・アパレル・贅沢品		2.62
石油・ガス・消耗燃料		2.50
ライフサイエンス・ツール／サービス		2.35
専門小売り		2.31
レジャー用品		2.25
機械		1.49
資本市場		1.21
家庭用耐久財		1.16
専門サービス		0.99
コンピュータ・周辺機器		0.69
合計		98.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,619,396	10,424.51 27,305,945,092	12,064.72 31,602,284,547	— —	14.54
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	497,330	23,128.01 11,502,253,663	33,841.35 16,830,321,579	— —	7.74
3	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	58,729	126,350.60 7,420,444,892	275,340.81 16,170,490,782	— —	7.44
4	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	655,100	10,551.42 6,912,240,732	8,702.34 5,700,904,244	— —	2.62
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,781,168	2,810.68 5,006,301,583	1,926.02 3,430,583,003	— —	1.58
6	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	153,521	10,044.25 1,542,003,766	19,904.24 3,055,719,750	— —	1.41

7	DELTA ELECTRONICS INC 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	207,178	9,528.47 1,974,089,760	9,697.59 2,009,127,922	— —	0.92
8	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	85,260	15,611.03 1,330,996,944	22,054.50 1,880,367,181	— —	0.87
9	SK SQUARE CO LTD 韓国	株式 コングロ マリット	9,825	74,597.35 732,919,035	171,826.08 1,688,191,236	— —	0.78
10	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	1,208,896	1,380.65 1,669,070,039	1,382.09 1,670,811,534	— —	0.77
11	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,299,889	1,057.64 1,374,823,071	1,254.83 1,631,143,483	— —	0.75
12	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,943,530	179.84 1,608,459,362	170.65 1,526,216,971	— —	0.70
13	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	646,308	2,358.92 1,524,591,872	2,250.72 1,454,664,804	— —	0.67
14	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	563,486	2,325.76 1,310,533,565	2,400.54 1,352,675,190	— —	0.62
15	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD 韓国	株式 電子装 置・機 器・部品	5,961	78,331.93 466,936,657	213,525.33 1,272,824,527	— —	0.59
16	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	355,086	2,301.10 817,090,790	3,191.80 1,133,365,696	— —	0.52
17	UNITED MICROELECTRONICS CORP 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,206,610	387.34 467,368,520	834.85 1,007,348,494	— —	0.46
18	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,956,235	145.29 1,010,722,739	137.10 953,701,209	— —	0.44
19	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	379,089	2,803.73 1,062,863,259	2,448.74 928,291,401	— —	0.43
20	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信 サービス	291,286	3,192.83 930,027,071	3,185.10 927,775,912	— —	0.43

21	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	312,490	3,114.28 973,182,637	2,851.11 890,944,613	— —	0.41
22	YAGEO CORP 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	165,584	1,665.23 275,736,508	5,294.22 876,638,786	— —	0.40
23	ELITE MATERIAL CO LTD 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	30,511	19,448.80 593,402,435	27,743.76 846,490,166	— —	0.39
24	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周 辺機 器	1,827,800	657.98 1,202,670,261	452.72 827,482,712	— —	0.38
25	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS ケイマン諸島	株式 銀行	388,046	2,444.91 948,739,643	2,132.18 827,384,191	— —	0.38
26	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	583,423	1,451.40 846,782,446	1,329.20 775,491,673	— —	0.36
27	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	187,000	3,792.03 709,109,795	4,129.57 772,230,338	— —	0.36
28	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,189,200	105.82 760,819,376	105.41 757,841,609	— —	0.35
29	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レスト ラン・ レ ジャー	538,110	1,775.72 955,533,966	1,401.03 753,909,060	— —	0.35
30	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	60,344	16,946.78 1,022,636,505	12,429.33 750,035,525	— —	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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	96.70
投資信託受益証券	0.51
投資証券	0.07
合計	97.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2026年6月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
半導体・半導体製造装置	外国	26.23
銀行		13.55
コンピュータ・周辺機器		10.37
電子装置・機器・部品		5.13
金属・鉱業		3.63

インタラクティブ・メディアおよびサービス
石油・ガス・消耗燃料
大規模小売り
保険
自動車
電気設備
コングロマリット
無線通信サービス
化学
ホテル・レストラン・レジャー
機械
不動産管理・開発
金融サービス
資本市場
電力
情報技術サービス
各種電気通信サービス
医薬品
バイオテクノロジー
食品
独立系発電事業者・エネルギー販売業者
生活必需品流通・小売り
航空宇宙・防衛
通信機器
娯楽
飲料
運送インフラ
消費者金融
専門小売り
建設・土木
自動車用部品
ライフサイエンス・ツール／サービス
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
繊維・アパレル・贅沢品
建設資材
旅客航空輸送
パーソナルケア用品
家庭用耐久財
海上運輸
航空貨物・物流サービス
タバコ
ガス
ソフトウェア
陸上運輸
水道
商社・流通業
総合公益事業
各種消費者サービス
エネルギー設備・サービス
ヘルスケア機器・用品

3.22
3.00
2.65
2.41
1.93
1.68
1.51
1.27
1.14
0.94
0.87
0.87
0.86
0.83
0.81
0.81
0.75
0.74
0.73
0.73
0.65
0.65
0.65
0.61
0.58
0.55
0.53
0.48
0.45
0.44
0.44
0.42
0.41
0.39
0.35
0.30
0.29
0.26
0.19
0.17
0.17
0.16
0.15
0.14
0.13
0.08
0.08
0.07
0.07
0.05

紙製品・林産品	0.04
専門サービス	0.04
建設関連製品	0.03
家庭用品	0.03
メディア	0.01
販売	0.00
商業サービス・用品	0.00
合計	96.70

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,220,000,000	90.69 5,640,989,000	90.14 5,606,708,000	0.5 2032/12/20	1.25
2	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,660,000,000	97.72 5,531,073,800	97.93 5,543,064,400	0.1 2028/3/20	1.24
3	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,430,000,000	90.56 4,917,947,000	89.57 4,864,085,400	0.5 2033/3/20	1.09
4	382回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,900,000,000	98.19 4,811,539,000	97.84 4,794,209,000	2.4 2036/3/20	1.07
5	371回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,150,000,000	89.49 4,608,735,000	88.26 4,545,802,000	0.4 2033/6/20	1.02
6	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,370,000,000	98.29 4,295,360,400	98.67 4,312,097,500	0.1 2027/9/20	0.96
7	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,460,000,000	96.09 4,285,825,600	96.34 4,296,942,400	0.1 2029/3/20	0.96
8	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,400,000,000	97.27 4,280,232,000	97.53 4,291,540,000	0.1 2028/6/20	0.96
9	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,750,000,000	89.80 4,265,879,500	88.93 4,224,270,000	0.2 2032/9/20	0.94
10	483回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	4,100,000,000	100.04 4,101,708,000	100.11 4,104,551,000	1.4 2028/4/1	0.92
11	372回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	92.16 4,147,302,000	90.23 4,060,575,000	0.8 2033/9/20	0.91
12	381回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	96.71 4,062,180,500	95.69 4,019,022,000	2.1 2035/12/20	0.90

13	378回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,370,000,000	93.96 4,106,205,000	91.34 3,991,601,700	1.4 2035/3/20	0.89
14	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,450,000,000	90.27 4,017,171,000	89.54 3,984,530,000	0.2 2032/6/20	0.89
15	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,380,000,000	90.08 3,945,618,000	90.16 3,949,095,600	0.2 2032/3/20	0.88
16	380回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,200,000,000	95.35 4,005,044,000	92.78 3,897,054,000	1.7 2035/9/20	0.87
17	374回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,290,000,000	90.83 3,896,734,000	89.08 3,821,875,200	0.8 2034/3/20	0.85
18	185回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.49 3,818,703,000	100.47 3,818,088,000	2 2031/3/20	0.85
19	178回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,900,000,000	97.86 3,816,540,000	97.51 3,803,202,000	1 2030/3/20	0.85
20	379回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,120,000,000	93.68 3,859,963,200	91.63 3,775,238,400	1.5 2035/6/20	0.84
21	377回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	91.69 3,759,578,200	90.31 3,702,792,000	1.2 2034/12/20	0.83
22	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,090,000,000	90.68 3,708,874,000	90.22 3,690,366,100	0.1 2031/12/20	0.82
23	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	92.76 3,617,796,000	92.54 3,609,177,000	0.1 2030/12/20	0.81
24	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,850,000,000	93.70 3,607,719,500	93.71 3,608,143,000	0.1 2030/6/20	0.81
25	373回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,060,000,000	89.93 3,651,440,000	88.28 3,584,492,800	0.6 2033/12/20	0.80
26	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,690,000,000	96.49 3,560,481,000	96.75 3,570,296,400	0.1 2028/12/20	0.80
27	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,910,000,000	91.32 3,570,612,000	90.82 3,551,179,300	0.1 2031/9/20	0.79
28	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	93.24 3,543,424,000	93.14 3,539,548,000	0.1 2030/9/20	0.79
29	375回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,890,000,000	92.79 3,609,563,000	90.66 3,526,868,500	1.1 2034/6/20	0.79

30	158回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,600,000,000	97.64 3,515,148,000	97.93 3,525,624,000	0.1 2028/3/20	0.79
----	---------------------------	------	---------------	------------------------	------------------------	------------------	------

(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

2026年6月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	87.74
地方債証券	5.01
特殊債券	3.71
社債券	3.08
合計	99.54

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28 中国	国債証券	1,884,015,700	100.25 1,888,783,390	100.42 1,891,970,014	1.45 2028/2/25	0.56
2	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,986,029,700	96.51 1,916,726,881	94.88 1,884,517,203	3.375 2033/5/15	0.55
3	US T N/B 4.25 02/15/54 アメリカ	国債証券	1,835,007,000	90.01 1,651,773,413	90.28 1,656,810,606	4.25 2054/2/15	0.49
4	FRANCE OAT 3.5 11/25/33 フランス	国債証券	1,612,545,000	101.56 1,637,728,452	101.31 1,633,824,466	3.5 2033/11/25	0.48
5	CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31 中国	国債証券	1,559,917,303	102.90 1,605,163,140	103.28 1,611,088,830	2.12 2031/6/25	0.47
6	US T N/B 4.25 08/15/35 アメリカ	国債証券	1,542,705,000	101.95 1,572,835,956	99.29 1,531,797,596	4.25 2035/8/15	0.45
7	US T N/B 3.875 07/15/28 アメリカ	国債証券	1,493,988,000	100.47 1,501,129,580	99.53 1,486,984,931	3.875 2028/7/15	0.44
8	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,493,988,000	99.86 1,492,038,210	97.70 1,459,731,316	3.875 2033/8/15	0.43
9	US T N/B 4.0 11/15/35 アメリカ	国債証券	1,463,945,850	98.60 1,443,492,701	97.29 1,424,373,563	4 2035/11/15	0.42
10	US T N/B 4.125 07/31/31 アメリカ	国債証券	1,380,315,000	102.38 1,413,286,197	99.91 1,379,074,869	4.125 2031/7/31	0.41
11	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 中国	国債証券	1,359,353,100	100.30 1,363,538,820	100.46 1,365,686,462	1.46 2028/5/25	0.40
12	US T N/B 4.625 02/15/35 アメリカ	国債証券	1,331,598,000	104.98 1,397,943,831	102.15 1,360,336,587	4.625 2035/2/15	0.40

13	US T N/B 4.125 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,299,120,000	101.10 1,313,532,112	100.01 1,299,348,359	4.125 2027/11/15	0.38
14	US T N/B 4.25 05/15/35 アメリカ	国債証券	1,299,120,000	102.04 1,325,711,360	99.37 1,290,975,126	4.25 2035/5/15	0.38
15	US T N/B 4.375 05/15/36 アメリカ	国債証券	1,217,925,000	99.50 1,211,908,450	100.05 1,218,591,058	4.375 2036/5/15	0.36
16	US T N/B 3.5 11/15/28 アメリカ	国債証券	1,217,925,000	100.14 1,219,729,519	98.62 1,201,178,531	3.5 2028/11/15	0.35
17	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,152,969,000	102.02 1,176,296,576	101.48 1,170,083,382	4.5 2033/11/15	0.34
18	US T N/B 3.75 08/15/27 アメリカ	国債証券	1,169,208,000	100.39 1,173,866,567	99.62 1,164,823,470	3.75 2027/8/15	0.34
19	FRANCE OAT 4.75 04/25/35 フランス	国債証券	1,050,563,800	110.69 1,162,878,302	109.79 1,153,437,631	4.75 2035/4/25	0.34
20	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証券	1,136,730,000	103.32 1,174,472,982	100.57 1,143,212,907	4.375 2034/5/15	0.34
21	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27 中国	国債証券	1,131,363,352	100.42 1,136,196,762	100.53 1,137,455,404	1.62 2027/8/15	0.33
22	US T N/B 3.875 05/15/29 アメリカ	国債証券	1,136,730,000	99.53 1,131,444,205	99.39 1,129,847,452	3.875 2029/5/15	0.33
23	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27 中国	国債証券	1,120,870,100	100.18 1,122,895,063	100.32 1,124,554,512	1.42 2027/11/15	0.33
24	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,263,394,200	90.26 1,140,459,948	88.55 1,118,770,102	1.875 2032/2/15	0.33
25	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証券	1,136,730,000	99.65 1,132,800,287	97.10 1,103,782,584	3.875 2034/8/15	0.32
26	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30 中国	国債証券	1,097,021,800	99.85 1,095,405,853	100.31 1,100,467,545	1.43 2030/1/25	0.32
27	US T N/B 4.125 11/30/31 アメリカ	国債証券	1,090,286,460	101.32 1,104,705,215	99.83 1,088,433,822	4.125 2031/11/30	0.32
28	US T N/B 3.625 10/31/30 アメリカ	国債証券	1,088,013,000	100.23 1,090,584,278	98.01 1,066,380,243	3.625 2030/10/31	0.31
29	US T N/B 3.875 08/31/32 アメリカ	国債証券	1,055,535,000	100.71 1,063,101,042	98.24 1,037,001,292	3.875 2032/8/31	0.30
30	US T N/B 4.0 02/28/30 アメリカ	国債証券	1,039,296,000	100.01 1,039,483,073	99.61 1,035,297,141	4 2030/2/28	0.30

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.61
合計	98.61

（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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 4.875 10/31/28 アメリカ	国債証券	1,510,227,000	101.49 1,532,791,918	101.67 1,535,476,106	4.875 2028/10/31	0.58
2	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27 中国	国債証券	1,514,367,050	100.50 1,522,043,982	100.53 1,522,521,462	1.62 2027/8/15	0.57
3	US T N/B 4.125 02/15/36 アメリカ	国債証券	1,429,032,000	97.48 1,393,082,913	98.15 1,402,684,222	4.125 2036/2/15	0.53
4	US T N/B 4.25 11/15/34 アメリカ	国債証券	1,347,837,000	98.91 1,333,200,324	99.54 1,341,755,936	4.25 2034/11/15	0.51
5	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30 中国	国債証券	1,287,808,200	100.23 1,290,855,798	100.31 1,291,853,205	1.43 2030/1/25	0.49
6	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28 中国	国債証券	1,263,959,900	100.28 1,267,512,638	100.32 1,268,095,576	1.42 2028/8/15	0.48
7	US T N/B 4.625 02/15/35 アメリカ	国債証券	1,234,164,000	101.50 1,252,772,872	102.15 1,260,799,763	4.625 2035/2/15	0.48
8	US T N/B 4.625 05/31/31 アメリカ	国債証券	1,217,925,000	101.69 1,238,548,841	102.11 1,243,734,547	4.625 2031/5/31	0.47
9	US T N/B 1.0 07/31/28 アメリカ	国債証券	1,261,770,300	93.62 1,181,332,443	93.84 1,184,117,206	1 2028/7/31	0.45
10	US T N/B 2.625 07/31/29 アメリカ	国債証券	1,234,164,000	95.46 1,178,168,633	95.75 1,181,784,337	2.625 2029/7/31	0.45
11	US T N/B 3.625 10/31/30 アメリカ	国債証券	1,169,208,000	97.62 1,141,484,978	98.01 1,145,960,858	3.625 2030/10/31	0.43
12	US T N/B 3.375 02/29/28 アメリカ	国債証券	1,136,730,000	98.70 1,121,965,832	98.83 1,123,497,758	3.375 2028/2/29	0.42
13	FRANCE OAT 3.5 11/25/35 フランス	国債証券	1,075,030,000	98.96 1,063,849,688	99.74 1,072,234,922	3.5 2035/11/25	0.40
14	CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32 中国	国債証券	1,025,476,900	101.61 1,042,052,913	101.64 1,042,353,173	1.79 2032/3/25	0.39
15	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28 中国	国債証券	1,001,628,600	103.99 1,041,679,420	104.05 1,042,215,892	2.91 2028/10/14	0.39
16	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 中国	国債証券	1,001,628,600	100.45 1,006,217,861	100.46 1,006,295,287	1.46 2028/5/25	0.38
17	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	990,579,000	100.89 999,420,688	101.48 1,005,282,906	4.5 2033/11/15	0.38
18	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	930,083,700	104.88 975,542,377	104.94 976,114,751	2.68 2030/5/21	0.37
19	US T N/B 4.125 11/30/29 アメリカ	国債証券	974,340,000	99.74 971,808,995	100.04 974,739,635	4.125 2029/11/30	0.37

20	CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31 中国	国債証 券	930,083,700	103.23 960,126,705	103.28 960,594,165	2.12 2031/6/25	0.36
21	US T N/B 3.5 01/31/28 アメリカ	国債証 券	958,101,000	98.94 947,958,599	99.05 949,081,378	3.5 2028/1/31	0.36
22	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32 中国	国債証 券	930,083,700	101.46 943,674,176	101.57 944,687,874	1.78 2032/9/15	0.36
23	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35 中国	国債証 券	906,235,400	99.41 900,927,162	99.55 902,217,750	1.61 2035/2/15	0.34
24	US T N/B 3.375 09/15/28 アメリカ	国債証 券	909,384,000	98.26 893,647,390	98.45 895,352,485	3.375 2028/9/15	0.34
25	US T N/B 3.75 06/30/27 アメリカ	国債証 券	893,145,000	99.63 889,925,158	99.68 890,356,637	3.75 2027/6/30	0.34
26	US T N/B 3.875 09/30/32 アメリカ	国債証 券	893,145,000	97.66 872,264,242	98.19 877,009,075	3.875 2032/9/30	0.33
27	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証 券	893,145,000	97.60 871,793,249	98.19 876,991,631	4 2034/2/15	0.33
28	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27 中国	国債証 券	858,538,800	101.74 873,560,996	101.74 873,501,585	2.85 2027/6/4	0.33
29	US T N/B 4.625 11/15/45 アメリカ	国債証 券	893,145,000	96.37 860,768,493	97.06 866,908,865	4.625 2045/11/15	0.33
30	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30 中国	国債証 券	858,538,800	100.79 865,373,198	100.95 866,717,669	1.63 2030/10/25	0.33

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.65
合計	99.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J－REITインデックスファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証 券	109,046	121,866.02 13,289,002,312	125,900.00 13,728,891,400	－ －	6.97
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証 券	94,820	112,375.77 10,655,471,350	115,800.00 10,980,156,000	－ －	5.57
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証 券	93,741	109,456.82 10,260,592,181	112,100.00 10,508,366,100	－ －	5.33

4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	57,526	149,051.55 8,574,339,672	151,800.00 8,732,446,800	— —	4.43
5	GLP投資法人 日本	投資証券	59,401	132,597.36 7,876,416,003	137,400.00 8,161,697,400	— —	4.14
6	KDX不動産投資法人 日本	投資証券	52,641	154,906.15 8,154,414,895	154,900.00 8,154,090,900	— —	4.14
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	92,932	83,154.47 7,727,712,131	86,800.00 8,066,497,600	— —	4.09
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	71,940	93,953.60 6,759,022,145	97,500.00 7,014,150,000	— —	3.56
9	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	56,208	118,248.92 6,646,535,376	120,500.00 6,773,064,000	— —	3.44
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	41,621	158,266.91 6,587,227,311	162,100.00 6,746,764,100	— —	3.42
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	76,944	75,063.96 5,775,721,523	79,300.00 6,101,659,200	— —	3.10
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	99,653	60,013.45 5,980,521,270	59,800.00 5,959,249,400	— —	3.02
13	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	37,173	149,705.94 5,565,018,933	150,400.00 5,590,819,200	— —	2.84
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	32,952	140,247.44 4,621,433,810	141,900.00 4,675,888,800	— —	2.37
15	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	50,058	92,637.53 4,637,249,655	93,300.00 4,670,411,400	— —	2.37
16	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	39,863	104,750.81 4,175,681,868	107,800.00 4,297,231,400	— —	2.18
17	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	53,287	78,867.70 4,202,623,617	76,600.00 4,081,784,200	— —	2.07
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	27,873	132,181.73 3,684,301,523	137,100.00 3,821,388,300	— —	1.94
19	三井不動産アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	31,167	121,113.39 3,774,741,071	121,900.00 3,799,257,300	— —	1.93
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	35,790	91,552.87 3,276,677,398	94,900.00 3,396,471,000	— —	1.72
21	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	22,635	143,937.86 3,258,033,551	146,000.00 3,304,710,000	— —	1.68
22	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	27,350	102,115.91 2,792,870,376	103,300.00 2,825,255,000	— —	1.43

23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	21,922	121,124.63 2,655,294,337	123,000.00 2,696,406,000	— —	1.37
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	20,895	126,136.82 2,635,629,010	128,600.00 2,687,097,000	— —	1.36
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	26,432	98,718.28 2,609,321,757	99,500.00 2,629,984,000	— —	1.33
26	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	34,797	72,133.59 2,510,032,662	74,300.00 2,585,417,100	— —	1.31
27	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	31,728	80,707.76 2,560,696,019	80,400.00 2,550,931,200	— —	1.29
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	15,952	152,243.65 2,428,590,729	155,300.00 2,477,345,600	— —	1.26
29	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	18,178	129,169.05 2,348,035,156	136,200.00 2,475,843,600	— —	1.26
30	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	7,309	315,697.87 2,307,435,761	327,000.00 2,390,043,000	— —	1.21

（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

2026年6月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.37
合計	97.37

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

該当事項はありません。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

該当事項はありません。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

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。

NASDAQ100インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J－REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

該当事項はありません。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

該当事項はありません。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

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

2026年6月30日現在							
種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0809月	買建	662	25,922,700,260	26,499,860,000	2.97

（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。

2026年6月30日現在							
種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Sep26	買建	527	32,066,124,559	32,093,393,494	1.12
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep26	買建	474	5,519,954,687	5,503,293,576	0.19
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep26	買建	43	2,019,585,177	2,016,096,753	0.07
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep26	買建	68	1,538,599,955	1,540,355,839	0.05

	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep26	買建	26	643,807,182	639,718,508	0.02
--	-----------	--------------------------	----	----	-------------	-------------	------

（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。

NASDAQ100インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在							
種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep26	買建	432	6,247,468,080	6,075,906,292	2.80

（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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在							
種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0809月	買建	2,857	4,968,351,570	5,106,887,500	2.59

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

（3）【運用実績】

①【純資産の推移】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）
直近日（2026年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第1計算期間末 (2025年6月30日)	1,014	1,014	0.9263	0.9263

第2計算期間末 (2026年6月29日)	1,160	1,160	1.0596	1.0596
2025年6月末日	1,014	—	0.9263	—
7月末日	1,034	—	0.9444	—
8月末日	1,042	—	0.9517	—
9月末日	1,063	—	0.9706	—
10月末日	1,097	—	1.0020	—
11月末日	1,111	—	1.0151	—
12月末日	1,117	—	1.0201	—
2026年1月末日	1,128	—	1.0301	—
2月末日	1,155	—	1.0550	—
3月末日	1,108	—	1.0119	—
4月末日	1,137	—	1.0388	—
5月末日	1,148	—	1.0485	—
6月末日	1,163	—	1.0623	—

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

直近日（2026年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第1計算期間末 (2025年6月30日)	3,072	3,072	0.9724	0.9724
第2計算期間末 (2026年6月29日)	3,853	3,853	1.1975	1.1975
2025年6月末日	3,072	—	0.9724	—
7月末日	3,164	—	1.0007	—
8月末日	3,240	—	1.0131	—
9月末日	3,332	—	1.0406	—
10月末日	3,487	—	1.0845	—
11月末日	3,539	—	1.1007	—
12月末日	3,575	—	1.1088	—
2026年1月末日	3,636	—	1.1271	—
2月末日	3,758	—	1.1649	—
3月末日	3,551	—	1.1045	—
4月末日	3,711	—	1.1542	—
5月末日	3,829	—	1.1901	—
6月末日	3,874	—	1.2042	—

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

直近日（2026年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第1計算期間末 (2025年6月30日)	1,065	1,065	0.9923	0.9923
第2計算期間末 (2026年6月29日)	1,384	1,384	1.2888	1.2888
2025年6月末日	1,065	—	0.9923	—
7月末日	1,100	—	1.0250	—

8月末日	1,117	—	1.0406	—
9月末日	1,150	—	1.0715	—
10月末日	1,211	—	1.1285	—
11月末日	1,234	—	1.1501	—
12月末日	1,246	—	1.1619	—
2026年1月末日	1,282	—	1.1932	—
2月末日	1,341	—	1.2485	—
3月末日	1,241	—	1.1551	—
4月末日	1,314	—	1.2233	—
5月末日	1,374	—	1.2793	—
6月末日	1,395	—	1.2990	—

②【分配の推移】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

	収益率（％）
第1計算期間	△7.4
第2計算期間	14.4

（注）収益率は期間騰落率です。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

	収益率（％）
第1計算期間	△2.8
第2計算期間	23.1

（注）収益率は期間騰落率です。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

	収益率（％）
第1計算期間	△0.8
第2計算期間	29.9

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

	設定口数	解約口数
--	------	------

第1計算期間	1,095,451,133	0
第2計算期間	0	0

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	3,161,644,352	2,019,998
第2計算期間	72,151,003	14,112,368

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	1,075,911,639	1,993,024
第2計算期間	2,290,024	2,181,102

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

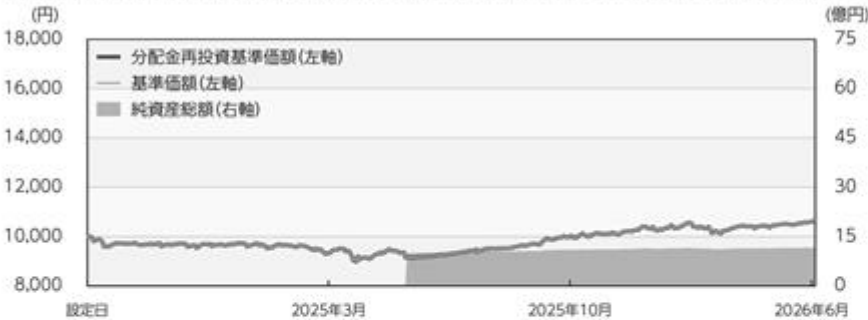
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<<参考情報>>

データの基準日:2026年6月30日

安 定 型

基準価額・純資産の推移 《2024年7月22日～2026年6月30日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2024年7月22日)

分配の推移(税引前)

2025年 6月	0円
2026年 6月	0円
設定来累計	0円

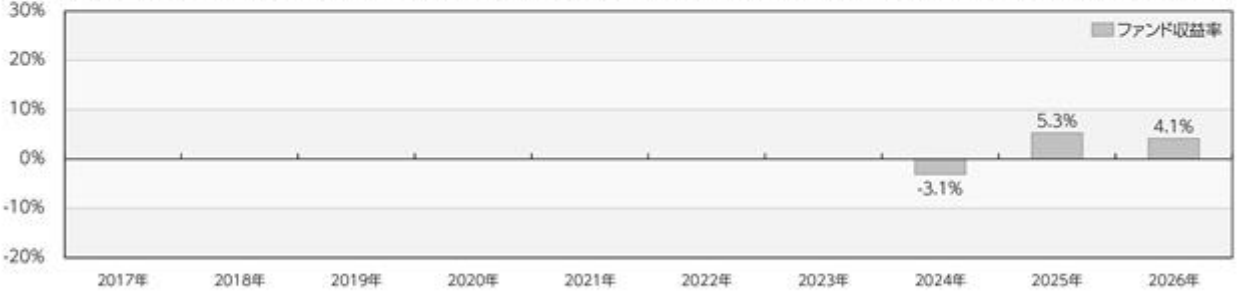
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入上位10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	ISHARES BROAD USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ETF	15.76
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.55
3	ISHARES J.P. MORGAN EM CORPORATE BOND ETF	12.08
4	ISHARES NATIONAL MUNI BOND ETF	6.04
5	ISHARES 1-5 YEAR INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF	5.86
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.44
7	ISHARES 3-7 YEAR TREASURY BOND ETF	3.73
8	ISHARES 7-10 YEAR TREASURY BOND ETF	3.50
9	SPDR PORTFOLIO LONG TERM TREASURY ETF	3.36
10	VANECK J. P. MORGAN EM LOCAL CURRENCY BOND ETF	3.05

年間収益率の推移(暦年ベース)



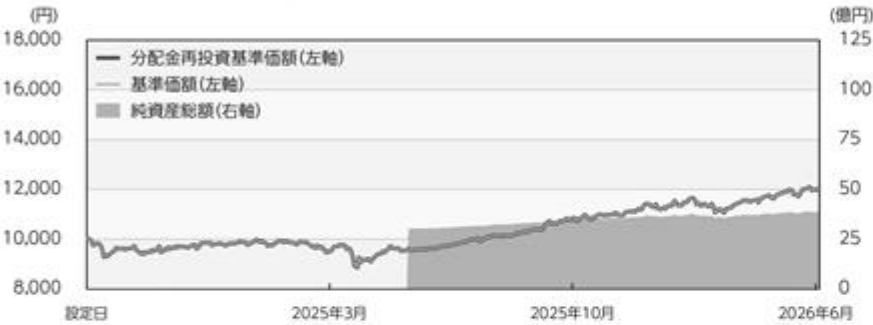
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2024年は設定日から年末までの収益率、および2026年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○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。

データの基準日:2026年6月30日

バ ラ ン ス 型

基準価額・純資産の推移（2024年7月22日～2026年6月30日）



分配の推移(税引前)

2025年 6月	0円
2026年 6月	0円
設定来累計	0円

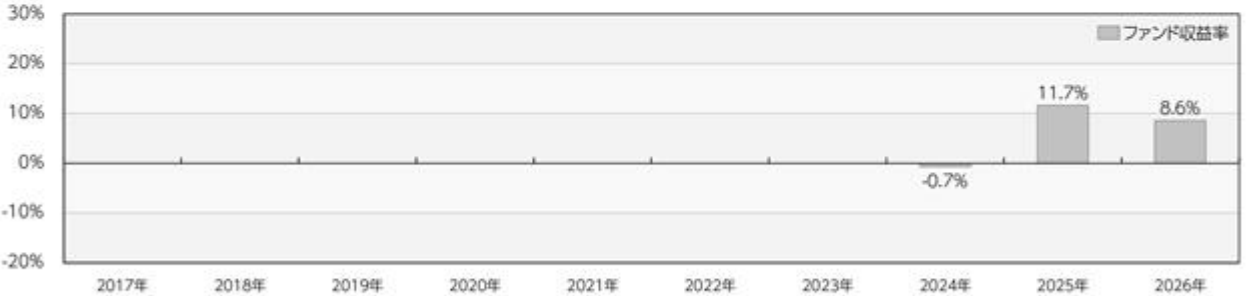
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入上位10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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	24.17
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.13
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.63
4	ISHARES BROAD USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ETF	6.98
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3.75
6	ISHARES MSCI USA MOMENTUM FACTOR ETF	2.14
7	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	2.13
8	VANGUARD VALUE ETF	2.00
9	STATE STREET TECHNOLOGY SELECT SECTOR SPDR ETF	1.64
10	ENERGY SELECT SECTOR SPDR FUND	1.59

年間収益率の推移(暦年ベース)

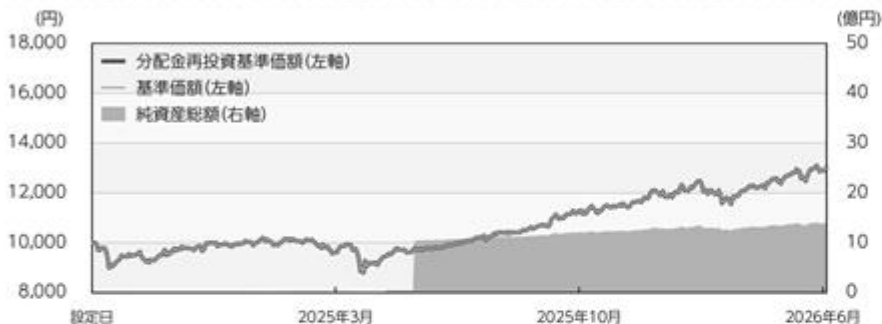


○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2026年6月30日

積 極 型

基準価額・純資産の推移（2024年7月22日～2026年6月30日）



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2024年7月22日)

分配の推移(税引前)

2025年 6月	0円
2026年 6月	0円
設定来累計	0円

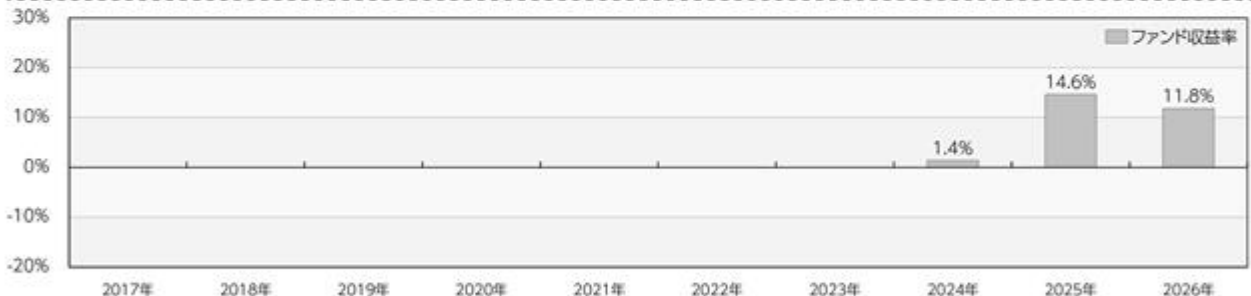
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入上位10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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	35.55
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.59
3	STATE STREET TECHNOLOGY SELECT SECTOR SPDR ETF	5.00
4	ENERGY SELECT SECTOR SPDR FUND	4.96
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.84
6	ISHARES MSCI USA MOMENTUM FACTOR ETF	4.11
7	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.06
8	HEALTH CARE SELECT SECTOR SPDR FUND	3.90
9	UTILITIES SELECT SECTOR SPDR FUND ETF	3.87
10	REAL ESTATE SELECT SECTOR SPDR FUND	3.86

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2024年は設定日から年末までの収益率、および2026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】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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30分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、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

ただし、取得またはスイッチングの申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

※償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

※「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

※「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時30分までに行われ、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、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、受益者が解約の請求をするときは、委託会社または販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額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。

※各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して7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資産運用業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
上場投資信託証券	計算日 [※] における金融商品取引所等の最終相場
上場先物取引等	計算日 [※] における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
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。

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2024年7月22日（設定日）から原則として2045年6月28日までです。

※下記(5)その他 イ．償還規定の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年6月29日から翌年6月28日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解

任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下ロ. 信託約款の変更等c. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ハ.関係法人との契約の更改

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

また、マザーファンドの投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）の間の当該契約は、原則として期間満了の90日前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、マザーファンドの信託終了まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ.公告

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

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ.運用報告書

- ・委託会社は、毎年6月28日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- （2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（2025年7月1日から2026年6月29日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【マスタートーズ・マルチアセット・ファンド（安定型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
資産の部		
流動資産		
預金	7,713,755	10,244,975
コール・ローン	226,266,577	135,205,456
投資信託受益証券	158,824,605	637,759,167
親投資信託受益証券	623,148,578	385,102,600
流動資産合計	1,015,953,515	1,168,312,198
資産合計	1,015,953,515	1,168,312,198
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	29,158	186,088
未払委託者報酬	1,236,091	7,324,362
その他未払費用	3,433	22,003
流動負債合計	1,268,682	7,532,453
負債合計	1,268,682	7,532,453
純資産の部		
元本等		
元本	1,095,451,133	1,095,451,133
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△80,766,300	65,328,612
（分配準備積立金）	13,684,833	159,779,745
元本等合計	1,014,684,833	1,160,779,745
純資産合計	1,014,684,833	1,160,779,745
負債純資産合計	1,015,953,515	1,168,312,198

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	第2期 自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
営業収益		
受取配当金	175,597	4,780,471
受取利息	118,910	2,586,577
有価証券売買等損益	14,317,460	129,105,220
為替差損益	388,136	25,012,346
営業収益合計	15,000,103	161,484,614
営業費用		
受託者報酬	29,254	362,694
委託者報酬	1,242,823	14,802,705
その他費用	43,193	224,303
営業費用合計	1,315,270	15,389,702
営業利益又は営業損失（△）	13,684,833	146,094,912
経常利益又は経常損失（△）	13,684,833	146,094,912
当期純利益又は当期純損失（△）	13,684,833	146,094,912
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（△）	—	—
期首剰余金又は期首欠損金（△）	—	△80,766,300
剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
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	—	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	94,451,133	—
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	94,451,133	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△80,766,300	65,328,612

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第2期
	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。市場価格のない有価証券については、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。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 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。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月28日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2025年6月30日、当計算期間末日を2026年6月29日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期	第2期
	2025年6月30日現在	2026年6月29日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,095,451,133円
期中追加設定元本額	1,094,451,133円	－円
期中一部解約元本額	－円	－円
2. 受益権の総数	1,095,451,133口	1,095,451,133口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は80,766,300円であります。	－

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期	第2期
	自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,158,213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（11,526,620円）、信託約款に規定される収益調整金（783,293円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は14,468,126円（1万口当たり132.07円）であります、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,051,196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（124,043,716円）、信託約款に規定される収益調整金（783,293円）及び分配準備積立金（13,684,833円）より分配対象収益は160,563,038円（1万口当たり1,465.72円）であります、分配を行っておりません。
-------------	---	---

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	第2期 自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29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す。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	1,032,835	3,029,996
親投資信託受益証券	14,116,472	16,972,385
合計	15,149,307	20,002,381

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9263円 (9,263円)	1.0596円 (10,596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

2026年6月29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	ISHARES 1-5 YEAR INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF	8,000.000	419,680.000	
		ISHARES 3-7 YEAR TREASURY BOND ETF	2,272.000	267,664.320	
		ISHARES 7-10 YEAR TREASURY BOND ETF	2,638.000	250,689.140	
		ISHARES BROAD USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ETF	30,498.000	1,126,901.100	
		ISHARES J.P. MORGAN EM CORPORATE BOND ETF	18,923.000	863,834.950	
		ISHARES NATIONAL MUNI BOND ETF	4,020.000	432,552.000	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	1,195.000	96,328.950	
		SPDR PORTFOLIO LONG TERM TREASURY ETF	9,073.000	240,343.770	
		SPDR PORTFOLIO SHORT TERM TREASURY ETF	920.000	26,707.600	
		VANECK J. P. MORGAN EM LOCAL CURRENCY BOND ETF	8,536.000	217,924.080	
	アメリカ・ドル 小計	86,075.000	3,942,625.910 (637,759,167)		
投資信託受益証券 合計			86,075	637,759,167 (637,759,167)	
親投資信託受益証券	日本円	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	46,915,122	51,916,274	
		外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	54,857,394	152,256,697	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	157,152,462	180,929,629	
	日本円 小計		258,924,978	385,102,600	
親投資信託受益証券 合計			258,924,978	385,102,600	
合計				1,022,861,767 (637,759,167)	

（注）投資信託受益証券及び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。

（注）

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	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	10銘柄	54.94	62.35
---------	----------	------	-------	-------

（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。

【マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
資産の部		
流動資産		
預金	47,589,437	379,570,154
コール・ローン	373,549,322	233,234,665
投資信託受益証券	971,982,078	944,948,706
親投資信託受益証券	1,683,165,551	2,320,673,020
未収配当金	—	211,390
流動資産合計	3,076,286,388	3,878,637,935
資産合計	3,076,286,388	3,878,637,935
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	89,920	606,166
未払委託者報酬	3,808,145	24,740,077
その他未払費用	10,626	71,852
流動負債合計	3,908,691	25,418,095
負債合計	3,908,691	25,418,095
純資産の部		
元本等		
元本	3,159,624,354	3,217,662,989
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△87,246,657	635,556,851
（分配準備積立金）	52,718,686	771,778,218
元本等合計	3,072,377,697	3,853,219,840
純資産合計	3,072,377,697	3,853,219,840
負債純資産合計	3,076,286,388	3,878,637,935

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	第2期 自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
営業収益		
受取配当金	1,235,672	12,073,593
受取利息	267,110	12,352,479
有価証券売買等損益	52,507,080	637,895,849
為替差損益	2,853,322	108,866,237
営業収益合計	56,863,184	771,188,158
営業費用		
受託者報酬	91,316	1,158,900
委託者報酬	3,867,582	48,141,044
その他費用	126,588	382,871
営業費用合計	4,085,486	49,682,815
営業利益又は営業損失（△）	52,777,698	721,505,343
経常利益又は経常損失（△）	52,777,698	721,505,343
当期純利益又は当期純損失（△）	52,777,698	721,505,343
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（△）	59,012	2,215,334
期首剰余金又は期首欠損金（△）	—	△87,246,657
剰余金増加額又は欠損金減少額	79,010	3,513,499
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	79,010	370,617
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	3,142,882
剰余金減少額又は欠損金増加額	140,044,353	—
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	140,044,353	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△87,246,657	635,556,851

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期	
	自 2025年7月1日	至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。市場価格のない有価証券については、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。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. 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。	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月28日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2025年6月30日、当計算期間末日を2026年6月29日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期
	2025年6月30日現在	2026年6月29日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	3,159,624,354円
期中追加設定元本額	3,160,644,352円	72,151,003円
期中一部解約元本額	2,019,998円	14,112,368円
2. 受益権の総数	3,159,624,354口	3,217,662,989口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は87,246,657円であります。	—

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,986,555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（46,732,131円）、信託約款に規定される収益調整金（2,260,088円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は54,978,774円（1万口当たり174.00円）であります、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（68,284,348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（651,005,661円）、信託約款に規定される収益調整金（3,609,714円）及び分配準備積立金（52,488,209円）より分配対象収益は775,387,932円（1万口当たり2,409.78円）であります、分配を行っておりません。
-------------	---	---

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	第2期 自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29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す。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	12,387,926	63,539,368
親投資信託受益証券	44,869,069	375,507,317
合計	57,256,995	439,046,685

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9724円 (9,724円)	1.1975円 (11,975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

2026年6月29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	CONSUMER DISCRETIONARY SELECT SECTOR SPDR FUND	1,730.000	197,860.100	
		CONSUMER STAPLES SELECT SECTOR SPDR FUND	648.000	54,892.080	
		ENERGY SELECT SECTOR SPDR FUND	1,667.000	89,751.280	
		FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR FUND	2,883.000	154,442.310	
		HEALTH CARE SELECT SECTOR SPDR FUND	3,784.000	606,726.560	
		ISHARES BROAD USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ETF	45,000.000	1,662,750.000	
		ISHARES MSCI USA MOMENTUM FACTOR ETF	1,522.000	495,776.280	
		MATERIALS SELECT SECTOR SPDR FUND	6,674.000	344,378.400	
		REAL ESTATE SELECT SECTOR SPDR FUND	11,281.000	510,352.440	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	6,384.000	514,614.240	
		STATE STREET TECHNOLOGY SELECT SECTOR SPDR ETF	2,974.000	538,621.140	
		UTILITIES SELECT SECTOR SPDR FUND ETF	3,799.000	175,513.800	
		VANGUARD S&P 500 ETF	740.000	495,992.400	
	アメリカ・ドル 小計	89,086.000	5,841,671.030 (944,948,706)		
投資信託受益証券 合計			89,086	944,948,706 (944,948,706)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	126,587,151	933,428,334	
		グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド	55,223	176,619	
		国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25,806,163	28,557,099	
		J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	12,974,847	34,330,147	
		外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	45,489,299	616,138,908	
		外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12,725,900	35,320,735	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	458,581,413	527,964,780	

	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	46,523,027	144,756,398	
日本円	小計	728,743,023	2,320,673,020	
親投資信託受益証券 合計		728,743,023	2,320,673,020	
合計			3,265,621,726 (944,948,706)	

（注）投資信託受益証券及び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。

（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 (%)	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 13銘柄	24.52	28.94

（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。

【マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
資産の部		
流動資産		
預金	13,841,002	13,727,053
コール・ローン	72,240,830	13,757,572
投資信託受益証券	269,467,645	517,615,848
親投資信託受益証券	711,480,137	848,379,738
未収配当金	—	73,415
流動資産合計	1,067,029,614	1,393,553,626
資産合計	1,067,029,614	1,393,553,626
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	32,748	214,942
未払委託者報酬	1,387,765	9,101,163
その他未払費用	3,792	25,415
流動負債合計	1,424,305	9,341,520
負債合計	1,424,305	9,341,520
純資産の部		
元本等		
元本	1,073,918,615	1,074,027,537
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△8,313,306	310,184,569
（分配準備積立金）	22,738,543	340,733,783
元本等合計	1,065,605,309	1,384,212,106
純資産合計	1,065,605,309	1,384,212,106
負債純資産合計	1,067,029,614	1,393,553,626

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	第2期 自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
営業収益		
受取配当金	280,138	2,534,340
受取利息	49,787	2,448,417
有価証券売買等損益	23,379,384	297,892,865
為替差損益	619,635	33,383,055
営業収益合計	24,328,944	336,258,677
営業費用		
受託者報酬	33,778	406,559
委託者報酬	1,433,167	17,215,262
その他費用	85,786	230,064
営業費用合計	1,552,731	17,851,885
営業利益又は営業損失（△）	22,776,213	318,406,792
経常利益又は経常損失（△）	22,776,213	318,406,792
当期純利益又は当期純損失（△）	22,776,213	318,406,792
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（△）	37,670	365,408
期首剰余金又は期首欠損金（△）	—	△8,313,306
剰余金増加額又は欠損金減少額	59,793	456,491
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	59,793	16,518
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	439,973
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,111,642	—
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,111,642	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△8,313,306	310,184,569

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期	
	自 2025年7月1日	至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。市場価格のない有価証券については、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。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. 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。	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月28日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2025年6月30日、当計算期間末日を2026年6月29日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期
	2025年6月30日現在	2026年6月29日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,073,918,615円
期中追加設定元本額	1,074,911,639円	2,290,024円
期中一部解約元本額	1,993,024円	2,181,102円
2. 受益権の総数	1,073,918,615口	1,074,027,537口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,313,306円であります。	—

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,470,503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（20,268,040円）、信託約款に規定される収益調整金（1,205,200円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は23,943,743円（1万口当たり222.95円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,159,269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（294,882,115円）、信託約款に規定される収益調整金（1,260,119円）及び分配準備積立金（22,692,399円）より分配対象収益は341,993,902円（1万口当たり3,184.21円）であります。分配を行っておりません。
-------------	---	---

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2024年7月22日 至 2025年6月30日	第2期 自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29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す。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	3,765,026	40,375,755
親投資信託受益証券	21,701,292	185,125,527
合計	25,466,318	225,501,282

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2025年6月30日現在	第2期 2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9923円 (9,923円)	1.2888円 (12,888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

2026年6月29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	CONSUMER DISCRETIONARY SELECT SECTOR SPDR FUND	1,305.000	149,252.850	
		CONSUMER STAPLES SELECT SECTOR SPDR FUND	480.000	40,660.800	
		ENERGY SELECT SECTOR SPDR FUND	3,690.000	198,669.600	
		FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR FUND	2,100.000	112,497.000	
		HEALTH CARE SELECT SECTOR SPDR FUND	2,810.000	450,555.400	
		ISHARES MSCI USA MOMENTUM FACTOR ETF	1,943.000	632,912.820	
		MATERIALS SELECT SECTOR SPDR FUND	4,438.000	229,000.800	
		REAL ESTATE SELECT SECTOR SPDR FUND	8,396.000	379,835.040	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	3,144.000	253,437.840	
		STATE STREET TECHNOLOGY SELECT SECTOR SPDR ETF	2,518.000	456,034.980	
		UTILITIES SELECT SECTOR SPDR FUND ETF	2,701.000	124,786.200	
		VANGUARD S&P 500 ETF	257.000	172,256.820	
	アメリカ・ドル 小計	33,782.000	3,199,900.150 (517,615,848)		
投資信託受益証券 合計			33,782	517,615,848 (517,615,848)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド	67,049,994	494,413,245	
		グローバル中小型株式クオ リティグロースマザーファ ンド	95,964	306,921	
		N A S D A Q 1 0 0 イン デックス・マザーファンド	2,508	4,907	
		J - R E I T インデックス ファンド・マザーファンド	5,347,711	14,149,508	
		外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	15,834,354	214,471,574	
		外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	447,717	1,242,638	
		為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド	49,154,213	56,591,245	
		エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド	21,597,204	67,199,700	

	日本円 小計	159,529,665	848,379,738	
親投資信託受益証券	合計	159,529,665	848,379,738	
合計			1,365,995,586 (517,615,848)	

（注）投資信託受益証券及び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。

（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 (%)	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 12銘柄	37.39	37.89

（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。

（参考）

「マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）」、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）」、「マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）」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、「NASDAQ100インデックス・マザーファンド」受益証券、「グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・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、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「J-REITインデックスファンド・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)

	2026年6月29日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	20,482,523,882
株式	862,377,185,590
派生商品評価勘定	508,992,990
未収入金	1,494,284,874
未収配当金	1,947,927,078
差入委託証拠金	1,434,898,467
流動資産合計	888,245,812,881
資産合計	888,245,812,881
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,329,290
前受金	439,973,200
未払金	25,023,326
未払解約金	147,516,000
流動負債合計	615,841,816
負債合計	615,841,816
純資産の部	
元本等	
元本	120,376,963,077
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	767,253,007,988
元本等合計	887,629,971,065
純資産合計	887,629,971,065
負債純資産合計	888,245,812,881

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29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	2026年6月29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	126,989,310,154円
同期中追加設定元本額	19,332,296,140円
同期中一部解約元本額	25,944,643,217円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	214,615,935円
MHAM TOPIXオープン	2,156,717,397円
たわらノーロード 国内株式＜ラップ専用＞	3,804,694,867円
One DC 国内株式インデックスファンド	40,627,543,243円
D IAM国内株式パッシブ・ファンド	3,484,409,421円
たわらノーロード TOPIX	4,856,594,616円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,322,332,127円
たわらノーロード バランス（堅実型）	38,665,281円
たわらノーロード バランス（標準型）	384,297,107円
たわらノーロード バランス（積極型）	848,358,679円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,649,506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）	132,102,884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）	450,477,783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）	434,384,298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）	646,069,114円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	396,495円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,867,740円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	32,486,140円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	13,597,158円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	25,014,052円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	126,587,151円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	67,049,994円
D IAM国内株式インデックスファンド＜DC年金＞	30,675,799,821円
One グローバルバランス	115,921,179円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け）	1,145,335円

未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７３～１９７７年生まれ向け）	633,850円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７８～１９８２年生まれ向け）	451,385円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８３～１９８７年生まれ向け）	473,672円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	386,268円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	315,309円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９８～２００２年生まれ向け）	334,935円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／２００３～２００７年生まれ向け）	462,247円
D I A M バランス・ファンド＜DC年金＞１安定型	687,789,078円
D I A M バランス・ファンド＜DC年金＞２安定・成長型	2,719,070,802円
D I A M バランス・ファンド＜DC年金＞３成長型	3,540,219,333円
D I A M DC バランス３０インデックスファンド	182,186,634円
D I A M DC バランス５０インデックスファンド	713,092,819円
D I A M DC バランス７０インデックスファンド	925,289,781円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	20,324,722円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	867,666,321円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,289,790円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国１０）	199,153,841円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国２０）	297,542,841円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国３０）	548,610,798円
投資のソムリエ	1,937,634,885円
クルーズコントロール	175,219,111円
投資のソムリエ＜DC年金＞	429,875,430円
D I A M ８資産バランスファンドN＜DC年金＞	282,703,371円
４資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	1,548,332,969円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	258,812,031円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	405,817,076円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	92,362,534円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	49,369,317円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	2,820,845円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	149,445,831円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	644,119,538円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	103,362,698円
９資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	164,871,807円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	91,574,479円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	57,891,893円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	32,351,800円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	939,156,997円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	14,132,641円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	713,018円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	22,337,068円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	546,674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）	10,757,841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）	247,270円

インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03（適格機関投資家限定）	357,266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）	612,387円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021-05（適格機関投資家限定）	20,168,849円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	64,472,944円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	318,874円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	97,475,930円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	256,626,597円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	397,789円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2024-05（適格機関投資家限定）	254,603,125円
AMOne TOPIXインデックスファンド2025-01（適格機関投資家限定）	3,506,118,068円
AMOne TOPIXインデックスファンド2026-04（適格機関投資家限定）	382,289,248円
ハイブリッドストラテジーマルチアセットファンド（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	81,482,316円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	9,276,362円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	11,394,803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）	420,020円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,460,546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）	11,702,191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）	41,171,024円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,483,850円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	6,371,800円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,498,764円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	60,828円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	102,723,308円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	220,871,186円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	727,513,042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）	4,445,046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）	7,952,730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）	44,963,419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）	10,597,229円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	36,675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）	57,007,842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）	4,598,908円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	11,499,533円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	25,911,122円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	33,168,548円

D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	8,178,290円
D I A M国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	3,288,840円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	16,305,907円
コア資産形成ファンド	5,218,659円
MHAMトピックスファンド	712,196,414円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	22,313,721円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	1,497,523,384円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	2,517,356,820円
計	120,376,963,077円
2. 受益権の総数	120,376,963,077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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	43,466,596,607
合計	43,466,596,607

（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（2026年2月10日から2026年6月29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	2026年6月29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	25,442,121,800	—	25,948,000,000	505,878,200
合計	25,442,121,800	—	25,948,000,000	505,878,200

（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）

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	7.3738円 (73,738円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2026年6月29日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	9,100	4,415.00	40,176,500	
ニッスイ	194,700	1,307.00	254,472,900	
Umios	105,800	1,314.50	139,074,100	
ユキグニファクトリー	18,600	1,127.00	20,962,200	
カネコ種苗	6,200	1,444.00	8,952,800	
サカタのタネ	26,300	4,210.00	110,723,000	
ホクト	19,400	1,868.00	36,239,200	
ショーボンドホールディングス	127,000	1,253.50	159,194,500	
ミライト・ワン	74,100	3,862.00	286,174,200	
タマホーム	13,600	2,898.00	39,412,800	
robot home	42,200	161.00	6,794,200	
住石ホールディングス	19,400	520.00	10,088,000	
日鉄鉱業	41,900	2,358.00	98,800,200	
三井松島ホールディングス	26,500	1,512.00	40,068,000	
INPEX	730,500	3,278.00	2,394,579,000	
石油資源開発	134,100	1,605.00	215,230,500	
K&Oエナジーグループ	19,800	1,947.00	38,550,600	
リョーサン菱洋ホールディングス	29,000	2,685.00	77,865,000	
第一カッター興業	5,600	1,356.00	7,593,600	
安藤・間	115,500	1,789.50	206,687,250	
東急建設	68,100	1,184.00	80,630,400	
コムシスホールディングス	68,400	5,444.00	372,369,600	
高松コンストラクショングループ	16,100	3,600.00	57,960,000	
東建コーポレーション	4,800	12,940.00	62,112,000	
ヤマウラ	12,200	1,424.00	17,372,800	
オリエンタル白石	80,400	340.00	27,336,000	
大成建設	113,600	14,380.00	1,633,568,000	
大林組	481,400	3,272.00	1,575,140,800	
清水建設	415,700	2,561.00	1,064,607,700	
長谷工コーポレーション	135,800	2,841.50	385,875,700	
松井建設	12,500	1,358.00	16,975,000	
鹿島建設	337,300	5,867.00	1,978,939,100	
不動テトラ	8,600	2,782.00	23,925,200	
鉄建建設	9,600	4,420.00	42,432,000	
西松建設	24,300	5,309.00	129,008,700	
大豊建設	21,300	758.00	16,145,400	
奥村組	24,700	5,700.00	140,790,000	
東鉄工業	16,800	4,240.00	71,232,000	
浅沼組	60,700	841.00	51,048,700	
戸田建設	184,400	1,631.50	300,848,600	
熊谷組	90,200	1,433.00	129,256,600	
矢作建設工業	28,300	1,833.00	51,873,900	
ピーエス・コンストラクション	13,900	2,202.00	30,607,800	
日本ハウスホールディングス	32,400	302.00	9,784,800	

大東建託	259,900	3,101.00	805,949,900	
新日本建設	21,500	2,095.00	45,042,500	
東亜道路工業	23,400	1,552.00	36,316,800	
東亜建設工業	56,300	2,085.00	117,385,500	
日本国土開発	46,600	524.00	24,418,400	
若築建設	400	3,245.00	1,298,000	
五洋建設	215,600	1,714.00	369,538,400	
世紀東急工業	24,000	1,449.00	34,776,000	
福田組	10,600	3,765.00	39,909,000	
住友林業	394,800	1,353.00	534,164,400	
大和ハウス工業	420,900	4,452.00	1,873,846,800	
ライト工業	27,300	4,075.00	111,247,500	
積水ハウス	453,300	3,381.00	1,532,607,300	
日特建設	14,800	1,107.00	16,383,600	
北陸電気工事	8,800	1,695.00	14,916,000	
ユアテック	32,200	2,436.00	78,439,200	
日本リーテック	11,800	2,733.00	32,249,400	
四電工	19,000	2,058.00	39,102,000	
中電工	20,200	5,550.00	112,110,000	
関電工	83,300	6,797.00	566,190,100	
きんでん	104,400	8,030.00	838,332,000	
東京エネシス	14,300	2,090.00	29,887,000	
トーエネック	29,500	2,295.00	67,702,500	
日本電設工業	28,500	4,480.00	127,680,000	
エクシオグループ	143,100	2,767.00	395,957,700	
新日本空調	19,700	3,770.00	74,269,000	
クラフティア	32,900	9,357.00	307,845,300	
三機工業	93,600	3,050.00	285,480,000	
日揮ホールディングス	155,900	2,550.00	397,545,000	
中外炉工業	4,200	4,055.00	17,031,000	
太平電業	30,200	2,600.00	78,520,000	
高砂熱学工業	81,500	5,092.00	414,998,000	
朝日工業社	15,800	4,420.00	69,836,000	
明星工業	25,800	1,856.00	47,884,800	
大気社	36,800	4,960.00	182,528,000	
ダイダン	88,000	2,924.00	257,312,000	
日比谷総合設備	20,400	3,130.00	63,852,000	
ニッポン	54,100	2,842.00	153,752,200	
日清製粉グループ本社	147,200	2,010.00	295,872,000	
日東富士製粉	9,800	1,755.00	17,199,000	
昭和産業	13,000	3,420.00	44,460,000	
中部飼料	19,400	1,841.00	35,715,400	
フィード・ワン	20,100	1,236.00	24,843,600	
日本甜菜製糖	6,700	4,665.00	31,255,500	
DM三井製糖	12,800	3,260.00	41,728,000	
ウェルネオシュガー	8,600	2,617.00	22,506,200	
L I F U L L	46,900	193.00	9,051,700	
M I X I	28,900	2,685.00	77,596,500	
ジェイエイシーリクルートメント	57,600	856.00	49,305,600	
日本M&Aセンターホールディングス	254,200	634.00	161,162,800	

メンバーズ	5,500	1,039.00	5,714,500	
UTグループ	312,500	173.00	54,062,500	
アイティメディア	8,500	1,142.00	9,707,000	
E・Jホールディングス	10,400	1,620.00	16,848,000	
オープンアップグループ	48,000	1,918.00	92,064,000	
コシダカホールディングス	43,700	967.00	42,257,900	
パソナグループ	16,300	1,472.00	23,993,600	
リンクアンドモチベーション	38,000	543.00	20,634,000	
エス・エム・エス	60,800	2,188.00	133,030,400	
パーソルホールディングス	1,453,800	247.70	360,106,260	
クックパッド	31,200	113.00	3,525,600	
森永製菓	59,800	2,615.50	156,406,900	
中村屋	3,900	3,165.00	12,343,500	
江崎グリコ	43,700	5,440.00	237,728,000	
me i t o	6,800	3,205.00	21,794,000	
井村屋グループ	8,400	2,382.00	20,008,800	
不二家	10,400	2,382.00	24,772,800	
山崎製パン	102,300	3,279.00	335,441,700	
モロゾフ	14,900	1,550.00	23,095,000	
亀田製菓	29,200	1,234.00	36,032,800	
寿スピリッツ	81,300	2,475.00	201,217,500	
カルビー	69,900	2,961.50	207,008,850	
森永乳業	220,000	1,256.50	276,430,000	
六甲バター	12,500	1,084.00	13,550,000	
ヤクルト本社	196,700	2,749.50	540,826,650	
明治ホールディングス	212,800	3,836.00	816,300,800	
雪印メグミルク	37,000	3,670.00	135,790,000	
プリマハム	20,500	2,378.00	48,749,000	
日本ハム	54,700	6,044.00	330,606,800	
丸大食品	15,400	2,253.00	34,696,200	
S Foods	16,800	2,650.00	44,520,000	
柿安本店	5,900	2,527.00	14,909,300	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,600	4,745.00	126,217,000	
学情	7,200	1,579.00	11,368,800	
スタジオアリス	7,700	1,840.00	14,168,000	
クロスキャット	8,900	952.00	8,472,800	
システナ	222,500	398.00	88,555,000	
N J S	3,600	4,975.00	17,910,000	
デジタルアーツ	8,200	3,695.00	30,299,000	
日鉄ソリューションズ	42,400	3,378.00	143,227,200	
A L S O K	266,300	1,074.00	286,006,200	
キューブシステム	7,900	1,033.00	8,160,700	
いちご	120,600	445.00	53,667,000	
日本駐車場開発	181,800	255.00	46,359,000	
コア	6,900	1,982.00	13,675,800	
カカココム	103,500	3,370.00	348,795,000	
ルネサンス	12,500	1,024.00	12,800,000	
ディップ	27,700	1,798.00	49,804,600	
S B Sホールディングス	13,900	4,340.00	60,326,000	
新日本科学	16,900	1,144.00	19,333,600	

エムスリー	315,200	1,830.00	576,816,000	
ワールドホールディングス	7,300	2,457.00	17,936,100	
ディー・エヌ・エー	63,900	2,450.00	156,555,000	
博報堂DYホールディングス	190,000	1,140.50	216,695,000	
ぐるなび	29,700	119.00	3,534,300	
タカミヤ	21,700	396.00	8,593,200	
ファンコミュニケーションズ	23,100	405.00	9,355,500	
ライク	8,400	1,461.00	12,272,400	
エスプール	41,500	256.00	10,624,000	
WDBホールディングス	7,000	1,747.00	12,229,000	
手間いらず	2,200	2,235.00	4,917,000	
アドウェイズ	17,100	288.00	4,924,800	
バリューコマース	14,100	460.00	6,486,000	
インフォマート	150,500	388.00	58,394,000	
サッポロホールディングス	228,600	2,041.00	466,572,600	
アサヒグループホールディングス	1,147,000	1,573.50	1,804,804,500	
キリンホールディングス	567,800	2,833.00	1,608,577,400	
シマダヤ	7,000	1,635.00	11,445,000	
宝ホールディングス	125,900	2,261.00	284,659,900	
オエノンホールディングス	45,900	485.00	22,261,500	
飛島ホールディングス	15,700	1,998.00	31,368,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	99,300	4,409.00	437,813,700	
ライフドリンク カンパニー	27,100	1,685.00	45,663,500	
サントリービバレッジ&フード	107,600	4,532.00	487,643,200	
ダイドーグループホールディングス	17,300	2,698.00	46,675,400	
伊藤園	49,400	2,947.50	145,606,500	
キーコーヒー	17,000	1,980.00	33,660,000	
日清オイリオグループ	60,800	1,867.00	113,513,600	
不二製油	30,600	4,014.00	122,828,400	
J-オイルミルズ	17,500	2,078.00	36,365,000	
インターメスティック	7,100	2,066.00	14,668,600	
サンエー	37,100	3,220.00	119,462,000	
カワチ薬品	12,800	3,595.00	46,016,000	
エービーシー・マート	86,200	2,826.00	243,601,200	
ハードオフコーポレーション	6,500	2,679.00	17,413,500	
高千穂交易	13,000	2,161.00	28,093,000	
アスクル	31,300	1,217.00	38,092,100	
ゲオホールディングス	18,500	2,080.00	38,480,000	
アンドエスティHD	22,800	3,525.00	80,370,000	
リガク・ホールディングス	91,900	2,522.00	231,771,800	
くら寿司	38,000	1,642.00	62,396,000	
キャンドゥ	5,900	3,500.00	20,650,000	
パルグループホールディングス	64,600	1,489.00	96,189,400	
エディオン	77,900	2,292.00	178,546,800	
あらた	25,300	2,494.00	63,098,200	
サーラコーポレーション	34,500	1,085.00	37,432,500	
トーメンデバイス	2,300	17,560.00	40,388,000	
ハローズ	7,500	3,760.00	28,200,000	
J Pホールディングス	40,700	586.00	23,850,200	

フジオフードグループ本社	26,600	1,102.00	29,313,200	
あみやき亭	11,800	1,362.00	16,071,600	
東京エレクトロン デバイス	16,300	3,850.00	62,755,000	
円谷フィールズホールディングス	30,400	1,425.00	43,320,000	
双日	158,300	5,225.00	827,117,500	
アルフレッサ ホールディングス	155,400	2,198.00	341,569,200	
大黒天物産	5,900	4,215.00	24,868,500	
ハニーズホールディングス	14,700	1,400.00	20,580,000	
キッコーマン	506,200	1,650.00	835,230,000	
味の素	737,300	5,816.00	4,288,136,800	
ブルドックソース	8,100	1,741.00	14,102,100	
キューピー	82,000	4,419.00	362,358,000	
ハウス食品グループ本社	53,400	3,727.00	199,021,800	
カゴメ	79,300	2,650.00	210,145,000	
アリアケジャパン	17,100	5,070.00	86,697,000	
エバラ食品工業	3,900	2,430.00	9,477,000	
キオクシアホールディングス	95,000	88,450.00	8,402,750,000	
ニチレイ	134,000	2,175.50	291,517,000	
横浜冷凍	37,800	2,070.00	78,246,000	
東洋水産	70,800	10,420.00	737,736,000	
イトアンドホールディングス	7,200	2,044.00	14,716,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,100	634.00	7,037,400	
日清食品ホールディングス	172,600	2,823.50	487,336,100	
フジッコ	17,400	1,519.00	26,430,600	
ロック・フィールド	17,100	1,329.00	22,725,900	
日本たばこ産業	928,300	6,026.00	5,593,935,800	
ケンコーマヨネーズ	9,600	2,040.00	19,584,000	
わらべや日洋ホールディングス	10,300	2,643.00	27,222,900	
なとり	9,700	1,957.00	18,982,900	
ファーマフーズ	20,100	552.00	11,095,200	
北の達人コーポレーション	65,500	114.00	7,467,000	
ユーグレナ	103,000	334.00	34,402,000	
紀文食品	13,300	1,065.00	14,164,500	
ピクルスホールディングス	9,000	1,121.00	10,089,000	
スター・マイカ・ホールディングス	16,100	1,620.00	26,082,000	
SREホールディングス	7,500	2,387.00	17,902,500	
片倉工業	16,300	2,441.00	39,788,300	
ダンゼ	22,000	3,865.00	85,030,000	
ヒューリック	445,400	1,712.00	762,524,800	
ラサ商事	8,600	1,815.00	15,609,000	
アルペン	15,700	2,043.00	32,075,100	
ラクーンホールディングス	11,500	580.00	6,670,000	
クオールホールディングス	20,300	1,873.00	38,021,900	
アルコニックス	25,300	2,522.00	63,806,600	
神戸物産	142,800	2,694.00	384,703,200	
ソリトンシステムズ	8,000	1,948.00	15,584,000	
ジンズホールディングス	12,500	8,350.00	104,375,000	
ビックカメラ	98,200	1,657.00	162,717,400	
DCMホールディングス	85,000	1,575.00	133,875,000	
ペッパーフードサービス	57,100	181.00	10,335,100	

MonotaRO	232,600	1,829.50	425,541,700	
あい ホールディングス	32,800	2,697.00	88,461,600	
J. フロント リテイリング	188,300	3,477.00	654,719,100	
ドトール・日レスホールディングス	29,100	2,752.00	80,083,200	
マツキヨココカラ&カンパニー	282,200	2,438.50	688,144,700	
ブロンコビリー	19,200	2,235.00	42,912,000	
ZOZO	258,700	1,148.50	297,116,950	
トレジャー・ファクトリー	11,300	2,241.00	25,323,300	
物語コーポレーション	31,800	4,810.00	152,958,000	
三越伊勢丹ホールディングス	255,700	4,165.00	1,064,990,500	
東洋紡	67,000	1,670.00	111,890,000	
ユニチカ	53,700	1,035.00	55,579,500	
富士紡ホールディングス	21,600	4,255.00	91,908,000	
日清紡ホールディングス	117,800	2,408.00	283,662,400	
倉敷紡績	10,800	10,340.00	111,672,000	
ダイワボウホールディングス	61,500	3,513.00	216,049,500	
シキボウ	10,400	1,032.00	10,732,800	
日東紡績	98,000	4,580.00	448,840,000	
トヨタ紡織	76,200	2,149.50	163,791,900	
マクニカホールディングス	114,300	3,187.00	364,274,100	
ラクト・ジャパン	6,900	3,310.00	22,839,000	
クリエイトSDホールディングス	23,300	3,275.00	76,307,500	
グリムス	5,600	2,445.00	13,692,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,700	1,535.00	34,844,500	
八洲電機	12,200	2,804.00	34,208,800	
メディアスホールディングス	9,700	789.00	7,653,300	
レスター	14,100	4,195.00	59,149,500	
TOKAIホールディングス	89,200	1,152.00	102,758,400	
三洋貿易	40,400	791.00	31,956,400	
シュッピン	18,000	1,100.00	19,800,000	
ビューティガレージ	4,600	1,429.00	6,573,400	
オイシックス・ラ・大地	24,300	1,504.00	36,547,200	
ウイン・パートナーズ	11,800	1,244.00	14,679,200	
ネクステージ	37,600	4,010.00	150,776,000	
ジョイフル本田	48,100	2,275.00	109,427,500	
エターナルホスピタリティグループ	6,700	2,810.00	18,827,000	
ホットランドホールディングス	12,500	1,583.00	19,787,500	
すかいらくホールディングス	224,400	2,869.50	643,915,800	
SFPホールディングス	9,300	2,225.00	20,692,500	
綿半ホールディングス	12,800	1,377.00	17,625,600	
日本毛織	38,900	1,723.00	67,024,700	
ヨシックスホールディングス	4,900	3,180.00	15,582,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	80,900	813.00	65,771,700	
野村不動産ホールディングス	425,900	943.80	401,964,420	
三重交通グループホールディングス	37,600	533.00	20,040,800	
ディア・ライフ	23,400	1,025.00	23,985,000	
地主	12,500	2,858.00	35,725,000	
フィル・カンパニー	2,800	672.00	1,881,600	

JPMC	8,400	1,288.00	10,819,200	
フージャースホールディングス	26,600	1,197.00	31,840,200	
オープンハウスグループ	47,500	8,606.00	408,785,000	
東急不動産ホールディングス	417,500	1,297.00	541,497,500	
飯田グループホールディングス	130,200	2,201.00	286,570,200	
帝国繊維	16,000	3,350.00	53,600,000	
日本コークス工業	157,600	94.00	14,814,400	
あさひ	13,700	1,292.00	17,700,400	
コスモス薬品	27,700	6,274.00	173,789,800	
シップヘルスケアホールディングス	60,200	2,185.50	131,567,100	
ソフトクリエイトホールディングス	12,800	1,726.00	22,092,800	
セブン&アイ・ホールディングス	1,813,100	1,953.50	3,541,890,850	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	247,000	744.00	183,768,000	
明治電機工業	8,100	2,116.00	17,139,600	
ツルハホールディングス	256,800	2,093.00	537,482,400	
サンマルクホールディングス	14,700	2,540.00	37,338,000	
トリドールホールディングス	46,300	3,886.00	179,921,800	
帝人	137,800	1,627.00	224,200,600	
東レ	1,047,100	1,138.50	1,192,123,350	
クラレ	192,700	1,658.50	319,592,950	
旭化成	1,030,000	1,803.50	1,857,605,000	
TOKYO BASE	22,800	342.00	7,797,600	
稲葉製作所	7,900	1,784.00	14,093,600	
宮地エンジニアリンググループ	21,000	1,550.00	32,550,000	
トーカロ	46,200	3,280.00	151,536,000	
SUMCO	304,700	3,839.00	1,169,743,300	
川田テクノロジーズ	36,300	1,317.00	47,807,100	
RS Technologies	10,700	7,000.00	74,900,000	
And Doホールディングス	9,300	948.00	8,816,400	
ケイアイスター不動産	12,700	3,730.00	47,371,000	
グッドコムアセット	15,900	1,460.00	23,214,000	
ジェイ・エス・ビー	6,500	8,980.00	58,370,000	
ロードスターキャピタル	10,440	2,495.00	26,047,800	
アズーム	2,600	4,170.00	10,842,000	
霞ヶ関キャピタル	15,100	6,790.00	102,529,000	
JMホールディングス	23,700	1,250.00	29,625,000	
コメダホールディングス	40,200	2,798.00	112,479,600	
ユニシアホールディングス	5,000	1,534.00	7,670,000	
バロックジャパンリミテッド	19,000	735.00	13,965,000	
クスリのアオキホールディングス	38,900	3,640.00	141,596,000	
力の源ホールディングス	12,200	1,562.00	19,056,400	
FOOD & LIFE COMPANIES	188,400	5,055.00	952,362,000	
アセンテック	20,000	396.00	7,920,000	
セーレン	33,800	3,290.00	111,202,000	
小松マテーレ	20,400	713.00	14,545,200	
ワコールホールディングス	30,500	4,493.00	137,036,500	
T S Iホールディングス	40,500	1,174.00	47,547,000	
ワールド	51,400	1,600.00	82,240,000	

T I S	159,000	3,204.00	509,436,000	
グリーホールディングス	52,200	371.00	19,366,200	
GMOペパボ	1,900	1,653.00	3,140,700	
コーエーテクモホールディングス	97,500	1,543.00	150,442,500	
三菱総合研究所	7,400	4,495.00	33,263,000	
ファインデックス	10,800	793.00	8,564,400	
K L a b	42,200	215.00	9,073,000	
ポールトゥウィンホールディングス	22,400	317.00	7,100,800	
ネクソン	367,800	2,176.00	800,332,800	
アイスタイル	59,300	379.00	22,474,700	
エムアップホールディングス	38,200	704.00	26,892,800	
エイチームホールディングス	12,000	998.00	11,976,000	
セルシス	21,100	1,835.00	38,718,500	
エニグモ	17,300	379.00	6,556,700	
コロプラ	52,900	372.00	19,678,800	
ブロードリーフ	113,800	390.00	44,382,000	
デジタルハーツホールディングス	9,800	733.00	7,183,400	
メディアドゥ	5,300	1,301.00	6,895,300	
じげん	44,600	383.00	17,081,800	
フィックスターズ	21,500	2,502.00	53,793,000	
北里コーポレーション	12,000	1,336.00	16,032,000	
オブティム	16,100	401.00	6,456,100	
セレス	7,000	2,054.00	14,378,000	
S H I F T	155,100	672.90	104,366,790	
特種東海製紙	27,100	1,883.00	51,029,300	
セック	4,900	3,330.00	16,317,000	
テクマトリックス	31,100	1,730.00	53,803,000	
プロシップ	12,400	1,671.00	20,720,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,100	2,198.00	79,347,800	
GMOペイメントゲートウェイ	35,500	9,250.00	328,375,000	
システムリサーチ	11,500	1,759.00	20,228,500	
インターネットイニシアティブ	85,100	3,164.00	269,256,400	
さくらインターネット	21,900	2,811.00	61,560,900	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,900	1,939.00	9,501,100	
S R Aホールディングス	8,700	4,465.00	38,845,500	
朝日ネット	16,700	609.00	10,170,300	
e B A S E	19,100	401.00	7,659,100	
アバントグループ	17,500	1,094.00	19,145,000	
アドソル日進	12,500	1,366.00	17,075,000	
フリービット	8,100	1,490.00	12,069,000	
コムチュア	20,700	1,293.00	26,765,100	
アステリア	12,100	1,142.00	13,818,200	
アイル	8,700	2,200.00	19,140,000	
王子ホールディングス	530,200	805.30	426,970,060	
日本製紙	87,700	1,270.00	111,379,000	
北越コーポレーション	75,700	872.00	66,010,400	
大王製紙	78,600	934.00	73,412,400	
マークライNZ	9,200	1,230.00	11,316,000	

gumi	28,600	227.00	6,492,200	
テラスカイ	5,300	2,332.00	12,359,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	16,200	820.00	13,284,000	
ネオジャパン	4,200	1,566.00	6,577,200	
PR TIMES	3,200	2,263.00	7,241,600	
ラクス	143,800	966.70	139,011,460	
ダブルスタンダード	5,600	1,180.00	6,608,000	
オープンドア	9,200	301.00	2,769,200	
アカツキ	7,500	2,924.00	21,930,000	
Ubicomホールディングス	5,100	959.00	4,890,900	
カナミックネットワーク	19,500	474.00	9,243,000	
レンゴー	157,200	1,437.50	225,975,000	
トーモク	9,000	3,940.00	35,460,000	
ザ・パック	31,200	1,371.00	42,775,200	
チェンジホールディングス	30,000	915.00	27,450,000	
オークネット	28,900	1,372.00	39,650,800	
オロ	6,400	1,949.00	12,473,600	
ユーザーローカル	6,600	1,604.00	10,586,400	
PKSHA Technology	16,700	2,730.00	45,591,000	
マネーフォワード	35,400	4,288.00	151,795,200	
レゾナック・ホールディングス	150,100	17,865.00	2,681,536,500	
住友化学	1,250,300	515.70	644,779,710	
住友精化	31,800	1,295.00	41,181,000	
日産化学	78,100	8,380.00	654,478,000	
ラサ工業	25,600	2,059.00	52,710,400	
クレハ	23,200	3,880.00	90,016,000	
多木化学	6,000	4,765.00	28,590,000	
テイカ	11,100	2,367.00	26,273,700	
石原産業	25,800	2,908.00	75,026,400	
日本曹達	32,100	3,580.00	114,918,000	
東ソー	226,200	2,910.50	658,355,100	
トクヤマ	54,500	4,968.00	270,756,000	
セントラル硝子	19,600	4,330.00	84,868,000	
東亜合成	62,600	1,753.50	109,769,100	
大阪ソーダ	54,400	1,881.00	102,326,400	
関東電化工業	30,000	3,630.00	108,900,000	
GMOフィナンシャルゲート	2,500	6,770.00	16,925,000	
SUN ASTERISK	13,700	426.00	5,836,200	
デンカ	61,500	4,360.00	268,140,000	
イビデン	196,100	23,700.00	4,647,570,000	
信越化学工業	1,381,700	6,942.00	9,591,761,400	
日本カーバイド工業	7,600	3,645.00	27,702,000	
プラスアルファ・コンサルティング	19,800	2,610.00	51,678,000	
電算システムホールディングス	6,800	2,812.00	19,121,600	
堺化学工業	12,000	4,740.00	56,880,000	
第一稀元素化学工業	15,700	2,091.00	32,828,700	
日本酸素ホールディングス	175,900	5,923.00	1,041,855,700	
日本化学工業	6,300	4,885.00	30,775,500	
日本パーカライジング	77,000	1,702.00	131,054,000	

高圧ガス工業	22,700	1,120.00	25,424,000	
四国化成ホールディングス	35,200	3,455.00	121,616,000	
オリオンビール	34,300	1,240.00	42,532,000	
戸田工業	3,600	1,643.00	5,914,800	
ステラ ケミファ	8,400	6,710.00	56,364,000	
保土谷化学工業	9,800	2,119.00	20,766,200	
日本触媒	95,600	2,102.00	200,951,200	
大日精化工業	41,900	1,052.00	44,078,800	
カネカ	36,600	5,775.00	211,365,000	
協和キリン	182,900	2,577.50	471,424,750	
ブルーゾーンホールディングス	96,900	1,784.50	172,918,050	
APPIER GROUP	59,400	826.00	49,064,400	
三菱瓦斯化学	110,400	5,146.00	568,118,400	
三井化学	279,600	2,147.50	600,441,000	
東京応化工業	74,100	11,165.00	827,326,500	
大阪有機化学工業	13,000	5,880.00	76,440,000	
三菱ケミカルグループ	1,086,900	1,130.00	1,228,197,000	
KHネオケム	25,900	2,970.00	76,923,000	
ビジョナル	21,000	7,804.00	163,884,000	
ダイセル	163,400	1,374.50	224,593,300	
住友ベークライト	51,200	7,527.00	385,382,400	
積水化学工業	305,700	2,600.00	794,820,000	
日本ゼオン	109,300	2,393.50	261,609,550	
アイカ工業	39,300	3,719.00	146,156,700	
UBE	80,000	3,159.00	252,720,000	
積水樹脂	18,500	2,650.00	49,025,000	
旭有機材	10,400	7,300.00	75,920,000	
ニチバン	9,700	1,894.00	18,371,800	
リケンテクノス	26,700	1,704.00	45,496,800	
大倉工業	7,900	4,830.00	38,157,000	
積水化成品工業	24,700	545.00	13,461,500	
群栄化学工業	3,800	4,580.00	17,404,000	
ダイキョーニシカワ	33,100	1,000.00	33,100,000	
森六	8,400	2,367.00	19,882,800	
恵和	10,100	1,205.00	12,170,500	
日本化薬	103,500	2,000.00	207,000,000	
カーリット	13,300	2,157.00	28,688,100	
CLホールディングス	4,000	1,100.00	4,400,000	
プレステージ・インターナショナル	59,100	647.00	38,237,700	
ハイマックス	5,000	1,186.00	5,930,000	
テクセンドフォトマスク	57,600	4,315.00	248,544,000	
アミューズ	8,700	1,843.00	16,034,100	
野村総合研究所	303,400	4,630.00	1,404,742,000	
ドリームインキュベータ	5,100	2,622.00	13,372,200	
クイック	39,500	722.00	28,519,000	
日本システム技術	14,500	1,689.00	24,490,500	
電通グループ	154,200	3,083.00	475,398,600	
インテージホールディングス	11,600	1,750.00	20,300,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,700	651.00	5,012,700	
ぴあ	7,300	2,497.00	18,228,100	

イオンファンタジー	6,800	2,563.00	17,428,400	
ソースネクスト	80,700	102.00	8,231,400	
シーティーエス	19,600	834.00	16,346,400	
メディカルシステムネットワーク	16,000	469.00	7,504,000	
日本精化	9,700	2,572.00	24,948,400	
扶桑化学工業	49,200	4,515.00	222,138,000	
トリケミカル研究所	18,800	3,455.00	64,954,000	
シンプレクス・ホールディングス	123,300	963.00	118,737,900	
HEROZ	6,200	754.00	4,674,800	
メルカリ	66,900	3,960.00	264,924,000	
I P S	4,600	3,355.00	15,433,000	
システムサポートホールディングス	10,800	985.00	10,638,000	
A D E K A	60,100	4,246.00	255,184,600	
日油	178,300	2,626.50	468,304,950	
ハリマ化成グループ	12,100	1,045.00	12,644,500	
ボードルア	8,400	2,582.00	21,688,800	
イーソル	10,400	805.00	8,372,000	
ウイングアーク1 s t	16,200	2,355.00	38,151,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,300	853.00	5,373,900	
サーバーワークス	3,300	1,932.00	6,375,600	
S a n s a n	51,400	1,566.00	80,492,400	
ギフトィ	12,000	995.00	11,940,000	
花王	736,800	3,250.00	2,394,600,000	
第一工業製薬	6,200	12,210.00	75,702,000	
石原ケミカル	6,600	3,380.00	22,308,000	
三洋化成工業	9,600	4,980.00	47,808,000	
メドレー	18,900	2,032.00	38,404,800	
ベース	6,500	2,863.00	18,609,500	
J M D C	22,900	2,896.00	66,318,400	
武田薬品工業	1,384,500	5,176.00	7,166,172,000	
アステラス製薬	1,364,700	2,171.00	2,962,763,700	
住友ファーマ	156,300	1,529.00	238,982,700	
塩野義製薬	567,600	2,805.50	1,592,401,800	
日本新薬	40,800	4,105.00	167,484,000	
中外製薬	486,900	7,574.00	3,687,780,600	
科研製薬	23,000	3,850.00	88,550,000	
エーザイ	203,000	4,145.00	841,435,000	
理研ビタミン	13,400	3,090.00	41,406,000	
ロート製薬	164,400	2,413.00	396,697,200	
小野薬品工業	347,000	2,410.00	836,270,000	
持田製薬	18,900	3,195.00	60,385,500	
参天製薬	261,700	2,147.50	562,000,750	
扶桑薬品工業	6,100	2,103.00	12,828,300	
ツムラ	53,400	3,739.00	199,662,600	
テルモ	1,030,700	2,247.00	2,315,982,900	
H. U. グループホールディングス	49,900	3,288.00	164,071,200	
キッセイ薬品工業	24,300	4,125.00	100,237,500	
生化学工業	26,300	719.00	18,909,700	
栄研化学	22,100	2,553.00	56,421,300	

J C Rファーマ	67,700	461.00	31,209,700	
東和薬品	21,000	3,790.00	79,590,000	
富士製薬工業	11,400	1,985.00	22,629,000	
ゼリア新薬工業	21,200	2,044.00	43,332,800	
ネクセラファーマ	68,100	1,001.00	68,168,100	
第一三共	1,428,500	2,614.00	3,734,099,000	
杏林製薬	31,400	1,176.00	36,926,400	
大幸薬品	32,400	284.00	9,201,600	
ダイト	19,100	1,244.00	23,760,400	
大塚ホールディングス	346,400	10,910.00	3,779,224,000	
ペプチドリーム	75,500	1,066.50	80,520,750	
大日本塗料	17,200	1,350.00	23,220,000	
日本ペイントホールディングス	825,200	1,052.00	868,110,400	
関西ペイント	123,800	2,670.50	330,607,900	
中国塗料	31,900	3,380.00	107,822,000	
藤倉化成	18,000	1,065.00	19,170,000	
太陽ホールディングス	74,500	4,932.00	367,434,000	
D I C	55,300	4,916.00	271,854,800	
サカタインクス	31,900	2,413.00	76,974,700	
a r t i e n c e	29,100	4,275.00	124,402,500	
アルプス技研	39,900	767.00	30,603,300	
サニックスホールディングス	20,100	229.00	4,602,900	
日本空調サービス	17,200	1,613.00	27,743,600	
オリエンタルランド	940,000	2,498.50	2,348,590,000	
フォーカスシステムズ	10,400	1,626.00	16,910,400	
ダスキン	36,200	4,419.00	159,967,800	
パーク24	109,300	2,068.00	226,032,400	
明光ネットワークジャパン	21,100	694.00	14,643,400	
ファルコホールディングス	6,300	2,575.00	16,222,500	
クレスコ	26,700	1,474.00	39,355,800	
フジ・メディア・ホールディングス	122,300	3,825.00	467,797,500	
ラウンドワン	150,700	1,177.50	177,449,250	
リゾートトラスト	151,000	1,749.00	264,099,000	
オービック	285,300	3,812.00	1,087,563,600	
ジャストシステム	22,500	3,685.00	82,912,500	
T D Cソフト	29,100	898.00	26,131,800	
L I N Eヤフー	2,395,500	423.50	1,014,494,250	
ビー・エム・エル	21,400	3,640.00	77,896,000	
トレンドマイクロ	89,900	5,973.00	536,972,700	
I Dホールディングス	20,300	1,070.00	21,721,000	
リソー教育グループ	50,200	199.00	9,989,800	
日本オラクル	29,700	8,515.00	252,895,500	
早稲田アカデミー	7,700	2,379.00	18,318,300	
アルファシステムズ	5,100	3,345.00	17,059,500	
N Sグループ	27,200	1,471.00	40,011,200	
フューチャー	33,300	1,538.00	51,215,400	
C A C H o l d i n g s	9,600	1,742.00	16,723,200	
ユー・エス・エス	302,500	1,905.50	576,413,750	
オービックビジネスコンサルタント	26,300	6,109.00	160,666,700	
アイティフォー	16,200	1,621.00	26,260,200	

東計電算	4,500	4,475.00	20,137,500	
サイバーエージェント	352,900	1,347.00	475,356,300	
楽天グループ	1,257,100	714.50	898,197,950	
クリーク・アンド・リバー社	9,400	1,306.00	12,276,400	
SBIグローバルアセットマネジメン ト	29,800	567.00	16,896,600	
テー・オー・ダブリュー	28,300	320.00	9,056,000	
大塚商会	176,400	2,805.00	494,802,000	
サイボウズ	21,500	2,326.00	50,009,000	
山田コンサルティンググループ	6,900	1,659.00	11,447,100	
セントラルスポーツ	6,000	2,367.00	14,202,000	
パラカ	4,400	2,016.00	8,870,400	
電通総研	56,600	2,056.00	116,369,600	
デジタルガレージ	22,200	1,904.00	42,268,800	
イーエムシステムズ	20,500	491.00	10,065,500	
ウェザーニューズ	22,100	1,981.00	43,780,100	
C I J	37,700	494.00	18,623,800	
ビジネスエンジニアリング	18,300	1,011.00	18,501,300	
WOWOW	11,600	994.00	11,530,400	
スカラ	14,600	329.00	4,803,400	
フルキャストホールディングス	12,200	1,508.00	18,397,600	
エン	26,000	1,138.00	29,588,000	
セルソース	9,300	318.00	2,957,400	
あすか製薬ホールディングス	15,100	2,272.00	34,307,200	
サワイグループホールディングス	80,400	1,663.50	133,745,400	
富士フイルムホールディングス	938,000	3,513.00	3,295,194,000	
コニカミノルタ	349,900	562.30	196,748,770	
資生堂	301,600	2,630.50	793,358,800	
ライオン	178,500	1,713.00	305,770,500	
高砂香料工業	58,500	1,116.00	65,286,000	
ミルボン	25,100	2,711.00	68,046,100	
コーセーホールディングス	35,100	5,045.00	177,079,500	
コタ	18,100	1,165.00	21,086,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	79,700	1,272.00	101,378,400	
ノエビアホールディングス	14,000	4,435.00	62,090,000	
新日本製薬	8,900	1,956.00	17,408,400	
I - n e	4,200	1,145.00	4,809,000	
アクシージア	9,900	328.00	3,247,200	
エステー	14,700	1,498.00	22,020,600	
コニシ	49,000	1,496.00	73,304,000	
長谷川香料	29,700	3,190.00	94,743,000	
小林製薬	40,800	5,544.00	226,195,200	
荒川化学工業	13,200	2,036.00	26,875,200	
メック	11,300	10,490.00	118,537,000	
日本高純度化学	3,900	5,480.00	21,372,000	
J C U	16,900	7,780.00	131,482,000	
O A T アグリオ	5,800	2,595.00	15,051,000	
デクセリアルズ	131,700	4,277.00	563,280,900	
アース製薬	14,300	4,805.00	68,711,500	
北興化学工業	11,400	2,167.00	24,703,800	

大成ラミックグループ	4,600	2,431.00	11,182,600	
クミアイ化学工業	69,400	732.00	50,800,800	
日本農薬	23,800	1,023.00	24,347,400	
ニチレキグループ	16,600	2,102.00	34,893,200	
ユシロ	8,100	2,891.00	23,417,100	
J X 金属	612,500	4,470.00	2,737,875,000	
出光興産	638,400	1,206.50	770,229,600	
ENEOSホールディングス	2,198,300	1,200.00	2,637,960,000	
コスモエネルギーホールディングス	86,200	3,775.00	325,405,000	
ANYCOLOR	24,900	2,252.00	56,074,800	
日本ビジネスシステムズ	16,800	1,450.00	24,360,000	
テスホールディングス	36,900	948.00	34,981,200	
インフロニア・ホールディングス	159,400	2,689.00	428,626,600	
横浜ゴム	87,000	7,336.00	638,232,000	
TOYO TIRE	98,300	3,782.00	371,770,600	
ブリヂストン	851,200	3,424.00	2,914,508,800	
住友ゴム工業	167,900	2,116.50	355,360,350	
藤倉コンポジット	12,800	2,600.00	33,280,000	
オカモト	8,000	5,310.00	42,480,000	
アキレス	8,400	1,178.00	9,895,200	
フコク	8,200	1,805.00	14,801,000	
ニッタ	15,400	5,990.00	92,246,000	
三ツ星ベルト	19,800	3,945.00	78,111,000	
バンドー化学	23,100	2,223.00	51,351,300	
AGC	151,400	6,914.00	1,046,779,600	
日本板硝子	86,100	478.00	41,155,800	
有沢製作所	27,100	2,588.00	70,134,800	
日本電気硝子	51,900	6,486.00	336,623,400	
オハラ	6,000	1,465.00	8,790,000	
住友大阪セメント	26,000	6,178.00	160,628,000	
太平洋セメント	95,900	4,052.00	388,586,800	
日本ヒューム	27,100	1,067.00	28,915,700	
日本コンクリート工業	30,500	327.00	9,973,500	
三谷セキサン	21,800	1,568.00	34,182,400	
アジアパイルホールディングス	24,400	1,479.00	36,087,600	
東海カーボン	156,600	1,712.50	268,177,500	
日本カーボン	8,900	4,615.00	41,073,500	
東洋炭素	13,400	7,460.00	99,964,000	
ノリタケ	32,600	4,140.00	134,964,000	
TOTO	96,500	8,490.00	819,285,000	
NGK	169,600	7,441.00	1,261,993,600	
日本特殊陶業	127,100	10,710.00	1,361,241,000	
MARUWA	6,400	68,480.00	438,272,000	
品川リフラ	19,000	1,917.00	36,423,000	
ヨータイ	9,100	1,746.00	15,888,600	
フジインコーポレーテッド	46,500	4,515.00	209,947,500	
ニチアス	121,900	3,941.00	480,407,900	
日本製鉄	4,364,300	546.10	2,383,344,230	
神戸製鋼所	321,800	1,867.50	600,961,500	
中山製鋼所	33,200	606.00	20,119,200	

合同製鐵	9,000	2,622.00	23,598,000	
J F Eホールディングス	519,300	1,563.50	811,925,550	
東京製鐵	44,600	1,691.00	75,418,600	
ARCHION	233,200	291.00	67,861,200	
共英製鋼	18,300	1,747.00	31,970,100	
大和工業	28,600	12,115.00	346,489,000	
東京鐵鋼	17,600	1,825.00	32,120,000	
大阪製鐵	7,300	2,387.00	17,425,100	
GMSグループ	20,800	359.00	7,467,200	
ヨドコウ	90,700	1,304.00	118,272,800	
トランヴィア	9,200	897.00	8,252,400	
中部鋼鈹	14,700	2,006.00	29,488,200	
丸一鋼管	160,900	1,869.50	300,802,550	
モリ工業	18,100	946.00	17,122,600	
MIRAINI ホールディングス	24,600	1,842.00	45,313,200	
大同特殊鋼	113,400	2,808.00	318,427,200	
ムミノバホールディングス	253,100	435.00	110,098,500	
日本冶金工業	10,700	4,690.00	50,183,000	
愛知製鋼	29,900	3,075.00	91,942,500	
大平洋金属	13,700	2,157.00	29,550,900	
新日本電工	88,000	447.00	39,336,000	
栗本鐵工所	37,000	1,394.00	51,578,000	
日本製鋼所	47,500	7,591.00	360,572,500	
三菱製鋼	10,900	2,208.00	24,067,200	
日本精線	12,800	1,413.00	18,086,400	
エンビプロ・ホールディングス	14,200	803.00	11,402,600	
大紀アルミニウム工業所	23,000	1,494.00	34,362,000	
日本軽金属ホールディングス	47,000	2,795.00	131,365,000	
三井金属	40,000	41,940.00	1,677,600,000	
東邦亜鉛	13,400	785.00	10,519,000	
三菱マテリアル	106,800	4,322.00	461,589,600	
住友金属鉱山	219,400	7,492.00	1,643,744,800	
DOWAホールディングス	43,100	8,770.00	377,987,000	
古河機械金属	17,000	3,675.00	62,475,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,600	2,700.00	74,520,000	
UACJ	96,800	2,438.00	235,998,400	
CKサンエツ	3,100	5,450.00	16,895,000	
前澤ホールディングス	11,100	1,391.00	15,440,100	
古河電気工業	533,000	4,419.00	2,355,327,000	
住友電気工業	2,210,400	2,894.50	6,398,002,800	
フジクラ	1,235,500	5,885.00	7,270,917,500	
SWCC	23,300	13,430.00	312,919,000	
平河ヒューテック	9,600	3,670.00	35,232,000	
いよぎんホールディングス	199,900	3,182.00	636,081,800	
しずおかフィナンシャルグループ	336,500	3,033.00	1,020,604,500	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	128,600	3,102.00	398,917,200	
楽天銀行	81,000	5,097.00	412,857,000	
京都フィナンシャルグループ	209,800	4,511.00	946,407,800	
リョービ	18,900	2,641.00	49,914,900	
AREホールディングス	70,500	2,951.00	208,045,500	

東洋製罐グループホールディングス	80,000	4,141.00	331,280,000	
ホッカンホールディングス	8,500	2,354.00	20,009,000	
コロナ	9,000	961.00	8,649,000	
横河ブリッジホールディングス	27,400	2,839.00	77,788,600	
三和ホールディングス	153,900	3,847.00	592,053,300	
文化シャッター	50,200	1,928.00	96,785,600	
三協立山	20,000	636.00	12,720,000	
アルインコ	12,200	1,057.00	12,895,400	
L I X I L	250,000	1,797.50	449,375,000	
ノーリツ	28,000	2,264.00	63,392,000	
長府製作所	15,800	1,999.00	31,584,200	
リンナイ	81,800	3,600.00	294,480,000	
ユニプレス	28,600	1,235.00	35,321,000	
日東精工	21,100	775.00	16,352,500	
岡部	28,400	902.00	25,616,800	
ジーテクト	20,300	2,092.00	42,467,600	
東ブレ	28,100	2,672.00	75,083,200	
高周波熱錬	24,200	1,289.00	31,193,800	
東京製綱	9,600	1,916.00	18,393,600	
サンコール	15,800	1,729.00	27,318,200	
パイオラックス	17,200	1,566.00	26,935,200	
エイチワン	16,400	1,509.00	24,747,600	
日本発条	120,600	3,925.00	473,355,000	
中央発條	10,400	3,825.00	39,780,000	
三浦工業	72,700	3,162.00	229,877,400	
タクマ	43,900	3,665.00	160,893,500	
弁護士ドットコム	6,000	2,265.00	13,590,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	8,400	705.00	5,922,000	
KeePer技研	9,900	2,753.00	27,254,700	
Gunosy	12,600	456.00	5,745,600	
イー・ガーディアン	5,000	1,700.00	8,500,000	
ジャパンマテリアル	48,800	2,605.00	127,124,000	
ベクトル	21,900	1,747.00	38,259,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	13,300	1,363.00	18,127,900	
キャリアリンク	5,900	2,217.00	13,080,300	
I B J	12,100	796.00	9,631,600	
アサンテ	7,600	1,438.00	10,928,800	
バリューHR	14,400	1,487.00	21,412,800	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,900	3,440.00	44,376,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,300	987.00	6,218,100	
シグマクシス・ホールディングス	44,800	548.00	24,550,400	
ウィルグループ	14,800	1,036.00	15,332,800	
リクルートホールディングス	1,110,100	11,295.00	12,538,579,500	
エラン	14,200	755.00	10,721,000	
ツガミ	33,400	7,620.00	254,508,000	
オークマ	27,200	4,550.00	123,760,000	
芝浦機械	18,700	4,560.00	85,272,000	
アマダ	220,900	2,927.50	646,684,750	

アイダエンジニアリング	27,600	1,165.00	32,154,000	
F U J I	62,400	8,001.00	499,262,400	
牧野フライス製作所	15,800	15,130.00	239,054,000	
オーエスジー	55,900	3,602.00	201,351,800	
旭ダイヤモンド工業	37,700	1,227.00	46,257,900	
DMG森精機	107,300	3,467.00	372,009,100	
ソディック	38,200	1,970.00	75,254,000	
ディスコ	75,600	79,550.00	6,013,980,000	
日東工器	5,600	1,710.00	9,576,000	
日進工具	13,200	938.00	12,381,600	
富士ダイス	11,500	974.00	11,201,000	
日本郵政	1,311,300	2,153.00	2,823,228,900	
ベルシステム24ホールディングス	21,700	1,353.00	29,360,100	
鎌倉新書	15,900	470.00	7,473,000	
エアトリ	13,000	767.00	9,971,000	
アトラエ	11,800	709.00	8,366,200	
ストライクグループ	23,400	1,263.00	29,554,200	
セラク	4,900	1,182.00	5,791,800	
インソース	34,600	605.00	20,933,000	
リケンNPR	18,000	3,915.00	70,470,000	
島精機製作所	25,100	866.00	21,736,600	
オプトラ	25,800	3,685.00	95,073,000	
イワキ	10,400	3,615.00	37,596,000	
フリー	16,400	1,355.00	22,222,000	
ヤマシンフィルタ	32,500	506.00	16,445,000	
日阪製作所	18,400	1,734.00	31,905,600	
やまびこ	25,700	3,875.00	99,587,500	
野村マイクロ・サイエンス	28,100	4,980.00	139,938,000	
平田機工	22,600	2,977.00	67,280,200	
P E G A S U S	17,300	505.00	8,736,500	
マルマエ	12,000	2,663.00	31,956,000	
タツモ	10,400	4,575.00	47,580,000	
ナブテスコ	89,100	5,034.00	448,529,400	
三井海洋開発	39,700	9,351.00	371,234,700	
レオン自動機	18,100	1,479.00	26,769,900	
SMC	44,300	70,450.00	3,120,935,000	
ホソカワミクロン	11,700	4,955.00	57,973,500	
ユニオンツール	6,800	22,040.00	149,872,000	
瑞光	13,300	887.00	11,797,100	
オイレス工業	19,300	2,791.00	53,866,300	
日精エー・エス・ビー機械	6,100	9,070.00	55,327,000	
サトー	21,500	2,382.00	51,213,000	
技研製作所	14,200	1,777.00	25,233,400	
日本エアテック	7,300	1,280.00	9,344,000	
ワイエイシイホールディングス	13,600	1,337.00	18,183,200	
小松製作所	755,500	6,318.00	4,773,249,000	
住友重機械工業	92,700	5,087.00	471,564,900	
日立建機	62,400	5,271.00	328,910,400	
日工	30,200	917.00	27,693,400	
巴工業	17,400	1,803.00	31,372,200	

井関農機	14,700	1,769.00	26,004,300	
TOWA	56,700	3,140.00	178,038,000	
北川鉄工所	6,200	1,672.00	10,366,400	
ローツェ	92,100	4,515.00	415,831,500	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	42,000	7,120.00	299,040,000	
クボタ	792,600	2,704.00	2,143,190,400	
荏原実業	16,400	2,432.00	39,884,800	
東洋エンジニアリング	34,100	2,155.00	73,485,500	
三菱化工機	16,500	3,755.00	61,957,500	
月島ホールディングス	21,000	2,634.00	55,314,000	
TEIKOKU	10,000	3,190.00	31,900,000	
新東工業	31,600	1,203.00	38,014,800	
澁谷工業	14,700	4,420.00	64,974,000	
アイチコーポレーション	22,500	1,361.00	30,622,500	
小森コーポレーション	37,300	1,530.00	57,069,000	
鶴見製作所	22,200	2,287.00	50,771,400	
酒井重工業	6,200	2,081.00	12,902,200	
荏原製作所	318,300	6,164.00	1,962,001,200	
西島製作所	11,600	2,836.00	32,897,600	
AIRMAN	15,700	1,855.00	29,123,500	
ダイキン工業	204,100	24,460.00	4,992,286,000	
オルガノ	21,600	16,190.00	349,704,000	
トーヨーカネツ	13,000	2,437.00	31,681,000	
栗田工業	94,300	9,071.00	855,395,300	
椿本チエイン	67,800	2,584.00	175,195,200	
日機装	36,100	4,155.00	149,995,500	
木村化工機	11,800	1,176.00	13,876,800	
レイズネクスト	22,100	2,275.00	50,277,500	
アネスト岩田	29,000	1,691.00	49,039,000	
ダイフク	264,400	7,001.00	1,851,064,400	
サムコ	4,300	14,000.00	60,200,000	
タダノ	82,600	1,276.00	105,397,600	
CKD	47,300	7,450.00	352,385,000	
平和	46,300	2,028.00	93,896,400	
理想科学工業	25,300	961.00	24,313,300	
SANKYO	146,800	1,593.00	233,852,400	
日本金銭機械	18,900	990.00	18,711,000	
マースグループホールディングス	13,200	2,924.00	38,596,800	
ガリレイ	23,100	3,315.00	76,576,500	
ダイコク電機	7,700	2,198.00	16,924,600	
竹内製作所	28,200	7,190.00	202,758,000	
アマノ	41,400	3,650.00	151,110,000	
JUKI	24,400	533.00	13,005,200	
ジャノメ	11,400	1,290.00	14,706,000	
ブラザー工業	194,300	3,692.00	717,355,600	
マックス	86,500	1,718.00	148,607,000	
モリタホールディングス	23,700	2,455.00	58,183,500	
グローリー	41,000	3,886.00	159,326,000	
新晃工業	42,100	1,259.00	53,003,900	
大和冷機工業	24,100	1,648.00	39,716,800	

セガサミーホールディングス	123,800	2,229.50	276,012,100	
T P R	35,700	1,407.00	50,229,900	
ツバキ・ナカシマ	36,400	397.00	14,450,800	
ホシザキ	100,800	5,300.00	534,240,000	
大豊工業	11,900	1,076.00	12,804,400	
日本精工	289,900	1,160.00	336,284,000	
NTN	415,800	401.90	167,110,020	
ジェイテクト	148,000	2,033.50	300,958,000	
不二越	11,400	5,990.00	68,286,000	
ミネベアミツミ	272,600	4,771.00	1,300,574,600	
日本トムソン	42,600	2,144.00	91,334,400	
THK	82,900	7,359.00	610,061,100	
Y U S H I N	12,500	703.00	8,787,500	
前澤給装工業	11,300	1,509.00	17,051,700	
イーグル工業	17,300	2,897.00	50,118,100	
P I L L A R	14,600	10,520.00	153,592,000	
キッツ	56,000	2,535.00	141,960,000	
日立製作所	3,945,200	4,486.00	17,698,167,200	
三菱電機	1,716,200	5,860.00	10,056,932,000	
富士電機	112,500	13,720.00	1,543,500,000	
安川電機	170,300	6,902.00	1,175,410,600	
シンフォニア テクノロジー	17,300	15,250.00	263,825,000	
明電舎	29,000	9,870.00	286,230,000	
山洋電気	18,100	6,600.00	119,460,000	
デンヨー	11,300	3,645.00	41,188,500	
PHCホールディングス	29,400	1,033.00	30,370,200	
KOKU S A I E L E C T R I C	179,600	9,977.00	1,791,869,200	
ソシオネクスト	135,700	2,517.50	341,624,750	
ベイカレント	117,200	6,068.00	711,169,600	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	3,600	1,149.00	4,136,400	
アイモバイル	23,600	509.00	12,012,400	
M S - J a p a n	10,200	947.00	9,659,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	134,200	1,725.50	231,562,100	
エル・ティー・エス	2,100	1,731.00	3,635,100	
ミダックホールディングス	8,100	2,016.00	16,329,600	
キュービーネットホールディングス	7,700	1,249.00	9,617,300	
オープングループ	22,000	199.00	4,378,000	
三櫻工業	23,700	949.00	22,491,300	
マキタ	194,800	5,777.00	1,125,359,600	
東芝テック	20,000	2,844.00	56,880,000	
芝浦メカトロニクス	48,500	4,305.00	208,792,500	
マブチモーター	151,200	1,570.00	237,384,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,100	226.00	2,282,600	
トレックス・セミコンダクター	6,100	2,451.00	14,951,100	
東光高岳	8,500	7,660.00	65,110,000	
ダブル・スコープ	51,200	178.00	9,113,600	
宮越ホールディングス	7,000	1,010.00	7,070,000	
ダイヘン	14,500	17,750.00	257,375,000	

ヤーマン	30,500	740.00	22,570,000	
JVCケンウッド	121,800	1,103.00	134,345,400	
ミマキエンジニアリング	13,000	1,804.00	23,452,000	
大崎電気工業	29,900	1,504.00	44,969,600	
オムロン	131,600	5,653.00	743,934,800	
日東工業	18,700	4,815.00	90,040,500	
I D E C	20,000	3,255.00	65,100,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	64,200	6,700.00	430,140,000	
BUFFALO	8,400	2,467.00	20,722,800	
テクノメディカ	3,100	1,996.00	6,187,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	6,300	470.00	2,961,000	
日本電気	1,028,900	4,047.00	4,163,958,300	
富士通	1,441,900	3,283.00	4,733,757,700	
沖電気工業	76,000	3,765.00	286,140,000	
電気興業	5,800	3,125.00	18,125,000	
サンケン電気	16,000	10,080.00	161,280,000	
アイホン	8,200	2,693.00	22,082,600	
ルネサスエレクトロニクス	1,519,100	4,810.00	7,306,871,000	
セイコーエプソン	194,800	2,668.50	519,823,800	
ワコム	93,900	764.00	71,739,600	
アルバック	40,100	10,250.00	411,025,000	
アクセル	7,100	1,092.00	7,753,200	
E I Z O	22,200	2,346.00	52,081,200	
ジャパンディスプレイ	900,600	60.00	54,036,000	
日本信号	39,700	1,594.00	63,281,800	
京三製作所	36,500	946.00	34,529,000	
能美防災	21,300	4,150.00	88,395,000	
ホーチキ	36,600	1,955.00	71,553,000	
エレコム	37,500	1,785.00	66,937,500	
パナソニック ホールディングス	1,851,100	4,393.00	8,131,882,300	
シャープ	188,700	633.20	119,484,840	
アンリツ	102,500	4,364.00	447,310,000	
ソニーグループ	5,188,200	3,299.00	17,115,871,800	
T D K	1,353,100	3,593.00	4,861,688,300	
帝国通信工業	6,700	2,962.00	19,845,400	
タムラ製作所	62,500	953.00	59,562,500	
アルプスアルパイン	120,800	2,024.00	244,499,200	
日本電波工業	18,700	3,620.00	67,694,000	
鈴木	8,400	3,320.00	27,888,000	
メイコー	14,000	31,650.00	443,100,000	
日本トリム	3,600	4,480.00	16,128,000	
フォスター電機	14,600	2,951.00	43,084,600	
SMK	3,800	3,155.00	11,989,000	
ヨコオ	14,000	6,080.00	85,120,000	
ホシデン	30,500	2,730.00	83,265,000	
ヒロセ電機	22,900	29,115.00	666,733,500	
日本航空電子工業	36,700	2,307.00	84,666,900	
T O A	15,800	1,576.00	24,900,800	
マクセル	28,300	2,132.00	60,335,600	

古野電気	20,300	5,770.00	117,131,000	
スミダコーポレーション	26,800	1,399.00	37,493,200	
アイコム	6,000	3,090.00	18,540,000	
リオン	6,400	3,840.00	24,576,000	
横河電機	164,000	5,594.00	917,416,000	
新電元工業	6,500	3,955.00	25,707,500	
アズビル	376,800	1,706.00	642,820,800	
日本光電工業	128,900	1,444.00	186,131,600	
チノー	12,900	1,659.00	21,401,100	
日本電子材料	9,600	7,730.00	74,208,000	
堀場製作所	29,300	27,270.00	799,011,000	
アドバンテスト	467,000	31,950.00	14,920,650,000	
エスベック	15,200	4,310.00	65,512,000	
キーエンス	155,200	78,200.00	12,136,640,000	
日置電機	8,100	12,470.00	101,007,000	
シスメックス	401,700	1,486.50	597,127,050	
日本マイクロニクス	25,600	16,650.00	426,240,000	
メガチップス	9,900	10,330.00	102,267,000	
OBARA GROUP	7,300	6,100.00	44,530,000	
デンソー	1,519,800	1,888.00	2,869,382,400	
コーセル	18,900	1,474.00	27,858,600	
イリソ電子工業	12,800	2,964.00	37,939,200	
オブテックスグループ	26,300	4,165.00	109,539,500	
千代田インテグレ	3,900	3,155.00	12,304,500	
レーザーテック	65,600	49,200.00	3,227,520,000	
スタンレー電気	65,800	3,506.00	230,694,800	
ウシオ電機	58,200	4,296.00	250,027,200	
日本セラミック	12,600	3,720.00	46,872,000	
山一電機	14,300	9,680.00	138,424,000	
図研	12,900	4,640.00	59,856,000	
日本電子	35,900	7,343.00	263,613,700	
カシオ計算機	122,400	1,929.50	236,170,800	
ファナック	740,900	7,051.00	5,224,085,900	
日本シイエムケイ	49,500	661.00	32,719,500	
エンプラス	4,600	12,870.00	59,202,000	
大真空	22,500	916.00	20,610,000	
ローム	304,500	5,336.00	1,624,812,000	
浜松ホトニクス	240,700	2,661.00	640,502,700	
三井ハイテック	80,200	991.00	79,478,200	
京セラ	905,100	3,509.00	3,175,995,900	
太陽誘電	83,000	18,610.00	1,544,630,000	
村田製作所	1,480,500	10,740.00	15,900,570,000	
双葉電子工業	32,000	551.00	17,632,000	
日東電工	472,300	3,166.00	1,495,301,800	
東海理化電機製作所	41,600	2,999.00	124,758,400	
ニチコン	40,600	4,235.00	171,941,000	
日本ケミコン	23,900	5,590.00	133,601,000	
KOA	28,100	2,967.00	83,372,700	
三井E&S	77,700	4,066.00	315,928,200	
カナデビア	128,300	1,271.00	163,069,300	

三菱重工業	2,935,500	3,651.00	10,717,510,500	
川崎重工業	584,700	2,908.50	1,700,599,950	
I H I	816,600	2,675.00	2,184,405,000	
名村造船所	48,300	3,590.00	173,397,000	
マネジメントソリューションズ	8,800	1,289.00	11,343,200	
プロレド・パートナーズ	3,900	328.00	1,279,200	
フロンティア・マネジメント	5,100	543.00	2,769,300	
アンビスホールディングス	34,200	341.00	11,662,200	
カーブスホールディングス	43,600	935.00	40,766,000	
Mac bee Planet	6,000	1,059.00	6,354,000	
日本車輛製造	6,000	3,135.00	18,810,000	
ユニソルホールディングス	14,200	2,144.00	30,444,800	
ヤマエグループホールディングス	16,100	2,847.00	45,836,700	
F P G	48,600	1,529.00	74,309,400	
ライフネット生命保険	32,600	1,543.00	50,301,800	
全国保証	87,900	3,030.00	266,337,000	
めぶきフィナンシャルグループ	714,400	1,412.50	1,009,090,000	
ジャパンインベストメントアドバイ ザー	24,900	2,038.00	50,746,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	156,000	1,887.00	294,372,000	
九州フィナンシャルグループ	295,700	1,448.00	428,173,600	
かんぽ生命保険	517,800	1,499.00	776,182,200	
ゆうちょ銀行	1,659,700	3,078.00	5,108,556,600	
富山第一銀行	48,500	2,517.00	122,074,500	
横浜フィナンシャルグループ	796,800	1,725.50	1,374,878,400	
ジェイリース	11,400	1,312.00	14,956,800	
西日本フィナンシャルホールディング ス	93,400	4,163.00	388,824,200	
S B I アルヒ	15,600	792.00	12,355,200	
プレミアムグループ	26,000	2,060.00	53,560,000	
日産自動車	2,370,000	301.90	715,503,000	
いすゞ自動車	399,500	2,161.00	863,319,500	
トヨタ自動車	8,246,500	2,772.00	22,859,298,000	
三菱自動車工業	593,000	314.60	186,557,800	
武蔵精密工業	34,200	3,990.00	136,458,000	
日産車体	23,700	930.00	22,041,000	
新明和工業	44,600	2,057.00	91,742,200	
極東開発工業	25,700	2,133.00	54,818,100	
トピー工業	11,100	2,728.00	30,280,800	
ティラド	28,000	1,482.00	41,496,000	
曙ブレーキ工業	94,900	108.00	10,249,200	
タチエス	28,400	2,142.00	60,832,800	
N O K	56,000	2,908.50	162,876,000	
フタバ産業	41,700	943.00	39,323,100	
カヤバ	26,300	3,860.00	101,518,000	
市光工業	33,800	503.00	17,001,400	
大同メタル工業	30,400	1,727.00	52,500,800	
プレス工業	63,900	789.00	50,417,100	
アイシン	378,900	2,185.00	827,896,500	
マツダ	513,100	1,089.50	559,022,450	

本田技研工業	2,892,300	1,476.00	4,269,034,800	
スズキ	1,139,500	1,971.50	2,246,524,250	
S U B A R U	457,700	2,401.50	1,099,166,550	
ヤマハ発動機	767,600	1,224.00	939,542,400	
小糸製作所	160,800	2,564.50	412,371,600	
エクセディ	25,400	5,830.00	148,082,000	
ミツバ	29,300	1,169.00	34,251,700	
豊田合成	47,800	5,216.00	249,324,800	
愛三工業	25,800	1,969.00	50,800,200	
ヨロズ	14,700	832.00	12,230,400	
エフ・シー・シー	30,200	3,460.00	104,492,000	
シマノ	65,200	17,410.00	1,135,132,000	
ティ・エス テック	57,500	1,749.50	100,596,250	
三十三フィナンシャルグループ	59,100	1,766.00	104,370,600	
第四北越フィナンシャルグループ	143,800	2,141.00	307,875,800	
ひろぎんホールディングス	212,600	2,088.50	444,015,100	
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	6,340.00	82,420,000	
ダイレクトマーケティングミックス	16,700	322.00	5,377,400	
ポピンズ	2,300	1,414.00	3,252,200	
L I T A L I C O	14,700	1,565.00	23,005,500	
十六フィナンシャルグループ	107,100	2,378.00	254,683,800	
C C I グループ	159,500	1,003.00	159,978,500	
ネットプロテクションズホールディングス	46,200	340.00	15,708,000	
プロクレアホールディングス	18,700	3,690.00	69,003,000	
F P パートナー	6,600	2,121.00	13,998,600	
あいちフィナンシャルグループ	156,800	1,391.00	218,108,800	
小野建	17,600	1,336.00	23,513,600	
ノジマ	160,800	1,350.00	217,080,000	
カップ・クリエイト	25,900	1,488.00	38,539,200	
伯東	9,800	4,550.00	44,590,000	
コンドーテック	13,900	1,520.00	21,128,000	
ナガイレーベン	17,900	1,637.00	29,302,300	
良品計画	358,300	3,594.00	1,287,730,200	
松田産業	12,500	5,770.00	72,125,000	
第一興商	54,400	1,734.00	94,329,600	
メディバルホールディングス	175,400	2,661.00	466,739,400	
アドヴァングループ	10,600	899.00	9,529,400	
S P K	12,900	1,293.00	16,679,700	
アルビス	5,400	2,498.00	13,489,200	
アズワン	52,400	2,280.50	119,498,200	
スズデン	9,400	2,268.00	21,319,200	
シモジマ	12,400	1,331.00	16,504,400	
ドウシシャ	19,400	2,887.00	56,007,800	
高速	10,900	3,345.00	36,460,500	
G－7ホールディングス	18,000	1,385.00	24,930,000	
たけびし	6,300	2,271.00	14,307,300	
イオン北海道	48,600	843.00	40,969,800	
コジマ	27,000	1,302.00	35,154,000	
コーナン商事	18,100	4,170.00	75,477,000	

エコス	6,100	2,303.00	14,048,300	
ワタミ	19,700	946.00	18,636,200	
リックス	4,200	3,525.00	14,805,000	
システムソフト	54,200	47.00	2,547,400	
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	1,658,800	826.40	1,370,832,320	
丸文	14,700	1,668.00	24,519,600	
西松屋チェーン	36,300	1,936.00	70,276,800	
ゼンショーホールディングス	83,900	8,204.00	688,315,600	
ハビネット	22,400	3,040.00	68,096,000	
幸楽苑	15,700	1,096.00	17,207,200	
橋本総業ホールディングス	5,800	1,405.00	8,149,000	
日本ライフライン	41,500	1,300.00	53,950,000	
サイゼリヤ	24,300	5,510.00	133,893,000	
タカショー	13,300	402.00	5,346,600	
VTホールディングス	64,000	455.00	29,120,000	
アルゴグラフィックス	55,900	1,204.00	67,303,600	
魚力	5,800	2,247.00	13,032,600	
I DOM	49,500	1,388.00	68,706,000	
日本エム・ディ・エム	12,200	890.00	10,858,000	
ユナイテッドアローズ	17,500	2,428.00	42,490,000	
進和	9,600	3,235.00	31,056,000	
ダイトロン	13,400	3,650.00	48,910,000	
ハイデイ日高	26,600	2,612.00	69,479,200	
シークス	26,300	1,312.00	34,505,600	
コロワイド	92,700	1,869.50	173,302,650	
オーハシテクニカ	15,200	1,113.00	16,917,600	
壺番屋	64,800	883.00	57,218,400	
白銅	4,800	3,420.00	16,416,000	
スギホールディングス	88,200	3,186.00	281,005,200	
薬王堂ホールディングス	9,200	1,688.00	15,529,600	
ダブルエー	6,600	1,436.00	9,477,600	
島津製作所	206,100	4,064.00	837,590,400	
JMS	14,400	452.00	6,508,800	
長野計器	10,200	4,585.00	46,767,000	
ブイ・テクノロジー	7,600	9,350.00	71,060,000	
東京計器	12,900	6,020.00	77,658,000	
愛知時計電機	7,400	3,025.00	22,385,000	
インターアクション	8,000	1,807.00	14,456,000	
東京精密	29,400	19,275.00	566,685,000	
マニー	68,300	1,730.00	118,159,000	
ニコン	193,600	2,152.00	416,627,200	
オリンパス	840,500	1,724.00	1,449,022,000	
理研計器	22,100	3,690.00	81,549,000	
SCREENホールディングス	110,800	16,765.00	1,857,562,000	
タムロン	79,200	1,154.00	91,396,800	
HOYA	291,200	25,805.00	7,514,416,000	
ノーリツ銅機	43,600	2,048.00	89,292,800	
A&Dホロンホールディングス	21,100	2,860.00	60,346,000	
朝日インテック	184,700	3,794.00	700,751,800	

キヤノン	696,400	4,135.00	2,879,614,000	
リコー	363,400	1,420.50	516,209,700	
シチズン時計	128,200	2,453.00	314,474,600	
メニコン	57,900	1,692.00	97,966,800	
トランザクション	26,700	1,406.00	37,540,200	
ニホンフラッシュ	14,700	722.00	10,613,400	
前田工織	31,600	1,774.00	56,058,400	
アートネイチャー	14,200	856.00	12,155,200	
フルヤ金属	14,700	8,260.00	121,422,000	
バンダイナムコホールディングス	411,400	3,834.00	1,577,307,600	
SHOEI	37,400	1,753.00	65,562,200	
フランスベッドホールディングス	22,300	1,239.00	27,629,700	
マーベラス	28,700	426.00	12,226,200	
パイロットコーポレーション	65,100	1,677.50	109,205,250	
萩原工業	10,400	1,731.00	18,002,400	
エイベックス	26,600	1,201.00	31,946,600	
フジシールインターナショナル	31,400	2,852.00	89,552,800	
タカラトミー	76,000	3,243.00	246,468,000	
広済堂ホールディングス	50,100	550.00	27,555,000	
レック	15,600	923.00	14,398,800	
三光合成	19,500	759.00	14,800,500	
プロネクス	16,100	1,121.00	18,048,100	
TOPPANホールディングス	188,000	5,090.00	956,920,000	
大日本印刷	334,700	2,938.00	983,348,600	
共同印刷	15,700	1,581.00	24,821,700	
NISSHA	27,700	1,393.00	38,586,100	
ZACROS	49,200	1,387.00	68,240,400	
TAKARA & COMPANY	8,400	3,230.00	27,132,000	
未来工業	7,400	3,090.00	22,866,000	
アシックス	596,500	4,487.00	2,676,495,500	
ツツミ	3,700	2,613.00	9,668,100	
JSP	9,100	2,490.00	22,659,000	
ニチハ	18,000	3,080.00	55,440,000	
ローランド	12,200	4,230.00	51,606,000	
エフピコ	29,400	2,630.00	77,322,000	
小松ウオール工業	11,300	2,541.00	28,713,300	
ヤマハ	241,700	1,151.00	278,196,700	
河合楽器製作所	4,300	3,210.00	13,803,000	
クリナップ	17,500	891.00	15,592,500	
ピジョン	91,700	2,025.00	185,692,500	
キングジム	14,000	764.00	10,696,000	
象印マホービン	42,100	1,434.00	60,371,400	
リンテック	33,700	6,960.00	234,552,000	
信越ポリマー	33,600	2,405.00	80,808,000	
イトーキ	34,100	2,666.00	90,910,600	
任天堂	970,500	6,935.00	6,730,417,500	
三菱鉛筆	21,000	2,685.00	56,385,000	
松風	14,100	2,051.00	28,919,100	
タカラスタンダード	33,100	3,080.00	101,948,000	
コクヨ	307,000	803.40	246,643,800	

ナカバヤシ	16,800	565.00	9,492,000	
ニフコ	58,200	4,864.00	283,084,800	
立川ブラインド工業	8,100	2,480.00	20,088,000	
グローブライド	14,600	2,343.00	34,207,800	
オカムラ	46,700	2,293.00	107,083,100	
バルカー	13,000	7,270.00	94,510,000	
伊藤忠商事	5,516,400	1,849.50	10,202,581,800	
丸紅	1,252,500	4,713.00	5,903,032,500	
スクロール	28,000	1,639.00	45,892,000	
ヨンドシーホールディングス	15,500	1,946.00	30,163,000	
三陽商会	7,300	3,990.00	29,127,000	
長瀬産業	280,400	1,168.50	327,647,400	
蝶理	8,800	3,880.00	34,144,000	
豊田通商	493,000	5,964.00	2,940,252,000	
オンワードホールディングス	90,500	736.00	66,608,000	
三共生興	21,500	790.00	16,985,000	
兼松	137,100	2,067.00	283,385,700	
美津濃	41,700	3,455.00	144,073,500	
ルックホールディングス	5,100	2,682.00	13,678,200	
三井物産	2,325,700	4,513.00	10,495,884,100	
日本紙パルプ商事	87,300	1,098.00	95,855,400	
東京エレクトロン	325,700	74,700.00	24,329,790,000	
カメイ	15,400	3,430.00	52,822,000	
スターゼン	37,400	1,212.00	45,328,800	
セイコーグループ	43,200	8,120.00	350,784,000	
山善	49,600	1,671.00	82,881,600	
椿本興業	11,300	2,702.00	30,532,600	
住友商事	3,880,000	1,532.50	5,946,100,000	
B I P R O G Y	51,700	4,314.00	223,033,800	
内田洋行	30,000	2,015.00	60,450,000	
三菱商事	3,012,300	4,414.00	13,296,292,200	
第一実業	15,300	3,045.00	46,588,500	
キヤノンマーケティングジャパン	77,200	3,333.00	257,307,600	
西華産業	23,600	2,768.00	65,324,800	
佐藤商事	11,300	2,844.00	32,137,200	
東京産業	16,600	812.00	13,479,200	
Y U A S A	14,200	5,270.00	74,834,000	
神鋼商事	12,200	2,394.00	29,206,800	
阪和興業	134,700	1,732.00	233,300,400	
正栄食品工業	10,800	4,160.00	44,928,000	
カナデン	13,100	2,536.00	33,221,600	
RYODEN	12,500	3,960.00	49,500,000	
ニプロ	129,200	1,612.50	208,335,000	
岩谷産業	163,100	1,896.00	309,237,600	
極東貿易	9,200	1,700.00	15,640,000	
アステナホールディングス	31,400	501.00	15,731,400	
三愛オブリ	36,600	2,111.00	77,262,600	
稲畑産業	37,400	3,855.00	144,177,000	
G S I クレオス	9,500	2,372.00	22,534,000	
明和産業	23,500	879.00	20,656,500	

ゴールドウイン	90,900	2,185.00	198,616,500	
ユニ・チャーム	972,300	944.50	918,337,350	
ワキタ	27,100	1,725.00	46,747,500	
東邦ホールディングス	46,600	3,904.00	181,926,400	
サンゲツ	41,200	2,956.00	121,787,200	
ミツウロコグループホールディングス	19,800	1,958.00	38,768,400	
シナネンホールディングス	3,200	7,090.00	22,688,000	
伊藤忠エネクス	40,700	2,023.00	82,336,100	
サンリオ	814,900	1,126.50	917,984,850	
サンワテクノス	9,300	3,615.00	33,619,500	
新光商事	19,700	1,583.00	31,185,100	
トーヨー	18,800	1,367.00	25,699,600	
三信電気	9,400	2,726.00	25,624,400	
東陽テクニカ	13,600	1,948.00	26,492,800	
モスフードサービス	24,200	3,685.00	89,177,000	
加賀電子	30,500	4,260.00	129,930,000	
都築電気	9,900	3,955.00	39,154,500	
ソーダニッカ	16,000	1,115.00	17,840,000	
立花エレテック	9,800	3,185.00	31,213,000	
木曽路	25,000	2,363.00	59,075,000	
SRSホールディングス	27,000	1,245.00	33,615,000	
千趣会	33,300	107.00	3,563,100	
リテールパートナーズ	24,400	1,361.00	33,208,400	
J o s h i n	17,800	3,970.00	70,666,000	
日本瓦斯	75,100	2,896.00	217,489,600	
ロイヤルホールディングス	63,700	1,228.00	78,223,600	
チヨダ	16,500	978.00	16,137,000	
ライフコーポレーション	31,500	2,663.00	83,884,500	
リンガーハット	22,800	2,192.00	49,977,600	
MrMaxHD	14,000	773.00	10,822,000	
AOKIホールディングス	35,200	1,650.00	58,080,000	
オークワ	22,000	771.00	16,962,000	
コメリ	21,900	3,605.00	78,949,500	
青山商事	105,500	688.00	72,584,000	
しまむら	115,500	3,313.00	382,651,500	
高島屋	230,100	2,524.50	580,887,450	
松屋	31,000	1,801.00	55,831,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	80,000	2,876.00	230,080,000	
近鉄百貨店	9,400	1,828.00	17,183,200	
丸井グループ	95,800	2,847.00	272,742,600	
クレディセゾン	74,700	4,297.00	320,985,900	
アクシアル リテイリング	44,700	1,131.00	50,555,700	
イオン	1,937,500	1,372.00	2,658,250,000	
イズミ	87,100	971.00	84,574,100	
フォーバル	6,400	1,006.00	6,438,400	
平和堂	26,800	2,531.00	67,830,800	
フジ	25,300	1,999.00	50,574,700	
ゼビオホールディングス	19,400	1,071.00	20,777,400	
ケーズホールディングス	107,200	1,920.00	205,824,000	
PALTAC	25,300	6,647.00	168,169,100	

三谷産業	28,500	701.00	19,978,500	
SBI新生銀行	259,700	1,425.00	370,072,500	
あおぞら銀行	97,300	2,711.50	263,828,950	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,637,800	3,211.00	30,946,975,800	
りそなホールディングス	1,873,700	2,104.50	3,943,201,650	
三井住友トラストグループ	526,800	6,019.00	3,170,809,200	
三井住友フィナンシャルグループ	3,330,100	6,344.00	21,126,154,400	
千葉銀行	449,900	2,472.50	1,112,377,750	
群馬銀行	275,600	2,341.50	645,317,400	
武蔵野銀行	64,000	2,541.00	162,624,000	
千葉興業銀行	28,700	2,406.00	69,052,200	
筑波銀行	66,900	629.00	42,080,100	
七十七銀行	146,700	3,331.00	488,657,700	
秋田銀行	10,300	6,920.00	71,276,000	
山形銀行	19,600	3,455.00	67,718,000	
岩手銀行	39,000	2,070.00	80,730,000	
東邦銀行	175,800	773.00	135,893,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	122,000	6,884.00	839,848,000	
スルガ銀行	89,800	2,407.00	216,148,600	
八十二長野銀行	315,100	2,388.50	752,616,350	
山梨中央銀行	18,600	6,190.00	115,134,000	
大垣共立銀行	31,100	7,320.00	227,652,000	
福井銀行	14,700	5,470.00	80,409,000	
清水銀行	6,100	2,364.00	14,420,400	
滋賀銀行	104,600	2,512.00	262,755,200	
南都銀行	114,800	1,773.00	203,540,400	
百五銀行	143,600	1,970.00	282,892,000	
紀陽銀行	50,700	4,465.00	226,375,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	91,300	6,693.00	611,070,900	
山陰合同銀行	95,500	2,270.00	216,785,000	
百十四銀行	59,800	2,587.00	154,702,600	
四国銀行	24,000	3,045.00	73,080,000	
阿波銀行	22,700	7,160.00	162,532,000	
大分銀行	48,200	2,418.00	116,547,600	
宮崎銀行	44,500	2,152.00	95,764,000	
佐賀銀行	9,600	5,290.00	50,784,000	
琉球銀行	32,500	2,590.00	84,175,000	
セブン銀行	478,700	280.70	134,371,090	
みずほフィナンシャルグループ	2,124,800	7,652.00	16,258,969,600	
山口フィナンシャルグループ	149,700	2,876.00	430,537,200	
芙蓉総合リース	42,200	4,226.00	178,337,200	
みずほリース	114,800	1,257.00	144,303,600	
東京センチュリー	114,300	2,493.00	284,949,900	
SBIホールディングス	536,400	2,687.00	1,441,306,800	
日本証券金融	53,000	2,319.00	122,907,000	
名古屋銀行	28,500	5,970.00	170,145,000	
北洋銀行	197,400	1,105.00	218,127,000	
愛媛銀行	22,400	2,104.00	47,129,600	
京葉銀行	65,900	2,473.00	162,970,700	
栃木銀行	82,500	939.00	77,467,500	

北日本銀行	5,000	5,370.00	26,850,000	
東和銀行	30,200	1,444.00	43,608,800	
リコーリース	14,600	6,110.00	89,206,000	
イオンフィナンシャルサービス	87,700	1,469.50	128,875,150	
アコム	272,900	454.40	124,005,760	
ジャックス	18,300	3,495.00	63,958,500	
オリエントコーポレーション	59,700	837.00	49,968,900	
オリックス	912,600	6,138.00	5,601,538,800	
三菱HCキャピタル	765,800	1,319.50	1,010,473,100	
ジャフコ グループ	40,900	2,411.50	98,630,350	
トモニホールディングス	145,900	882.00	128,683,800	
大和証券グループ本社	1,092,600	1,588.50	1,735,595,100	
野村ホールディングス	2,507,400	1,415.00	3,547,971,000	
岡三証券グループ	120,700	965.00	116,475,500	
丸三証券	50,700	1,074.00	54,451,800	
東洋証券	47,200	610.00	28,792,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	181,200	757.00	137,168,400	
水戸証券	42,000	656.00	27,552,000	
いちよし証券	28,400	1,400.00	39,760,000	
松井証券	105,200	954.00	100,360,800	
SOMPOホールディングス	758,700	6,214.00	4,714,561,800	
日本取引所グループ	837,900	2,037.00	1,706,802,300	
マネックスグループ	161,800	617.00	99,830,600	
極東証券	21,000	1,552.00	32,592,000	
岩井コスモホールディングス	15,900	3,995.00	63,520,500	
アイザワ証券グループ	16,000	1,486.00	23,776,000	
フィデアホールディングス	15,700	1,946.00	30,552,200	
池田泉州ホールディングス	211,800	979.00	207,352,200	
アニコム ホールディングス	47,800	1,220.00	58,316,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	952,500	4,260.00	4,057,650,000	
ソニーフィナンシャルグループ	5,065,500	141.50	716,768,250	
スパークス・グループ	16,900	2,194.00	37,078,600	
第一ライフグループ	2,940,100	1,739.00	5,112,833,900	
東京海上ホールディングス	1,570,400	7,248.00	11,382,259,200	
イー・ギャランティ	23,700	1,720.00	40,764,000	
NECキャピタルソリューション	7,500	3,980.00	29,850,000	
T&Dホールディングス	339,700	4,680.00	1,589,796,000	
アドバンスクリエイト	11,800	125.00	1,475,000	
三井不動産	2,206,700	1,520.50	3,355,287,350	
三菱地所	917,900	4,165.00	3,823,053,500	
平和不動産	28,700	2,427.00	69,654,900	
東京建物	144,700	3,328.00	481,561,600	
京阪神ビルディング	45,600	1,077.00	49,111,200	
住友不動産	434,300	3,738.00	1,623,413,400	
テーオーシー	27,100	987.00	26,747,700	
レオパレス21	135,800	652.00	88,541,600	
スターツコーポレーション	28,000	4,575.00	128,100,000	
フジ住宅	19,000	747.00	14,193,000	

空港施設	21,600	942.00	20,347,200	
明和地所	12,100	789.00	9,546,900	
ゴールドクレスト	8,400	3,325.00	27,930,000	
リログループ	71,100	1,932.00	137,365,200	
エスリード	7,100	4,910.00	34,861,000	
日神グループホールディングス	24,500	649.00	15,900,500	
エスコン	34,200	1,082.00	37,004,400	
MIRARTHホールディングス	97,400	408.00	39,739,200	
ランド	984,900	10.00	9,849,000	
カチタス	41,100	3,330.00	136,863,000	
東祥	13,400	761.00	10,197,400	
トーセイ	45,100	1,706.00	76,940,600	
サンフロンティア不動産	22,700	2,451.00	55,637,700	
FJネクストホールディングス	14,200	1,796.00	25,503,200	
グランディハウス	14,500	506.00	7,337,000	
東武鉄道	160,200	2,943.50	471,548,700	
相鉄ホールディングス	59,700	2,475.00	147,757,500	
東急	398,700	1,690.50	674,002,350	
京浜急行電鉄	176,000	1,481.00	260,656,000	
小田急電鉄	235,200	1,693.50	398,311,200	
京王電鉄	339,800	750.60	255,053,880	
京成電鉄	270,000	1,150.00	310,500,000	
富士急行	18,900	2,560.00	48,384,000	
東日本旅客鉄道	855,400	3,452.00	2,952,840,800	
西日本旅客鉄道	369,900	2,744.50	1,015,190,550	
東海旅客鉄道	638,600	3,485.00	2,225,521,000	
東京地下鉄	247,000	1,427.50	352,592,500	
西武ホールディングス	159,700	3,171.00	506,408,700	
鴻池運輸	26,400	2,723.00	71,887,200	
西日本鉄道	44,800	2,965.00	132,832,000	
ハマキョウレックス	48,500	1,825.00	88,512,500	
サカイ引越センター	19,600	2,950.00	57,820,000	
近鉄グループホールディングス	165,800	3,393.00	562,559,400	
阪急阪神ホールディングス	204,300	4,265.00	871,339,500	
NANKAI	70,800	2,851.50	201,886,200	
京阪ホールディングス	80,600	3,217.00	259,290,200	
神戸電鉄	4,300	2,430.00	10,449,000	
名古屋鉄道	171,200	1,856.00	317,747,200	
山陽電気鉄道	11,600	1,947.00	22,585,200	
ヤマトホールディングス	188,200	1,854.00	348,922,800	
山九	33,700	8,688.00	292,785,600	
丸全昭和運輸	9,600	7,500.00	72,000,000	
センコーグループホールディングス	112,000	1,935.00	216,720,000	
ニッコンホールディングス	66,000	5,865.00	387,090,000	
福山通運	15,900	5,590.00	88,881,000	
セイノーホールディングス	76,100	2,647.00	201,436,700	
神奈川中央交通	4,500	3,580.00	16,110,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	48,100	802.00	38,576,200	
日本郵船	305,500	5,198.00	1,587,989,000	
商船三井	294,700	5,234.00	1,542,459,800	

川崎汽船	333,600	2,444.00	815,318,400	
NSユニテッド海運	9,700	6,520.00	63,244,000	
飯野海運	56,900	1,400.00	79,660,000	
九州旅客鉄道	116,600	3,545.00	413,347,000	
SGホールディングス	260,100	1,558.50	405,365,850	
NIPPON EXPRESSホールディングス	155,100	5,016.00	777,981,600	
日本航空	354,900	2,865.50	1,016,965,950	
ANAホールディングス	421,500	2,999.00	1,264,078,500	
ビーウィズ	4,200	1,529.00	6,421,800	
サンウェルズ	12,100	142.00	1,718,200	
TREホールディングス	36,600	2,123.00	77,701,800	
人・夢・技術グループ	6,400	1,561.00	9,990,400	
シルバーライフ	4,600	651.00	2,994,600	
Genky DrugStores	14,500	3,395.00	49,227,500	
コーア商事ホールディングス	14,800	756.00	11,188,800	
KPPグループホールディングス	42,900	1,023.00	43,886,700	
ブックオフグループホールディングス	11,800	1,979.00	23,352,200	
ギフトホールディングス	9,300	4,315.00	40,129,500	
三菱倉庫	168,000	1,530.50	257,124,000	
三井倉庫ホールディングス	47,900	3,364.00	161,135,600	
住友倉庫	44,400	3,760.00	166,944,000	
澁澤倉庫	24,900	1,599.00	39,815,100	
ヤマタネ	13,200	2,023.00	26,703,600	
乾汽船	19,600	1,465.00	28,714,000	
日本トランスシティ	39,100	1,142.00	44,652,200	
中央倉庫	8,400	1,844.00	15,489,600	
安田倉庫	10,500	2,400.00	25,200,000	
NISSOホールディングス	13,900	582.00	8,089,800	
大栄環境	34,700	3,790.00	131,513,000	
GENOVA	9,400	589.00	5,536,600	
日本管財ホールディングス	16,700	2,677.00	44,705,900	
上組	68,000	5,179.00	352,172,000	
キューソー流通システム	8,800	3,195.00	28,116,000	
エーアイテイー	9,800	2,289.00	22,432,200	
TBSホールディングス	74,700	6,085.00	454,549,500	
日本テレビホールディングス	136,400	2,740.00	373,736,000	
朝日放送グループホールディングス	19,400	767.00	14,879,800	
テレビ朝日ホールディングス	37,800	3,120.00	117,936,000	
スカパーJSAT	103,600	2,593.00	268,634,800	
テレビ東京ホールディングス	9,600	3,535.00	33,936,000	
ビジョン	32,500	975.00	31,687,500	
U-NEXT HOLDINGS	52,200	1,675.00	87,435,000	
日本通信	125,400	108.00	13,543,200	
NTT	42,718,700	146.00	6,236,930,200	
KDDI	2,091,200	2,717.00	5,681,790,400	
ソフトバンク	25,013,300	207.80	5,197,763,740	
光通信	15,300	35,080.00	536,724,000	
エムティーアイ	10,500	536.00	5,628,000	
GMOインターネットグループ	50,200	3,388.00	170,077,600	

ファイバーゲート	6,000	766.00	4,596,000	
KADOKAWA	86,400	3,444.00	297,561,600	
学研ホールディングス	25,800	1,002.00	25,851,600	
ゼンリン	23,300	856.00	19,944,800	
東京電力ホールディングス	1,398,300	462.00	646,014,600	
中部電力	571,600	3,044.00	1,739,950,400	
関西電力	840,900	2,308.50	1,941,217,650	
中国電力	269,500	896.40	241,579,800	
北陸電力	158,600	878.00	139,250,800	
東北電力	408,400	1,050.00	428,820,000	
四国電力	144,400	1,483.00	214,145,200	
九州電力	357,500	1,684.00	602,030,000	
北海道電力	174,800	927.60	162,144,480	
沖縄電力	39,700	910.00	36,127,000	
電源開発	112,500	3,722.00	418,725,000	
エフオン	11,300	317.00	3,582,100	
イーレックス	31,800	745.00	23,691,000	
レノバ	42,300	982.00	41,538,600	
東京瓦斯	252,500	6,163.00	1,556,157,500	
大阪瓦斯	277,100	5,463.00	1,513,797,300	
東邦瓦斯	212,400	1,221.50	259,446,600	
北海道瓦斯	46,300	763.00	35,326,900	
広島ガス	33,100	391.00	12,942,100	
西部ガスホールディングス	17,900	2,270.00	40,633,000	
静岡ガス	35,400	1,245.00	44,073,000	
メタウォーター	20,500	3,395.00	69,597,500	
クオッツ総研ホールディングス	18,800	850.00	15,980,000	
松竹	8,900	10,570.00	94,073,000	
東宝	394,300	1,299.00	512,195,700	
エイチ・アイ・エス	46,300	980.00	45,374,000	
東映	25,800	5,760.00	148,608,000	
ラックランド	7,200	1,182.00	8,510,400	
共立メンテナンス	63,600	3,010.00	191,436,000	
イチネンホールディングス	15,200	2,228.00	33,865,600	
建設技術研究所	16,400	2,884.00	47,297,600	
スペース	11,400	1,410.00	16,074,000	
アインホールディングス	18,500	5,474.00	101,269,000	
燦ホールディングス	13,400	1,343.00	17,996,200	
ピー・シー・エー	10,300	1,278.00	13,163,400	
スバル興業	5,400	3,595.00	19,413,000	
タナベコンサルティンググループ	13,300	746.00	9,921,800	
ビジネスブレイン太田昭和	16,600	1,004.00	16,666,400	
ナガワ	4,400	5,080.00	22,352,000	
東京都競馬	11,500	4,830.00	55,545,000	
カナモト	22,600	5,450.00	123,170,000	
D T S	123,700	999.00	123,576,300	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	256,000	2,410.50	617,088,000	
シーイーシー	18,800	2,095.00	39,386,000	
カプコン	309,300	3,049.00	943,055,700	

ニシオホールディングス	13,200	3,950.00	52,140,000	
アイ・エス・ビー	7,300	2,303.00	16,811,900	
日本空港ビルデング	54,100	5,023.00	271,744,300	
トランス・コスモス	20,300	3,645.00	73,993,500	
乃村工芸社	69,500	1,094.00	76,033,000	
藤田観光	31,600	1,860.00	58,776,000	
KNT－CTホールディングス	7,900	1,845.00	14,575,500	
トーカイ	11,400	2,344.00	26,721,600	
セコム	297,800	6,451.00	1,921,107,800	
NSW	6,700	2,568.00	17,205,600	
セントラル警備保障	7,700	2,567.00	19,765,900	
アイネス	12,000	2,144.00	25,728,000	
丹青社	33,700	1,362.00	45,899,400	
メイテックグループホールディングス	58,800	3,097.00	182,103,600	
TKC	24,000	3,405.00	81,720,000	
応用地質	14,200	2,785.00	39,547,000	
船井総研ホールディングス	63,900	1,064.00	67,989,600	
NSD	55,000	2,485.00	136,675,000	
コナミグループ	66,600	17,930.00	1,194,138,000	
学究社	6,300	2,527.00	15,920,100	
ナック	16,300	505.00	8,231,500	
福井コンピュータホールディングス	8,400	3,115.00	26,166,000	
ダイセキ	30,700	3,935.00	120,804,500	
ステップ	5,900	2,235.00	13,186,500	
泉州電業	10,400	6,930.00	72,072,000	
GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	9,300	3,170.00	29,481,000	
トラスコ中山	34,400	2,263.00	77,847,200	
ヤマダホールディングス	504,800	656.70	331,502,160	
オートバックスセブン	57,100	1,472.00	84,051,200	
モリト	11,500	1,771.00	20,366,500	
アー克蘭ズ	48,800	1,944.00	94,867,200	
ニトリホールディングス	265,400	2,482.50	658,855,500	
グルメ杵屋	13,400	964.00	12,917,600	
ケーユーホールディングス	11,400	1,141.00	13,007,400	
吉野家ホールディングス	60,400	3,182.00	192,192,800	
加藤産業	20,300	5,960.00	120,988,000	
イノテック	10,400	3,930.00	40,872,000	
イエローハット	39,900	1,772.00	70,702,800	
松屋フーズホールディングス	7,700	4,770.00	36,729,000	
JBC Cホールディングス	41,400	1,237.00	51,211,800	
JKホールディングス	10,900	1,423.00	15,510,700	
サガミホールディングス	26,400	1,660.00	43,824,000	
日伝	9,200	2,531.00	23,285,200	
ミロク情報サービス	13,200	1,795.00	23,694,000	
杉本商事	13,200	1,179.00	15,562,800	
因幡電機産業	85,700	2,722.00	233,275,400	
王将フードサービス	33,900	2,867.00	97,191,300	
ミニストップ	11,800	1,867.00	22,030,600	
アークス	27,400	3,430.00	93,982,000	

バローホールディングス	31,400	3,900.00	122,460,000	
東テク	18,300	4,140.00	75,762,000	
ミスミグループ本社	231,600	3,932.00	910,651,200	
ベルク	7,200	6,510.00	46,872,000	
大 庄	11,100	1,080.00	11,988,000	
ファーストリテイリング	110,600	84,380.00	9,332,428,000	
ソフトバンクグループ	2,982,100	5,894.00	17,576,497,400	
スズケン	54,500	5,006.00	272,827,000	
サンドラッグ	48,400	3,833.00	185,517,200	
サックスパー ホールディングス	14,100	745.00	10,504,500	
ジェコス	11,700	1,533.00	17,936,100	
ベルーナ	39,600	959.00	37,976,400	
合計	327,057,540		862,377,185,590	

（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)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	22,890,530,469
コール・ローン	455,912,170
株式	2,741,510,673,917
投資信託受益証券	3,080,025,347
投資証券	40,413,630,346
派生商品評価勘定	12,006,110
未収入金	92,439,395
未収配当金	2,337,442,729
差入委託証拠金	10,633,653,998
流動資産合計	2,821,426,314,481
資産合計	2,821,426,314,481
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	405,210,196
未払金	2,707,333,162
未払解約金	263,302,000
流動負債合計	3,375,845,358
負債合計	3,375,845,358
純資産の部	
元本等	
元本	208,055,677,178
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,609,994,791,945
元本等合計	2,818,050,469,123
純資産合計	2,818,050,469,123
負債純資産合計	2,821,426,314,481

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月29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	188,792,775,387円
同期中追加設定元本額	33,941,265,489円
同期中一部解約元本額	14,678,363,698円

元本の内訳

ファンド名

インデックスオープン・世界株式	31,265,579円
インデックスオープン・先進国株式	43,038,031円
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,724,214,979円
たわらノーロード 先進国株式	95,702,138,842円
たわらノーロード 先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,805,726,394円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	1,261,968,507円
たわらノーロード バランス（堅実型）	62,849,475円
たわらノーロード バランス（標準型）	793,030,525円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,406,885,121円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	1,335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	54,887,558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）	344,479,454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）	452,720,240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）	730,563,155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）	626,723円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	19,399,180円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	10,697,506円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	24,942,036円
たわらノーロード 全世界株式	20,652,164,079円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	45,489,299円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	15,834,354円
D I A M外国株式インデックスファンド＜DC年金＞	57,282,525,324円
One DC 先進国株式インデックスファンド	4,380,842,180円
One グローバルバランス	62,587,059円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞１安定型	107,604,817円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞２安定・成長型	627,184,284円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞３成長型	921,566,057円
D I A M DC バランス３０インデックスファンド	50,132,030円
D I A M DC バランス５０インデックスファンド	174,696,900円
D I A M DC バランス７０インデックスファンド	201,594,522円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,927,979円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	509,942,661円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	102,863,586円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国１０）	107,111,273円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国２０）	158,544,616円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国３０）	297,435,927円
投資のソムリエ	2,298,974,461円
クルーズコントロール	38,404,013円
投資のソムリエ＜DC年金＞	507,903,401円
D I A M ８資産バランスファンドN＜DC年金＞	152,589,901円
４資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	393,960,304円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	254,574,454円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	420,352,551円
ワールドアセットバランス（基本コース）	40,060,586円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	87,500,380円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	101,776,247円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	55,767,524円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	2,860,109円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	202,272,935円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	175,956,634円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	133,732,899円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	90,867,778円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	80,667,871円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	65,795,308円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	36,692,230円
4資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	251,766,075円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	16,219,309円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	22,124,884円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	616,724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）	5,882,486円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09（適格機関投資家限定）	1,285,142円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03（適格機関投資家限定）	3,547,111円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04（適格機関投資家限定）	3,342,897円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	18,391,324円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	1,432,500円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	17,597,282円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	916,234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）	215,446,816円
ハイブリッドストラテジーマルチアセットファンド（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	13,447,425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）	11,984,732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）	837,434,990円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	1,027,523,864円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	10,899,067円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	2,619,592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）	1,709,461円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,688,359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）	6,281,866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）	22,098,323円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	796,543円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,131,605円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	402,103円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	21,750円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	37,310,638円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	103,817,901円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	391,795,594円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	11,917,610円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	12,793,975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）	48,728,139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）	1,890,736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）	88,533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）	20,489,345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）	2,468,719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）	6,173,418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）	9,298,145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）	17,805,341円
動的パッケージファンド<DC年金>	11,302,813円
コア資産形成ファンド	3,716,401円
たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジなし）<ラップ専用>	3,242,491,023円
One外国株式インデックスファンド	122,332,836円
たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジあり）<ラップ専用>	646,283,493円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,038,517,846円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,505,653,588円
計	208,055,677,178円
2. 受益権の総数	208,055,677,178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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	162,470,256,292
投資信託受益証券	2,515,317
投資証券	1,606,591,238
合計	164,079,362,847

（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（2026年2月17日から2026年6月29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	2026年6月29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	6,085,880,966	—	6,086,125,392	244,426
アメリカ・ドル	5,267,729,601	—	5,267,928,272	198,671
イギリス・ポンド	110,370,504	—	110,375,519	5,015
オーストラリア・ドル	58,790,635	—	58,792,113	1,478
カナダ・ドル	179,700,096	—	179,707,508	7,412
ユーロ	469,290,130	—	469,321,980	31,850
合計	6,085,880,966	—	6,086,125,392	244,426

（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	2026年6月29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	39,230,102,404	—	38,836,653,892	△393,448,512
合計	39,230,102,404	—	38,836,653,892	△393,448,512

（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）

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	13.5447円 (135,447円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2026年6月29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	2,019,073	232.690	469,818,096.370	
	ABBOTT LABORATORIES	365,145	94.120	34,367,447.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	196,084	271.630	53,262,296.920	
	ADVANCED MICRO DEVICES	340,250	521.580	177,467,595.000	
	ADOBE INC	84,028	202.730	17,034,996.440	
	CHUBB LTD	71,817	341.440	24,521,196.480	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	45,147	277.790	12,541,385.130	
	ALLSTATE CORP	53,455	239.610	12,808,352.550	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	131,689	232.210	30,579,502.690	
	AMGEN INC	112,890	358.330	40,451,873.700	

AMERICAN EXPRESS CO	110,609	340.360	37,646,879.240	
AMERICAN ELECTRIC POWER	112,689	138.690	15,628,837.410	
AFLAC INC	96,261	120.150	11,565,759.150	
AMERICAN INTL GROUP	114,176	75.570	8,628,280.320	
ANALOG DEVICES	102,108	386.910	39,506,606.280	
COMFORT SYSTEMS USA INC	7,434	1,854.230	13,784,345.820	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	127,012	138.400	17,578,460.800	
VALERO ENERGY CORP	62,618	259.370	16,241,230.660	
APPLE INC	3,062,506	283.780	869,077,952.680	
APPLIED MATERIALS INC	165,868	626.840	103,972,697.120	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	99,892	76.790	7,670,706.680	
AMEREN CORP	58,769	118.320	6,953,548.080	
AUTODESK INC	43,162	196.260	8,470,974.120	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	83,467	223.550	18,659,047.850	
AUTOZONE INC	3,422	3,128.700	10,706,411.400	
AVERY DENNISON CORP	15,877	165.760	2,631,771.520	
BALL CORP	51,188	61.790	3,162,906.520	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	290,122	498.660	144,672,236.520	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	141,767	143.560	20,352,070.520	
BECTON DICKINSON & CO	60,659	155.920	9,457,951.280	
AMETEK INC	47,821	237.520	11,358,443.920	
VERIZON COMM INC	875,009	46.540	40,722,918.860	
WR BERKLEY CORP	47,466	71.270	3,382,901.820	
BEST BUY CO INC	40,496	77.710	3,146,944.160	
YUM! BRANDS INC	56,238	156.410	8,796,185.580	
FIRSTENERGY CORP	116,401	48.470	5,641,956.470	
BOEING CO	156,060	217.250	33,904,035.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	308,522	44.230	13,645,928.060	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	25,595	179.330	4,589,951.350	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	36,292	238.530	8,656,730.760	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	4,439	1,263.750	5,609,786.250	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	422,005	57.520	24,273,727.600	
ONEOK INC	130,263	89.220	11,622,064.860	
UNITED RENTALS INC	13,076	1,121.660	14,666,826.160	
SEMPRA	137,609	94.270	12,972,400.430	
FEDEX CORP	46,333	318.530	14,758,450.490	
VERISIGN INC	16,703	255.620	4,269,620.860	
AMPHENOL CORP	257,033	163.720	42,081,442.760	
QUANTA SERVICES INC	31,029	687.870	21,343,918.230	
MASTEC INC	12,794	396.250	5,069,622.500	
CSX CORP	386,402	47.660	18,415,919.320	

CONSTELLATION BRANDS INC	30,084	146.300	4,401,289.200	
CARDINAL HEALTH INC	49,763	237.920	11,839,612.960	
CARLISLE COS INC	8,371	388.380	3,251,128.980	
CARNIVAL CORP LTD	261,654	29.070	7,606,281.780	
CASEY'S GENERAL STORES INC	7,897	778.630	6,148,841.110	
CATERPILLAR INC	97,107	997.470	96,861,319.290	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	16,461	130.050	2,140,753.050	
JPMORGAN CHASE & CO	559,467	329.050	184,092,616.350	
CHURCH & DWIGHT CO INC	47,891	99.580	4,768,985.780	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32,053	184.080	5,900,316.240	
CINTAS CORP	71,020	171.900	12,208,338.000	
CISCO SYSTEMS INC	824,874	113.770	93,845,914.980	
CLOROX COMPANY	25,012	97.540	2,439,670.480	
COCA-COLA CO/THE	808,150	82.630	66,777,434.500	
COPART INC	183,663	30.550	5,610,904.650	
COEUR MINING INC	203,453	16.020	3,259,317.060	
COLGATE-PALMOLIVE CO	157,014	92.070	14,456,278.980	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	45,093	377.310	17,014,039.830	
CIENA CORP	29,237	479.500	14,019,141.500	
NRG ENERGY, INC.	40,981	149.360	6,120,922.160	
COMCAST CORP-CL A	742,651	23.170	17,207,223.670	
CONSOLIDATED EDISON INC	76,947	112.060	8,622,680.820	
CMS ENERGY CORP	61,821	78.810	4,872,113.010	
COOPER COS INC	41,316	71.020	2,934,262.320	
CORNING INC	166,369	221.050	36,775,867.450	
HEICO CORP-CL A	14,337	254.740	3,652,207.380	
CUMMINS INC	28,593	685.870	19,611,080.910	
CURTISS-WRIGHT CORP	7,986	747.270	5,967,698.220	
DR HORTON INC	54,313	166.290	9,031,708.770	
DANAHER CORP	132,128	196.190	25,922,192.320	
MOODY'S CORP	31,208	450.010	14,043,912.080	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	96,679	40.030	3,870,060.370	
TARGET CORP	94,042	140.390	13,202,556.380	
DEERE & CO	50,789	613.240	31,145,846.360	
MORGAN STANLEY	247,137	212.030	52,400,458.110	
REPUBLIC SERVICES INC	42,963	216.390	9,296,763.570	
COSTAR GROUP INC	84,266	30.250	2,549,046.500	
DECKERS OUTDOOR CORP	29,843	104.560	3,120,384.080	
THE WALT DISNEY CO	369,664	98.790	36,519,106.560	
DOLLAR TREE INC	38,951	123.870	4,824,860.370	
DOVER CORP	28,812	225.960	6,510,359.520	
OMNICOM GROUP	64,516	73.090	4,715,474.440	
DTE ENERGY CO	42,598	154.430	6,578,409.140	
DUKE ENERGY CORP	160,388	128.400	20,593,819.200	

DARDEN RESTAURANTS INC	23,659	213.720	5,056,401.480	
EBAY INC	88,439	107.870	9,539,914.930	
BANK OF AMERICA CORP	1,416,742	57.880	82,001,026.960	
CITIGROUP INC	356,399	141.760	50,523,122.240	
EATON CORP PLC	81,141	402.680	32,673,857.880	
CADENCE DESIGN SYS INC	57,120	377.270	21,549,662.400	
ECOLAB INC	53,427	283.650	15,154,568.550	
ELECTRONIC ARTS INC	46,324	205.250	9,508,001.000	
SALESFORCE INC	168,374	158.370	26,665,390.380	
ERIE INDEMNITY CO	4,706	238.710	1,123,369.260	
EMERSON ELECTRIC CO	116,342	143.490	16,693,913.580	
ATMOS ENERGY CORP	33,172	175.170	5,810,739.240	
ENTERGY CORP	94,996	115.910	11,010,986.360	
EOG RESOURCES INC	113,261	132.600	15,018,408.600	
EQUIFAX INC	26,113	158.480	4,138,388.240	
EQT CORP	122,739	52.700	6,468,345.300	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	51,478	80.540	4,146,038.120	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	28,659	160.730	4,606,361.070	
EXXON MOBIL CORP	867,201	136.540	118,407,624.540	
NEXTERA ENERGY INC	435,734	88.560	38,588,603.040	
FAIR ISAAC CORP	4,652	1,182.790	5,502,339.080	
FASTENAL CO	241,833	47.100	11,390,334.300	
FIFTH THIRD BANCORP	185,702	56.310	10,456,879.620	
M&T BANK CORP	29,858	237.260	7,084,109.080	
FISERV INC	114,716	49.450	5,672,706.200	
FORD MOTOR CO	823,528	14.130	11,636,450.640	
FREEPORT-MCMORAN INC	298,163	62.450	18,620,279.350	
FLEX LTD	75,823	146.700	11,123,234.100	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,770	2,078.930	3,679,706.100	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	52,875	226.010	11,950,278.750	
GENERAL DYNAMICS CORP	47,501	346.710	16,469,071.710	
GENERAL MILLS INC	108,036	36.010	3,890,376.360	
GENUINE PARTS CO	27,885	116.020	3,235,217.700	
GILEAD SCIENCES INC	259,984	127.880	33,246,753.920	
MCKESSON CORP	25,733	763.510	19,647,402.830	
NVIDIA CORP	4,815,572	192.530	927,142,077.160	
GRACO INC	36,793	76.420	2,811,721.060	
GE AEROSPACE	218,268	369.000	80,540,892.000	
WW GRAINGER INC	8,993	1,353.610	12,173,014.730	
HALLIBURTON CO	174,094	34.210	5,955,755.740	
MONSTER BEVERAGE CORP	149,257	96.380	14,385,389.660	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	61,622	1,019.610	62,830,407.420	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	38,546	291.250	11,226,522.500	
MILlicom INTERNATIONAL CELLULAR SA	18,620	89.260	1,662,021.200	
HEICO CORP	10,407	345.210	3,592,600.470	
HERSHEY FOODS CORP	30,749	179.110	5,507,453.390	

HP INC	182,679	22.880	4,179,695.520	
F5 INC	12,072	394.530	4,762,766.160	
UNITED THERAPEUTICS CORP	8,650	542.660	4,694,009.000	
HOME DEPOT INC	208,058	348.860	72,583,113.880	
CENTERPOINT ENERGY INC	137,066	45.040	6,173,452.640	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,572	563.870	3,705,753.640	
HUBBELL INC	11,173	517.020	5,776,664.460	
HUMANA INC	24,900	383.840	9,557,616.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,087	280.300	4,228,886.100	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	421,929	17.790	7,506,116.910	
COHERENT CORP	38,473	380.560	14,641,284.880	
BIOGEN INC	30,654	216.030	6,622,183.620	
IDEX CORP	16,502	227.190	3,749,089.380	
ILLINOIS TOOL WORKS	57,221	267.710	15,318,633.910	
INTUIT INC	57,242	267.720	15,324,828.240	
IDEXX LABORATORIES INC	16,673	551.500	9,195,159.500	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	45,948	477.890	21,958,089.720	
INTEL CORP	917,020	128.320	117,672,006.400	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	52,909	76.350	4,039,602.150	
INTERNATIONAL PAPER CO	108,812	38.760	4,217,553.120	
JABIL CIRCUIT INC	22,492	358.600	8,065,631.200	
INCYTE CORP	36,988	113.750	4,207,385.000	
EMCOR GROUP INC	9,483	798.100	7,568,382.300	
JOHNSON & JOHNSON	502,577	254.660	127,986,258.820	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	57,091	133.890	7,643,913.990	
KLA CORPORATION	271,150	248.640	67,418,736.000	
DEVON ENERGY CORP	225,955	42.210	9,537,560.550	
KEYCORP	192,791	23.260	4,484,318.660	
KIMBERLY-CLARK CORP	70,313	109.370	7,690,132.810	
KROGER CO	114,966	57.730	6,636,987.180	
LAM RESEARCH CORP	260,931	379.090	98,916,332.790	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,512	624.290	5,938,246.480	
PACKAGING CORP OF AMERICA	17,694	241.550	4,273,985.700	
LENNAR CORP	42,935	93.520	4,015,281.200	
ELI LILLY & CO	167,590	1,208.120	202,468,830.800	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	154,755	108.140	16,735,205.700	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,215	136.010	7,917,822.150	
LOCKHEED MARTIN CORP	43,478	507.400	22,060,737.200	
LOEWS CORP	35,267	113.250	3,993,987.750	
LOWE'S COS INC	115,849	222.480	25,774,085.520	
DOMINION ENERGY INC	182,410	69.390	12,657,429.900	
MCCORMICK & CO INC	50,907	51.050	2,598,802.350	

MCDONALD'S CORPORATION	148,185	269.760	39,974,385.600	
S&P GLOBAL INC	63,394	408.160	25,874,895.040	
EVEREST GROUP LTD	8,099	355.520	2,879,356.480	
MARKEL GROUP INC	2,702	1,920.060	5,188,002.120	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	119,668	90.780	10,863,461.040	
MARSH & MCLENNAN COS	101,475	169.030	17,152,319.250	
MASCO CORP	45,618	79.970	3,648,071.460	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	12,497	616.060	7,698,901.820	
METLIFE INC	116,995	85.950	10,055,720.250	
MEDTRONIC PLC	265,677	80.980	21,514,523.460	
CVS HEALTH CORP	266,404	104.340	27,796,593.360	
MERCK & CO.INC.	516,786	128.660	66,489,686.760	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	81,106	90.650	7,352,258.900	
MICROSOFT CORP	1,471,791	372.970	548,933,889.270	
MICRON TECH INC	235,331	1,132.330	266,472,351.230	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	114,202	87.930	10,041,781.860	
3M CO	110,526	164.010	18,127,369.260	
ENTEGRIS INC	32,728	161.430	5,283,281.040	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34,449	402.890	13,879,157.610	
ILLUMINA INC	30,724	176.550	5,424,322.200	
INSMED INC	43,039	103.380	4,449,371.820	
XCEL ENERGY INC	130,650	82.230	10,743,349.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19,683	168.520	3,316,979.160	
NETAPP INC	40,052	152.450	6,105,927.400	
NEWMONT CORP	224,428	96.130	21,574,263.640	
NVR INC	548	6,828.620	3,742,083.760	
NIKE INC-CL B	252,846	40.750	10,303,474.500	
NORDSON CORP	10,461	301.470	3,153,677.670	
NORFOLK SOUTHERN CORP	47,142	312.810	14,746,489.020	
EVERSOURCE ENERGY	79,691	73.480	5,855,694.680	
NISOURCE INC	105,928	49.080	5,198,946.240	
TAPESTRY INC	42,978	146.000	6,274,788.000	
NORTHERN TRUST CORP	36,485	173.870	6,343,646.950	
NORTHROP GRUMMAN CORP	27,740	500.030	13,870,832.200	
WELLS FARGO & CO	640,034	83.860	53,673,251.240	
NUCOR CORP	46,149	239.780	11,065,607.220	
CHENIERE ENERGY INC	43,236	241.640	10,447,547.040	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	124,666	204.000	25,431,864.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	149,419	49.990	7,469,455.810	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	39,038	218.790	8,541,124.020	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	176,606	89.550	15,815,067.300	
ORACLE CORP	360,500	148.530	53,545,065.000	

PACCAR INC	109,559	120.680	13,221,580.120	
PTC INC	25,446	115.720	2,944,611.120	
EXELON CORP	214,119	47.400	10,149,240.600	
PARKER HANNIFIN CORP	26,107	968.920	25,295,594.440	
PAYCHEX INC	69,211	99.900	6,914,178.900	
PPL CORPORATION	158,459	37.020	5,866,152.180	
PEPSICO INC	285,694	141.390	40,394,274.660	
PENTAIR PLC	35,336	76.420	2,700,377.120	
PFIZER INC	1,176,234	24.290	28,570,723.860	
CONOCOPHILLIPS	252,689	105.960	26,774,926.440	
PG&E CORP	445,717	17.380	7,746,561.460	
ALTRIA GROUP INC	349,369	73.790	25,779,938.510	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	83,119	244.990	20,363,323.810	
BROWN & BROWN INC	64,590	64.220	4,147,969.800	
GARMIN LTD	34,361	232.510	7,989,276.110	
PPG INDUSTRIES INC	48,069	123.240	5,924,023.560	
COSTCO WHOLESALE CORP	92,596	952.540	88,201,393.840	
T ROWE PRICE GROUP INC	46,737	110.270	5,153,688.990	
QUEST DIAGNOSTICS	22,778	209.880	4,780,646.640	
PROCTER & GAMBLE CO	485,538	149.020	72,354,872.760	
PROGRESSIVE CORP	121,236	224.340	27,198,084.240	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	104,578	83.580	8,740,629.240	
PULTE GROUP INC	38,191	137.610	5,255,463.510	
GLOBAL PAYMENTS INC	50,003	69.800	3,490,209.400	
QUALCOMM INC	222,997	189.390	42,233,401.830	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	37,191	149.940	5,576,418.540	
RELIANCE INC	10,580	385.780	4,081,552.400	
REGENERON PHARMACEUTICALS	21,556	632.900	13,642,792.400	
RESMED INC	31,500	200.290	6,309,135.000	
US BANCORP	324,391	60.910	19,758,655.810	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	74,749	97.540	7,291,017.460	
ROSS STORES INC	65,030	213.260	13,868,297.800	
ROLLINS INC	59,922	43.270	2,592,824.940	
ROPER TECHNOLOGIES INC	22,280	338.310	7,537,546.800	
ROCKWELL AUTOMATION INC	23,385	476.820	11,150,435.700	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	52,772	318.130	16,788,356.360	
RPM INTERNATIONAL INC	26,441	112.460	2,973,554.860	
ACCENTURE PLC-CL A	129,265	128.980	16,672,599.700	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	270,317	60.790	16,432,570.430	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18,910	265.430	5,019,281.300	
AXON ENTERPRISE INC	16,148	464.830	7,506,074.840	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	43,946	327.370	14,386,602.020	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	109,688	38.570	4,230,666.160	
BOOKING HOLDINGS INC	163,340	181.460	29,639,676.400	
SLB LTD	310,327	47.000	14,585,369.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	345,023	90.670	31,283,235.410	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	40,666	93.100	3,786,004.600	
ELEVANCE HEALTH INC	45,380	395.180	17,933,268.400	
CENCORA INC	38,352	286.130	10,973,657.760	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	46,819	107.750	5,044,747.250	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	48,976	344.070	16,851,172.320	
CENTENE CORP	104,991	65.730	6,901,058.430	
SNAP-ON INC	10,624	397.100	4,218,790.400	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	71,227	108.250	7,710,322.750	
EDISON INTERNATIONAL	81,655	75.670	6,178,833.850	
SOUTHERN CO	232,889	97.160	22,627,495.240	
TRUIST FINANCIAL CORP	261,788	50.490	13,217,676.120	
AT&T INC	1,464,551	22.720	33,274,598.720	
CHEVRON CORP	385,230	171.060	65,897,443.800	
STATE STREET CORP	57,489	168.110	9,664,475.790	
STARBUCKS CORP	238,343	104.600	24,930,677.800	
STEEL DYNAMICS INC	27,961	245.490	6,864,145.890	
STRYKER CORP	71,389	332.710	23,751,834.190	
NETFLIX INC	879,150	73.810	64,890,061.500	
GEN DIGITAL INC	108,241	24.450	2,646,492.450	
SYNOPSYS INC	37,643	454.340	17,102,720.620	
SYSCO CORP	100,556	82.820	8,328,047.920	
INTUITIVE SURGICAL INC	74,477	404.700	30,140,841.900	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	245,473	33.210	8,152,158.330	
TERADYNE INC	32,525	436.860	14,208,871.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	190,219	285.425	54,293,258.070	
TEXTRON INC	38,875	91.220	3,546,177.500	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	77,874	513.030	39,951,698.220	
TRACTOR SUPPLY CO	106,564	31.210	3,325,862.440	
TRIMBLE INC	48,211	50.700	2,444,297.700	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,175	294.400	2,406,720.000	
TYSON FOODS INC	56,217	58.550	3,291,505.350	
UNION PACIFIC CORP	124,018	268.350	33,280,230.300	
RTX CORP	281,276	187.990	52,877,075.240	
UNITEDHEALTH GROUP INC	189,518	427.890	81,092,857.020	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	52,711	491.340	25,899,022.740	
VULCAN MATERIALS CO	27,770	311.350	8,646,189.500	
WALMART INC	914,544	115.690	105,803,595.360	
WASTE MANAGEMENT INC	83,039	225.530	18,727,785.670	
WATERS CORP	20,901	374.410	7,825,543.410	

WATSCO INC	7,083	410.740	2,909,271.420	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	14,539	350.850	5,101,008.150	
WESTERN DIGITAL CORP	72,349	586.450	42,429,071.050	
WABTEC CORP	35,994	269.530	9,701,462.820	
NASDAQ INC	94,302	78.560	7,408,365.120	
CME GROUP INC	74,932	221.000	16,559,972.000	
WILLIAMS COS INC	252,765	77.920	19,695,448.800	
WILLIAMS-SONOMA INC	25,542	239.190	6,109,390.980	
DICK'S SPORTING GOODS INC	13,092	239.170	3,131,213.640	
ALLIANT ENERGY CORP	51,637	77.250	3,988,958.250	
WEC ENERGY GROUP INC	68,860	118.850	8,184,011.000	
STRATEGY INC-CL A	54,158	82.310	4,457,744.980	
TJX COMPANIES INC	231,778	155.430	36,025,254.540	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	241,849	7.100	1,717,127.900	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	32,128	62.760	2,016,353.280	
TPG INC-CVR	42,879	0.010	428.790	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	28,128	291.370	8,195,655.360	
CBRE GROUP INC	61,907	137.400	8,506,021.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	175,370	30.060	5,271,622.200	
DOMINO'S PIZZA INC	5,925	298.180	1,766,716.500	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9,572	1,313.320	12,571,099.040	
CRH PLC	140,824	112.320	15,817,351.680	
T-MOBILE US INC	102,826	182.680	18,784,253.680	
LAS VEGAS SANDS CORP	58,121	47.120	2,738,661.520	
DEXCOM INC	79,725	70.140	5,591,911.500	
EXPEDIA GROUP INC	24,767	262.800	6,508,767.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	105.700	3,273,423.300	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,656	452.810	8,447,623.360	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	116,878	123.860	14,476,509.080	
LIVE NATION	33,805	179.460	6,066,645.300	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	272,180	33.340	9,074,481.200	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	16,804	136.110	2,287,192.440	
TRANSDIGM GROUP INC	11,750	1,324.560	15,563,580.000	
MASTERCARD INC	170,622	499.020	85,143,790.440	
LEIDOS HOLDINGS INC	26,042	101.760	2,650,033.920	
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	148.810	5,046,444.720	
FIRST SOLAR INC	21,246	239.070	5,079,281.220	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	26,430	137.930	3,645,489.900	

SUPER MICRO COMPUTER INC	120,317	30.630	3,685,309.710	
DELTA AIR LINES INC	34,941	92.570	3,234,488.370	
INTERACTIVE BROKERS GROUP INC	91,011	89.820	8,174,608.020	
INSULET CORP	13,390	158.250	2,118,967.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	21,544	117.570	2,532,928.080	
MERCADOLIBRE INC	9,454	1,675.100	15,836,395.400	
ULTA BEAUTY INC	8,638	488.450	4,219,231.100	
MSCI INC	15,204	554.850	8,435,939.400	
ECHOSTAR CORP	27,136	97.300	2,640,332.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	325,316	180.770	58,807,373.320	
VISA INC	350,509	336.230	117,851,641.070	
KEURIG DR PEPPER INC	267,013	33.400	8,918,234.200	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	41,490	132.680	5,504,893.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,372	254.060	15,846,230.320	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	391,550	33.190	12,995,544.500	
XYLEM INC	50,406	116.450	5,869,778.700	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	55,397	55.730	3,087,274.810	
FABRINET	7,484	524.790	3,927,528.360	
HCA HEALTHCARE INC	32,021	391.680	12,541,985.280	
VERISK ANALYTICS INC	28,116	182.180	5,122,172.880	
CORPAY INC	13,937	332.480	4,633,773.760	
NXP SEMICONDUCTOR NV	52,562	277.020	14,560,725.240	
TARGA RESOURCES CORP	44,143	272.610	12,033,823.230	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	22,166	242.210	5,368,826.860	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	47,078	63.660	2,996,985.480	
DOLLAR GENERAL CORP	46,691	119.510	5,580,041.410	
FORTINET INC	131,974	151.350	19,974,264.900	
HYATT HOTELS CORP	9,487	197.680	1,875,390.160	
NEBIUS GROUP NV	41,742	240.300	10,030,602.600	
TESLA INC	587,196	379.710	222,964,193.160	
GENERAL MOTORS CO	190,561	78.100	14,882,814.100	
XPO LOGISTICS INC	23,951	201.460	4,825,168.460	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	16,613	268.750	4,464,743.750	
PHILLIPS 66	82,619	171.650	14,181,551.350	
META PLATFORMS INC	458,229	550.250	252,140,507.250	
IQVIA HOLDINGS INC	36,118	191.140	6,903,594.520	
DIAMONDBACK ENERGY INC	39,671	179.910	7,137,209.610	
SERVICENOW INC	220,948	98.340	21,728,026.320	
PALO ALTO NETWORKS INC	169,625	304.200	51,599,925.000	
WORKDAY INC	42,662	124.210	5,299,047.020	
ABBVIE INC	369,382	253.350	93,582,929.700	
ZOETIS INC	90,719	76.090	6,902,808.710	

NEWS CORP/NEW-CL A	74,879	25.410	1,902,675.390	
CDW CORP	26,509	133.300	3,533,649.700	
HOWMET AEROSPACE INC	82,891	268.870	22,286,903.170	
COMPASS GROUP PLC	357,196	32.740	11,694,597.040	
TWILIO INC	30,284	191.570	5,801,505.880	
BLOOM ENERGY CORP	55,814	252.020	14,066,244.280	
OKTA INC	33,875	124.280	4,209,985.000	
BAKER HUGHES CO	208,416	56.560	11,788,008.960	
TECHNIPFMC LTD	83,671	64.440	5,391,759.240	
CNH INDUSTRIAL NV	197,606	11.030	2,179,594.180	
BROADCOM INC	938,361	365.020	342,520,532.220	
ARES MANAGEMENT CORP	43,107	109.130	4,704,266.910	
MONGODB INC	16,697	314.010	5,243,024.970	
BURLINGTON STORES INC	12,574	320.770	4,033,361.980	
VEEVA SYSTEMS INC	32,022	171.360	5,487,289.920	
EVERGY INC	48,779	87.210	4,254,016.590	
ALLEGION PLC	18,940	139.710	2,646,107.400	
STERIS PLC	21,164	215.670	4,564,439.880	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	30,259	460.020	13,919,745.180	
KKR & CO INC	128,333	90.130	11,566,653.290	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	11,993	96.400	1,156,125.200	
ZOOM COMMUNICATIONS INC	51,232	86.480	4,430,543.360	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	46,923	332.860	15,618,789.780	
CIGNA GROUP	54,639	282.790	15,451,362.810	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	30,052	171.550	5,155,420.600	
DELL TECHNOLOGIES INC	62,449	399.490	24,947,751.010	
DOW INC	145,651	29.040	4,229,705.040	
AMCOR PLC	91,979	43.030	3,957,856.370	
FOX CORP-A	44,561	50.100	2,232,506.100	
FOX CORP-B	27,507	45.910	1,262,846.370	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	51,186	701.090	35,885,992.740	
CLOUDFLARE INC	64,526	237.240	15,308,148.240	
TRADEWEB MARKETS INC	24,737	93.520	2,313,404.240	
CARRIER GLOBAL CORP	156,129	73.590	11,489,533.110	
OTIS WORLDWIDE CORP	83,060	73.190	6,079,161.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	368,438	76.200	28,074,975.600	
CORTEVA INC	140,971	82.620	11,647,024.020	
AST SPACEMOBILE INC	49,318	71.450	3,523,771.100	
BLACKSTONE INC	153,592	115.400	17,724,516.800	
CARLYLE GROUP INC	55,171	41.400	2,284,079.400	
DATADOG INC	65,725	239.770	15,758,883.250	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	45,665	899.900	41,093,933.500	
VERTIV HOLDINGS CO	75,128	303.950	22,835,155.600	
INGERSOLL RAND INC	79,632	81.370	6,479,655.840	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	95,719	65.760	6,294,481.440	

CIRCLE INTERNET GROUP INC	30,911	73.570	2,274,122.270	
REVOLUTION MEDICINES INC	33,656	182.080	6,128,084.480	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	173,819	15.630	2,716,790.970	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDING LTD	34,968	238.000	8,322,384.000	
FTAI AVIATION LTD	20,450	260.080	5,318,636.000	
AON PLC	42,810	328.690	14,071,218.900	
SOFI TECHNOLOGIES INC	255,173	17.880	4,562,493.240	
WARNER BROS DISCOVERY INC	492,714	26.740	13,175,172.360	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	11,625	395.790	4,601,058.750	
COINBASE GLOBAL INC	43,801	149.060	6,528,977.060	
ROCKET COS INC	193,900	15.000	2,908,500.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	57,758	79.490	4,591,183.420	
AIRBNB INC	87,646	145.560	12,757,751.760	
CONSTELLATION ENERGY CORP	63,717	264.020	16,822,562.340	
IREN LTD	65,395	47.210	3,087,297.950	
ASTERA LABS INC	28,584	391.740	11,197,496.160	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	60,836	28.610	1,740,517.960	
APPROVIN CORP	47,450	477.080	22,637,446.000	
REDDIT INC	24,095	166.940	4,022,419.300	
ROYALTY PHARMA PLC	83,460	56.230	4,692,955.800	
ROBLOX CORP	123,872	47.560	5,891,352.320	
EXPAND ENERGY CORP	51,803	88.470	4,583,011.410	
BLACKROCK INC	30,807	964.710	29,719,820.970	
SNOWFLAKE INC	68,079	248.960	16,948,947.840	
DOORDASH INC	77,894	183.090	14,261,612.460	
ARISTA NETWORKS INC	223,290	157.600	35,190,504.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	88,471	118.290	10,465,234.590	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	455,106	112.930	51,395,120.580	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	52,125	46.710	2,434,758.750	
MEDLINE INC	76,732	38.870	2,982,572.840	
JACOBS SOLUTIONS INC	23,919	125.690	3,006,379.110	
MARVELL TECHNOLOGY INC	178,157	266.770	47,526,942.890	
LINDE PLC	96,776	519.620	50,286,745.120	
ROBINHOOD MARKETS INC	155,596	98.690	15,355,769.240	
IONQ INC	70,744	49.310	3,488,386.640	
TOAST INC	93,856	27.080	2,541,620.480	
GE VERNOVA INC	56,291	1,045.170	58,833,664.470	
GRAB HOLDINGS LTD	445,513	3.550	1,581,571.150	
SYNCHRONY FINANCIAL	70,641	78.660	5,556,621.060	
VERALTO CORP	47,699	89.740	4,280,508.260	
SAMSARA INC	67,082	31.140	2,088,933.480	

LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	41,459	92.170	3,821,276.030	
BUNGE GLOBAL SA	27,820	110.540	3,075,222.800	
KENVUE INC	396,743	19.130	7,589,693.590	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	90,573	70.400	6,376,339.200	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	35,245	328.660	11,583,621.700	
TE CONNECTIVITY PLC	61,795	197.740	12,219,343.300	
SMURFIT WESTROCK PLC	110,186	46.980	5,176,538.280	
SHARKNINJA INC	18,042	145.100	2,617,894.200	
FERGUSON ENTERPRISES INC	40,472	238.610	9,657,023.920	
LABCORP HOLDINGS INC	17,928	271.470	4,866,914.160	
ROCKET LAB CORP	107,596	84.540	9,096,165.840	
APTIV PLC	43,097	60.320	2,599,611.040	
COREWEAVE INC	56,394	96.580	5,446,532.520	
AMRIZE LTD	101,552	55.870	5,673,710.240	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS INC	33,602	101.040	3,395,146.080	
FEDEX FREIGHT HOLDING CO INC	22,425	153.890	3,450,983.250	
QNTITY ELECTRONICS INC	43,012	158.200	6,804,498.400	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	28,625	104.190	2,982,438.750	
SPACE EXPLORATION TECHNOLOGIES CORP	109,224	153.230	16,736,393.520	
LUMENTUM HOLDINGS INC	14,781	816.980	12,075,781.380	
TRANSUNION	39,291	70.350	2,764,121.850	
BLOCK INC	108,820	77.820	8,468,372.400	
DUPONT DE NEMOURS INC	26,798	137.220	3,677,221.560	
CARVANA CO	136,080	62.350	8,484,588.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	40,260	101.590	4,090,013.400	
NATERA INC	27,136	261.910	7,107,189.760	
KRAFT HEINZ CO	197,902	23.700	4,690,277.400	
FORTIVE CORP	61,432	61.480	3,776,839.360	
WASTE CONNECTIONS INC	54,243	167.900	9,107,399.700	
ALPHABET INC-CL A	1,214,935	337.390	409,906,919.650	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	275,822	43.710	12,056,179.620	
PAYPAL HOLDINGS INC	174,416	44.290	7,724,884.640	
SEA LTD ADR	79,292	91.330	7,241,738.360	
ALPHABET INC-CL C	964,659	334.690	322,861,720.710	
EVERPURE INC-A	65,520	69.160	4,531,363.200	
ZSCALER INC	23,062	132.260	3,050,180.120	
ATLASSIAN CORP PLC	36,837	78.740	2,900,545.380	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	17,132	133.640	2,289,520.480	
VISTRA CORP	70,177	163.490	11,473,237.730	

アメリカ・ドル 小計		76,140,499		13,038,054,544.830 (2,109,035,703,173)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	72,481	38.250	2,772,398.250	
	SEVERN TRENT PLC	59,179	29.560	1,749,331.240	
	BARCLAYS PLC	2,823,408	5.107	14,419,144.650	
	BT GROUP PLC	1,171,195	1.950	2,283,830.250	
	BUNZL PLC	61,315	26.360	1,616,263.400	
	AVIVA PLC	643,467	6.470	4,163,231.490	
	DIAGEO PLC	461,394	15.765	7,273,876.410	
	SCHRODERS PLC	168,541	5.855	986,807.550	
	NATIONAL GRID PLC	1,045,429	12.455	13,020,818.190	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.910	977,835.660	
	BAE SYSTEMS PLC	615,526	18.080	11,128,710.080	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	419,673	47.510	19,938,664.230	
	HALMA PLC	76,539	39.040	2,988,082.560	
	NEXT PLC	24,259	146.150	3,545,452.850	
	IMPERIAL BRANDS PLC	150,861	27.800	4,193,935.800	
	ANGLO AMERICAN PLC	220,325	37.180	8,191,683.500	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,583,435	14.226	50,977,946.310	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,077,905	2.869	3,092,509.440	
	CENTRICA PLC	963,585	1.751	1,687,237.330	
	UNILEVER PLC	458,995	46.005	21,116,064.970	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	143,835	13.140	1,889,991.900	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	74,161	19.785	1,467,275.380	
	PEARSON PLC	116,743	11.760	1,372,897.680	
	PRUDENTIAL PLC	531,270	10.065	5,347,232.550	
	RIO TINTO PLC	220,198	71.680	15,783,792.640	
	VODAFONE GROUP PLC	3,849,443	1.056	4,065,011.800	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	134,013	49.310	6,608,181.030	
	RELX PLC	369,379	23.630	8,728,425.770	
	RENTOKIL INITIAL PLC	492,609	4.343	2,139,400.880	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,759,419	14.062	24,740,949.970	
	NATWEST GROUP PLC	1,679,747	6.564	11,025,859.300	
	SSE PLC	258,385	24.210	6,255,500.850	
	BP PLC	3,259,442	4.694	15,299,820.740	
	THE SAGE GROUP PLC	186,583	8.176	1,525,502.600	
	SMITHS GROUP PLC	70,278	25.680	1,804,739.040	
	SPIRAX GROUP PLC	18,173	68.700	1,248,485.100	
	STANDARD CHARTERED PLC	368,111	20.360	7,494,739.960	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,302,005	1.092	13,433,789.460	
	TESCO PLC	1,344,395	4.599	6,182,872.600	
	3I GROUP PLC	196,566	25.320	4,977,051.120	
	SMITH & NEPHEW PLC	157,186	11.385	1,789,562.610	

	GSK PLC	839,075	19.830	16,638,857.250	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	93,966	80.620	7,575,538.920	
	ASTRAZENECA PLC	316,088	143.180	45,257,479.840	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	439,486	3.786	1,663,893.990	
	INTERTEK GROUP PLC	29,397	58.100	1,707,965.700	
	SAINSBURY (J) PLC	371,991	3.154	1,173,259.610	
	ADMIRAL GROUP PLC	55,777	35.240	1,965,581.480	
	EXPERIAN PLC	181,172	25.200	4,565,534.400	
	FRESNILLO PLC NPR	40,047	28.680	1,148,547.960	
	INFORMA PLC	259,912	8.978	2,333,489.930	
	GLENCORE PLC	1,951,650	5.147	10,045,142.550	
	COCA-COLA HBC AG	40,130	48.900	1,962,357.000	
	STANDARD LIFE PLC	135,828	8.365	1,136,201.220	
	AIRTEL AFRICA PLC	194,933	3.342	651,466.080	
	M&G PLC	454,395	3.356	1,524,949.620	
	ENDEAVOUR MINING PLC	46,892	38.520	1,806,279.840	
	HALEON PLC	1,841,743	3.483	6,414,790.860	
	SHELL PLC	1,171,974	28.980	33,963,806.520	
	WISE GROUP PLC	153,846	9.100	1,399,998.600	
	SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	86,319	55.580	4,797,610.020	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	253,295	4.680	1,185,420.600	
イギリス・ポンド 小計		50,923,395		468,223,079.130 (99,970,309,625)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	270,286	68.100	18,406,476.600	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	305,127	65.950	20,123,125.650	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,768	2,150.700	12,405,237.600	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	22,660	752.300	17,047,118.000	
	HAREL INSURANCE INVESTMENTS & FINANCES LTD	24,133	160.100	3,863,693.300	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	29.300	7,150,870.100	
	ICL GROUP LTD	161,905	14.900	2,412,384.500	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	50,192	163.700	8,216,430.400	
	NOVA LTD	6,546	1,535.400	10,050,728.400	
	ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD	29,169	256.800	7,490,599.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	197.300	5,809,301.200	
	AZRIELI GROUP	10,380	392.400	4,073,112.000	
	OPC ENERGY LTD	34,792	95.300	3,315,677.600	
イスラエル・シュケル 小計		1,194,459		120,364,754.550 (6,485,914,981)	
オーストラリア・ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	709,399	35.140	24,928,280.860	
	FORTESCUE LTD	330,859	19.070	6,309,481.130	
	TELSTRA GROUP LTD	824,041	5.150	4,243,811.150	

LYNAS CORP LTD	171,192	18.540	3,173,899.680	
ASX LTD	45,184	51.790	2,340,079.360	
BHP GROUP LTD	1,062,241	58.990	62,661,596.590	
COMPUTERSHARE LT	109,500	36.880	4,038,360.000	
CSL LIMITED	100,489	114.870	11,543,171.430	
REA GROUP LTD	9,317	133.540	1,244,192.180	
TRANSURBAN GROUP	659,024	15.390	10,142,379.360	
COCHLEAR LTD	12,995	118.030	1,533,799.850	
ORIGIN ENERGY LTD	375,434	10.960	4,114,756.640	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	349,444	162.020	56,616,916.880	
RIO TINTO LIMITED	76,617	173.640	13,303,775.880	
APA GROUP	278,473	10.770	2,999,154.210	
ARISTOCRAT LEISU	116,857	58.690	6,858,337.330	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444,982	8.050	3,582,105.100	
PRO MEDICUS LTD	11,011	188.880	2,079,757.680	
MACQUARIE GROUP LTD	76,331	249.360	19,033,898.160	
SUNCORP GROUP LTD	235,880	18.940	4,467,567.200	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	643,442	37.510	24,135,509.420	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,494	10.680	1,916,995.920	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	313,634	24.840	7,790,668.560	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	291,421	20.590	6,000,358.390	
SANTOS LTD	654,961	7.140	4,676,421.540	
SONIC HEALTHCARE	88,200	20.420	1,801,044.000	
WESFARMERS LTD	232,684	90.740	21,113,746.160	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	401,545	27.650	11,102,719.250	
WOOLWORTHS GROUP LTD	258,848	40.240	10,416,043.520	
BRAMBLES LTD	276,036	19.640	5,421,347.040	
PILBARA MINERALS LTD	657,319	5.040	3,312,887.760	
EVOLUTION MINING LTD	441,358	12.230	5,397,808.340	
CAR GROUP LTD	70,405	24.500	1,724,922.500	
SGH LTD	39,806	46.490	1,850,580.940	
XERO LTD	31,885	69.050	2,201,659.250	
SIGMA HEALTHCARE LTD	1,113,206	2.770	3,083,580.620	
LOTTERY CORP LTD	486,416	5.630	2,738,522.080	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	627,081	35.040	21,972,918.240	
MEDIBANK PVT LTD	629,748	4.970	3,129,847.560	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	76,399	45.430	3,470,806.570	
SOUTH32 LTD(AUD)	867,426	3.910	3,391,635.660	
COLES GROUP LTD	264,538	24.410	6,457,372.580	
WISETECH GLOBAL LTD	38,698	31.550	1,220,921.900	
オーストラリア・ドル 小計	14,683,820		399,543,638.470 (44,493,179,580)	

カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	104,626	223.070	23,338,921.820	
	BARRICK MINING CORP	345,227	52.900	18,262,508.300	
	BANK OF MONTREAL	142,910	248.660	35,536,000.600	
	BANK OF NOVA SCOTIA	255,687	122.440	31,306,316.280	
	NATIONAL BANK OF CANADA	80,178	222.030	17,801,921.340	
	BCE INC	68,397	32.530	2,224,954.410	
	BROOKFIELD CORP	416,157	60.860	25,327,315.020	
	BOMBARDIER INC 'B'	17,199	325.420	5,596,898.580	
	SAPUTO INC	56,192	42.440	2,384,788.480	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17,626	99.830	1,759,603.580	
	CGI INC	38,154	91.290	3,483,078.660	
	CCL INDUSTRIES INC	27,743	92.540	2,567,337.220	
	CAE INC	55,407	36.170	2,004,071.190	
	CAMECO CORP	90,352	147.970	13,369,385.440	
	ROGERS COMM-CL B	74,725	49.530	3,701,129.250	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	189,614	161.250	30,575,257.500	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	434,754	56.020	24,354,919.080	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	194.990	1,737,555.890	
	CANADIAN UTILITIES LTD	31,617	53.320	1,685,818.440	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	106,683	171.000	18,242,793.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,184	74.890	2,784,709.760	
	CELESTICA INC	24,243	478.580	11,602,214.940	
	EMPIRE CO LTD	20,608	51.250	1,056,160.000	
	KINROSS GOLD CORP	252,455	34.380	8,679,402.900	
	RB GLOBAL INC	39,198	163.620	6,413,576.760	
	FORTIS INC	105,011	82.570	8,670,758.270	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	149,612	37.300	5,580,527.600	
	TELUS CORP	31,890	15.720	501,310.800	
	GREAT WEST LIFECO INC	50,854	88.410	4,496,002.140	
	IMPERIAL OIL LTD	32,165	160.880	5,174,705.200	
	ENBRIDGE INC	458,286	79.790	36,566,639.940	
	IGM FINANCIAL INC	12,478	76.700	957,062.600	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	347,046	57.190	19,847,560.740	
	LOBLAW CO LTD	120,170	65.930	7,922,808.100	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	142,970	93.430	13,357,687.100	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	54,200	91.490	4,958,758.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	113,356	110.540	12,530,372.240	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,943	2,347.020	9,254,299.860	
	METRO INC	40,887	92.980	3,801,673.260	
	EMERA INC	64,335	76.230	4,904,257.050	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	87,130	64.470	5,617,271.100	
	POWER CORP OF CANADA	108,654	86.470	9,395,311.380	
	ROYAL BANK OF CANADA	291,515	288.010	83,959,235.150	

ATKINSREALIS GROUP INC	32,972	90.460	2,982,647.120	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	184,943	124.430	23,012,457.490	
STANTEC INC	22,549	98.230	2,214,988.270	
SUNCOR ENERGY INC	250,486	76.430	19,144,644.980	
LUNDIN MINING CORP	138,909	33.730	4,685,400.570	
TECK RESOURCES LTD-CL B	96,471	82.660	7,974,292.860	
THOMSON REUTERS CORP	29,819	119.040	3,549,653.760	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,754	231.390	4,108,098.060	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	345,709	170.030	58,780,901.270	
TC ENERGY CORP	219,961	98.830	21,738,745.630	
WESTON (GEORGE) LTD	36,807	104.460	3,844,859.220	
INTACT FINANCIAL CORP	37,881	292.000	11,061,252.000	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	96,451	160.710	15,500,640.210	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,293	2,818.020	12,097,759.860	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	39,792	305.320	12,149,293.440	
TOURMALINE OIL CORP	72,309	60.160	4,350,109.440	
KEYERA CORP	54,385	58.440	3,178,259.400	
WHITECAP RESOURCES INC	278,574	14.970	4,170,252.780	
ALTAGAS LTD	59,998	54.310	3,258,491.380	
PEMBINA PIPELINE CORP	119,897	66.940	8,025,905.180	
DOLLARAMA INC	56,558	193.930	10,968,292.940	
CENOVUS ENERGY INC W/I	285,254	35.170	10,032,383.180	
ARC RESOURCES LTD	112,620	29.640	3,338,056.800	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	73,200	29.570	2,164,524.000	
TMX GROUP LTD	61,220	45.500	2,785,510.000	
IVANHOE MINES LTD	179,721	10.660	1,915,825.860	
NUTRIEN LTD	102,891	86.550	8,905,216.050	
TFI INTERNATIONAL INC	17,141	204.900	3,512,190.900	
WSP GLOBAL INC	28,163	178.210	5,018,928.230	
IA FINANCIAL CORP INC	19,845	194.990	3,869,576.550	
GFL ENVIRONMENTAL INC	48,982	52.980	2,595,066.360	
EQUINOX GOLD CORP	162,179	13.810	2,239,691.990	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	68,283	63.210	4,316,168.430	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	53.440	1,546,660.480	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	69,235	105.410	7,298,061.350	
LUNDIN GOLD INC	22,677	77.050	1,747,262.850	
SHOPIFY INC	256,861	165.700	42,561,867.700	
FIRSTSERVICE CORP	7,857	199.770	1,569,592.890	
HYDRO ONE LTD	68,595	59.230	4,062,881.850	
ALAMOS GOLD INC	88,473	44.350	3,923,777.550	
カナダ・ドル 小計	9,049,006		883,493,067.850	

				(100,682,870,012)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	10.410	3,016,818.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	6.460	1,047,812.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	425,081	65.430	27,813,049.830	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	178,500	24.150	4,310,775.000	
	KEPPEL LTD	310,000	11.060	3,428,600.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	689,298	24.860	17,135,948.280	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,553,230	4.430	6,880,808.900	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	345,800	7.650	2,645,370.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	253,966	39.800	10,107,846.800	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	381,600	3.660	1,396,656.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	508,500	3.500	1,779,750.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.520	1,021,330.800	
シンガポール・ドル 小計		5,503,265		80,584,765.610 (10,071,484,006)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	30,835	78.780	2,429,181.300	
	NESTLE SA-REGISTERED	538,228	83.290	44,829,010.120	
	CIE FINANC RICHEMONT	111,046	186.800	20,743,392.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,599	267.800	2,035,012.200	
	SIKA INHABER	32,650	167.600	5,472,140.000	
	SGS SA-REG	32,234	93.540	3,015,168.360	
	NOVARTIS AG-REG SHS	383,167	126.280	48,386,328.760	
	BARRY CALLEBAUT AG	717	1,149.000	823,833.000	
	SWISSCOM AG-REG	5,126	638.500	3,272,951.000	
	ABB LTD	327,277	84.520	27,661,452.040	
	GEBERIT AG	6,586	544.200	3,584,101.200	
	LONZA GROUP AG-REG	14,580	534.600	7,794,468.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	217	9,510.000	2,063,670.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	97,100.000	1,942,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,936	3,393.000	6,568,848.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	30,974	589.000	18,243,686.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	7,648	342.000	2,615,616.000	
	HOLCIM LTD	105,046	75.080	7,886,853.680	
	SONOVA HOLDING AG	10,293	194.400	2,000,959.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	10,478	193.700	2,029,588.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	22,266	106.350	2,367,989.100	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6,261	202.600	1,268,478.600	
	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	16,170	209.000	3,379,530.000	
	SCHINDLER NAMEN	5,064	257.500	1,303,980.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,861	888.000	5,204,568.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	119.300	584,927.900	

	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	699.000	870,255.000	
	SWISS PRIME SITE AG	15,640	133.700	2,091,068.000	
	AVOLTA AG	21,652	53.750	1,163,795.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,868	651.800	3,172,962.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	44,986	68.160	3,066,245.760	
	SWISS RE LTD	63,364	127.800	8,097,919.200	
	BKW AG	3,194	137.600	439,494.400	
	ALCON INC	109,033	55.200	6,018,621.600	
	SANDOZ GROUP AG	85,536	71.880	6,148,327.680	
	BELIMO HOLDING AG	1,988	904.000	1,797,152.000	
	GALDERMA GROUP AG	38,378	178.250	6,840,878.500	
	UBS GROUP AG	663,723	39.970	26,529,008.310	
	ROCHE HOLDING AG	145,403	336.000	48,855,408.000	
	VAT GROUP AG	5,632	669.800	3,772,313.600	
スイス・フラン	小計	2,921,824		346,371,183.310 (69,170,325,307)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	528,528	189.450	100,129,629.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	289,975	167.000	48,425,825.000	
	ERICSSON LM-B SHS	553,049	106.650	58,982,675.850	
	LUNDBERGS B	14,872	550.000	8,179,600.000	
	SKF AB-B SHS	66,600	246.300	16,403,580.000	
	SANDVIK AB	220,531	385.700	85,058,806.700	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	300,082	190.950	57,300,657.900	
	SKANSKA AB-B SHS	62,329	258.800	16,130,745.200	
	SWEDBANK AB	172,346	358.900	61,854,979.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	138,616	99.740	13,825,559.840	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	288,078	141.600	40,791,844.800	
	TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	413.600	15,366,894.400	
	VOLVO AB-B SHS	327,975	324.600	106,460,685.000	
	TELE2 AB-B SHS	126,566	176.350	22,319,914.100	
	INDUSTRIVARDEN A	24,631	527.000	12,980,537.000	
	INDUSTRIVARDEN C	31,300	515.000	16,119,500.000	
	SAAB AB-B	63,945	487.400	31,166,793.000	
	SECURITAS AB-B SHS	99,643	156.400	15,584,165.200	
	INVESTOR AB-B SHS	359,667	394.350	141,834,681.450	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	166.050	17,380,287.450	
	ASSA ABLOY AB-B	208,377	340.900	71,035,719.300	
	TELIA CO AB	468,019	48.670	22,778,484.730	
	BOLIDEN AB	65,558	537.000	35,204,646.000	
	ALFA LAVAL AB	58,487	559.200	32,705,930.400	
	FASTIGHETS AB BALDER	117,966	51.040	6,020,984.640	
	INDUTRADE AB	58,393	198.000	11,561,814.000	
	NIBE INDUSTRIER AB	292,985	36.320	10,641,215.200	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	466.200	16,960,822.200	
	HEXAGON AB-B SHS	449,215	80.980	36,377,430.700	
	SAGAX AB	44,607	150.600	6,717,814.200	
	EPIROC AB-A	125,482	255.900	32,110,843.800	
	EPIROC AB-B	80,804	217.400	17,566,789.600	
	ESSITY AB-B	115,540	278.300	32,154,782.000	
	EQT AB	97,156	266.800	25,921,220.800	
	ADDTECH AB	47,848	332.600	15,914,244.800	
	OCTAVE INTELLIGENCE PLC	40,410	154.800	6,255,468.000	
	BEIJER REF AB	71,081	139.900	9,944,231.900	
	LIFCO AB	49,888	316.200	15,774,585.600	
	EVOLUTION AB	26,852	658.200	17,673,986.400	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	191.050	5,280,239.900	
スウェーデン・クローナ 小計		6,293,243		1,314,898,616.060 (21,840,466,013)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	18,112	870.000	15,757,440.000	
	A P MOLLER A/S	851	15,940.000	13,564,940.000	
	AP MOLLER MAERSK A	296	15,480.000	4,582,080.000	
	DANSKE BANK A/S	126,706	344.700	43,675,558.200	
	GENMAB A/S	12,165	1,702.000	20,704,830.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	75,035	407.200	30,554,252.000	
	ROCKWOOL AS	16,770	213.800	3,585,426.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	674,469	317.950	214,447,418.550	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	195,996	172.500	33,809,310.000	
	COLOPLAST-B	25,816	381.900	9,859,130.400	
	DSV A/S	40,848	1,553.500	63,457,368.000	
	DEMANT A/S	17,700	266.000	4,708,200.000	
	TRYG A/S	79,447	150.000	11,917,050.000	
	PANDORA A/S	14,742	743.200	10,956,254.400	
	ORSTED A/S	106,744	144.700	15,445,856.800	
デンマーク・クローネ 小計		1,405,697		497,025,114.350 (12,246,698,818)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	384,915	8.420	3,240,984.300	
	CONTACT ENERGY L	183,385	9.240	1,694,477.400	
	FISHER & PAYKEL	116,144	38.450	4,465,736.800	
	INFRATIL LTD	218,942	15.200	3,327,918.400	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.750	1,376,021.000	
ニュージーランド・ドル 小計		1,142,694		14,105,137.900 (1,285,542,268)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	102,370	192.000	19,655,040.000	
	NORSK HYDRO ASA	280,113	88.960	24,918,852.480	
	TELENOR ASA	119,422	145.000	17,316,190.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	89,335	278.400	24,870,864.000	
	ORKLA ASA	156,830	105.300	16,514,199.000	
	EQUINOR ASA	141,794	309.100	43,828,525.400	

	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	437.200	12,859,800.800	
	AKER BP ASA	72,231	303.100	21,893,216.100	
	SALMAR ASA	12,897	517.500	6,674,197.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	41,223	266.600	10,990,051.800	
	DNB BANK ASA	173,149	293.300	50,784,601.700	
	VAR ENERGI ASA	184,231	40.670	7,492,674.770	
ノルウェー・クロネ 小計		1,403,009		257,798,213.550 (4,191,798,952)	
ユーロ	RYANAIR HOLDINGS	88,153	27.180	2,395,998.540	
	KERRY GROUP PLC-A	31,648	81.250	2,571,400.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	29,826	81.550	2,432,310.300	
	AIR LIQUIDE	131,640	172.860	22,755,290.400	
	AIRBUS SE	124,468	191.900	23,885,409.200	
	AXA SA	324,162	43.410	14,071,872.420	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	124,161	36.230	4,498,353.030	
	ADIDAS AG	35,785	181.700	6,502,134.500	
	GENERALI	167,223	42.490	7,105,305.270	
	DASSAULT AVIATION SA	4,132	287.800	1,189,189.600	
	DANONE	132,926	72.120	9,586,623.120	
	SAFRAN SA	72,398	332.700	24,086,814.600	
	INTESA SANPAOLO	2,927,862	5.952	17,426,634.620	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53,290	59.060	3,147,307.400	
	ACCOR SA	38,165	50.180	1,915,119.700	
	BOUYGUES	46,470	49.750	2,311,882.500	
	BPER BANCA SPA	330,915	13.464	4,455,439.560	
	BNP PARIBAS	207,979	101.120	21,030,836.480	
	THALES SA	20,059	216.500	4,342,773.500	
	CAPGEMINI SA	30,992	89.680	2,779,362.560	
	LOTUS BAKERIES NV	77	11,520.000	887,040.000	
	UNICREDIT SPA	282,635	77.090	21,788,332.150	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	15,271	282.700	4,317,111.700	
	D'IETEREN TRDG	4,146	170.500	706,893.000	
	COMMERZBANK AG	134,133	37.830	5,074,251.390	
	EIFFAGE	15,947	130.200	2,076,299.400	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	84,108	39.820	3,349,180.560	
	PUBLICIS GROUPE	48,685	86.620	4,217,094.700	
	IBERDROLA SA	1,274,623	21.690	27,646,572.870	
	ENI SPA	377,838	20.215	7,637,995.170	
	INDRA SISTEMAS SA	15,276	46.920	716,749.920	
	JERONIMO MARTINS	45,606	17.240	786,247.440	
	KESKO OYJ-B	56,685	19.860	1,125,764.100	
	KBC GROUPE	47,056	117.250	5,517,316.000	
	HANNOVER RUECK SE	11,943	238.400	2,847,211.200	
	WARTSILA OYJ	101,897	31.980	3,258,666.060	
	L'OREAL	49,413	388.000	19,172,244.000	

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	52,023	495.750	25,790,402.250	
GEA GROUP AG	31,889	59.550	1,898,989.950	
BOLLORE	114,808	4.100	470,712.800	
MICHELIN(CGDE) -B	136,013	33.810	4,598,599.530	
CONTINENTAL AG	21,977	72.520	1,593,772.040	
DEUTSCHE POST AG-REG	188,184	52.360	9,853,314.240	
OMV AG	31,189	54.100	1,687,324.900	
VERBUND AG	16,118	55.900	900,996.200	
PERNOD-RICARD	42,072	65.960	2,775,069.120	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	33,246	27.830	925,236.180	
RENAULT SA	34,278	26.070	893,627.460	
REPSOL SA	228,703	21.240	4,857,651.720	
MERCK KGAA	25,862	145.650	3,766,800.300	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	93,273	80.600	7,517,803.800	
RWE AG	118,579	54.060	6,410,380.740	
SOCIETE GENERALE-A	131,179	76.780	10,071,923.620	
VINCI S.A.	96,469	130.100	12,550,616.900	
SODEXO	17,430	51.250	893,287.500	
SOFINA	3,443	220.200	758,148.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	114,637	276.050	31,645,543.850	
SAP SE	219,552	135.140	29,670,257.280	
TELEFONICA S.A	760,673	3.651	2,777,217.120	
TOTALENERGIES SE	412,031	68.360	28,166,439.160	
E.ON SE	476,410	18.020	8,584,908.200	
HENKEL AG & CO KGAA	25,036	69.700	1,745,009.200	
SIEMENS AG-REG	155,312	267.500	41,545,960.000	
UPM-KYMMENE OYJ	103,401	23.280	2,407,175.280	
ING GROEP NV-CVA	614,900	27.205	16,728,354.500	
BAYER AG	202,870	47.000	9,534,890.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	136,215	9.248	1,259,716.320	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,704	73.800	2,192,155.200	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	150,471	43.335	6,520,660.780	
BASF SE	184,768	47.760	8,824,519.680	
BEIERSDORF AG	18,636	75.520	1,407,390.720	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	77,021	24.100	1,856,206.100	
HOCHTIEF AG	3,095	497.800	1,540,691.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	28,177	184.400	5,195,838.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	42,494	40.860	1,736,304.840	
ASM INTERNATIONAL NV	9,599	948.000	9,099,852.000	
ORANGE	389,060	16.980	6,606,238.800	
SAMPO OYJ-A SHS	484,110	9.110	4,410,242.100	
ALLIANZ SE	79,532	407.900	32,441,102.800	
EDP SA	624,219	4.462	2,785,265.170	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	182,188	35.430	6,454,920.840	
HERMES INTL	5,368	1,626.000	8,728,368.000	
ENDESA S.A.	63,990	39.620	2,535,283.800	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	9.796	1,064,306.010	
ERSTE GROUP BANK AG	63,085	115.700	7,298,934.500	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	26,927	477.700	12,863,027.900	
ARCELOR MITTAL (NL)	88,596	52.520	4,653,061.920	
DASSAULT SYSTEMES SA	134,189	17.930	2,406,008.770	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35,984	127.900	4,602,353.600	
RHEINMETALL STAMM	9,643	946.600	9,128,063.800	
HEINEKEN NV	57,687	74.000	4,268,838.000	
AKZO NOBEL	34,435	60.340	2,077,807.900	
ASML HOLDING NV	81,060	1,578.200	127,928,892.000	
AEGON LTD	232,433	7.446	1,730,696.110	
BANKINTER S.A.	139,390	14.600	2,035,094.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	44,646	74.280	3,316,304.880	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,181,006	21.470	25,356,198.820	
KERING	14,490	267.050	3,869,554.500	
ACCIONA S.A.	5,005	269.400	1,348,347.000	
FORTUM OYJ	95,817	19.570	1,875,138.690	
AGEAS	31,169	69.750	2,174,037.750	
UCB SA	25,044	258.500	6,473,874.000	
NEMETSCHEK SE	10,222	52.450	536,143.900	
CARREFOUR SA	125,695	16.385	2,059,512.570	
NATURGY ENERGY GROUP SA	84,865	27.920	2,369,430.800	
NOKIA OYJ	1,058,501	11.390	12,056,326.390	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	158,010	23.890	3,774,858.900	
WOLTERS KLUWER-CVA	47,174	57.000	2,688,918.000	
SANOFI	226,323	75.070	16,990,067.610	
STMICROELECTRONICS NV	131,433	62.580	8,225,077.140	
ELISA OYJ	34,206	37.320	1,276,567.920	
BANCO SANTANDER SA	2,981,707	11.830	35,273,593.810	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	85,537	15.420	1,318,980.540	
QIAGEN N.V.	41,781	34.315	1,433,715.010	
DEUTSCHE BANK AG-REG	384,233	29.630	11,384,823.790	
BMW VORZUG	12,776	58.850	751,867.600	
BUZZI UNICEM	14,138	45.690	645,965.220	
ENEL SPA	1,599,428	10.098	16,151,023.940	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,704,453	1.017	1,733,428.700	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	721,944	26.250	18,951,030.000	
SARTORIUS AG	4,533	224.000	1,015,392.000	
LEONARDO SPA	82,251	46.255	3,804,520.000	
CTS EVENTIM AG	11,578	49.560	573,805.680	

INFINEON TECHNOLOGIES AG	270,188	78.300	21,155,720.400	
RATIONAL AG	860	646.500	555,990.000	
KONINKLIJKE KPN NV	794,750	4.466	3,549,353.500	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	68.960	1,588,700.480	
DEUTSCHE BOERSE AG	37,265	238.300	8,880,249.500	
BANCO SABADELL	1,070,505	3.084	3,301,437.420	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15,900	78.950	1,255,305.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	25,531	67.150	1,714,406.650	
INDITEX	228,635	56.000	12,803,560.000	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	413,654	10.816	4,474,081.660	
MAPFRE SA	164,994	4.312	711,454.120	
ESSILORLUXOTTICA	63,640	168.650	10,732,886.000	
SNAM SPA	390,173	6.288	2,453,407.820	
CREDIT AGRICOLE SA	183,415	17.520	3,213,430.800	
TENARIS SA	76,002	24.670	1,874,969.340	
TELECOM ITALIA SPA	342,839	8.039	2,756,082.720	
TERNA SPA	302,512	10.265	3,105,285.680	
BIOMERIEUX	6,736	71.250	479,940.000	
NESTE OYJ	84,986	27.180	2,309,919.480	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	26,147	55.150	1,442,007.050	
RECORDATI SPA	23,751	51.500	1,223,176.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	103,040	5.462	562,804.480	
MTU AERO ENGINES AG	10,833	358.400	3,882,547.200	
KONE OYJ	67,111	49.960	3,352,865.560	
ELIA GROUP	10,817	138.500	1,498,154.500	
FINANCIERE DE TUBIZE SA	3,656	225.400	824,062.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	6,975	175.200	1,222,020.000	
ENGIE	376,351	27.310	10,278,145.810	
ALSTOM	68,028	15.380	1,046,270.640	
IPSEN SA	8,274	162.400	1,343,697.600	
LEGRAND SA	54,032	144.950	7,831,938.400	
ADP	6,104	115.700	706,232.800	
ORION OYJ	21,796	70.000	1,525,720.000	
METSO CORPORATION	133,678	14.460	1,932,983.880	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	18.360	1,461,180.600	
SYMRISE AG	26,736	88.160	2,357,045.760	
REXEL SA	41,104	36.860	1,515,093.440	
PRYSMIAN SPA	58,055	142.850	8,293,156.750	
CAIXABANK	740,939	12.310	9,120,959.090	
BUREAU VERITAS SA	72,096	26.120	1,883,147.520	
GETLINK	72,777	18.710	1,361,657.670	
EDP RENEWABLES SA	67,001	13.560	908,533.560	
AMADEUS IT GROUP SA	93,451	52.140	4,872,535.140	
BRENNTAG SE	28,127	54.180	1,523,920.860	

INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	253,234	5.592	1,416,084.520	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	16.000	685,376.000	
TALANX AG	13,274	108.400	1,438,901.600	
VONOVIA SE	164,754	21.560	3,552,096.240	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	192,866	17.675	3,408,906.550	
KNORR-BREMSE AG	14,544	99.600	1,448,582.400	
ITALGAS SPA	122,960	10.465	1,286,776.400	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65,799	34.220	2,251,641.780	
FERRARI NV	24,750	322.150	7,973,212.500	
ASR NEDERLAND NV	34,744	66.160	2,298,663.040	
AYVENS SA	65,316	11.460	748,521.360	
AIB GROUP PLC	449,244	10.455	4,696,846.020	
NORDEA BANK ABP	626,610	16.305	10,216,876.050	
MONCLER SPA	43,309	51.320	2,222,617.880	
PROSUS NV	268,508	37.475	10,062,337.300	
DR ING HC F PORSCHE AG	27,385	43.220	1,183,579.700	
EXOR NV	16,552	66.950	1,108,156.400	
SIEMENS ENERGY AG	162,311	153.920	24,982,909.120	
HENSOLDT AG	13,720	64.900	890,428.000	
INPOST SA	60,024	15.410	924,969.840	
EURONEXT NV	16,722	140.400	2,347,768.800	
NN GROUP NV	58,369	76.320	4,454,722.080	
FINECOBANK SPA	124,605	21.730	2,707,666.650	
ARGENX SE	12,682	784.400	9,947,760.800	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	207,674	18.355	3,811,856.270	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	91,652	41.210	3,776,978.920	
DSM-FIRMENICH AG	36,128	79.980	2,889,517.440	
SYENQO SA	15,096	66.800	1,008,412.800	
ZALANDO SE	42,234	24.920	1,052,471.280	
STELLANTIS NV	404,098	5.022	2,029,380.150	
FERROVIAL NV	98,621	60.740	5,990,239.540	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	39,582	12.560	497,149.920	
MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	91,000	15.326	1,394,666.000	
CSG NV	39,041	12.682	495,117.960	
VERISURE PLC	50,000	9.722	486,100.000	
AENA SME SA	149,081	27.300	4,069,911.300	
CELLNEX TELECOM SAU	95,346	28.030	2,672,548.380	
BANCO BPM SPA	232,070	15.040	3,490,332.800	
ABN AMRO BANK NV	126,896	36.310	4,607,593.760	
SCOUT24 SE	15,592	72.450	1,129,640.400	
BANCA MEDIOLANUM SPA	55,270	21.600	1,193,832.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	184,485	74.680	13,777,339.800	
POSTE ITALIANE SPA	98,274	28.460	2,796,878.040	
AMUNDI SA	11,288	83.400	941,419.200	

	ABIVAX SA	11,120	84.500	939,640.000	
	BAWAG GROUP AG	15,890	171.300	2,721,957.000	
	ADYEN NV	5,508	824.900	4,543,549.200	
	DELIVERY HERO SE	34,547	35.810	1,237,128.070	
ユーロ 小計		38,149,536		1,360,410,885.060 (250,587,685,028)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	331,796	73.750	24,469,955.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	127,814	60.250	7,700,793.500	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	249,091	362.200	90,220,760.200	
	MTR CORP	356,941	30.940	11,043,754.540	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	25.160	7,496,975.520	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	257,320	57.550	14,808,766.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,376,406	6.660	15,826,863.960	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	431,904	29.200	12,611,596.800	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	753,495	45.560	34,329,232.200	
	SINO LAND CO	659,200	10.340	6,816,128.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	280,565	114.200	32,040,523.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	82.950	4,398,009.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	309,156	127.200	39,324,643.200	
	AIA GROUP LTD	2,186,316	70.800	154,791,172.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	11.700	9,326,491.200	
	SANDS CHINA LTD	588,200	12.900	7,587,780.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	276,000	31.760	8,765,760.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	351,135	21.860	7,675,811.100	
	WH GROUP LTD	1,550,000	8.500	13,175,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	536,445	67.250	36,075,926.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	379,695	44.080	16,736,955.600	
香港・ドル 小計		13,149,607		555,222,897.870 (11,448,696,154)	
合計		221,960,054		2,741,510,673,917 (2,741,510,673,917)	

(2) 株式以外の有価証券

2026年6月29日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証 券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計		2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券 合計			2,968	0 (0)	

投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	408,319.000	13,070,291.190	
		SCENTRE GROUP	1,177,078.000	4,614,145.760	
		STOCKLAND	480,103.000	2,074,044.960	
		VICINITY CENTRES	815,965.000	2,154,147.600	
	オーストラリア・ドル 小計		2,881,465.000	21,912,629.510 (2,440,190,422)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	867,778.000	2,204,156.120	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,214,726.000	2,915,342.400	
	シンガポール・ドル 小計		2,082,504.000	5,119,498.520 (639,834,925)	
投資信託受益証券 合計			4,963,969	3,080,025,347 (3,080,025,347)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN TOWER CORP	96,877.000	17,010,632.430	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	133,913.000	3,073,303.350	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,084.000	5,339,330.080	
		CROWN CASTLE INC	88,932.000	7,347,561.840	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	71,051.000	13,712,843.000	
		EQUINIX INC	20,410.000	22,273,433.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	71,367.000	4,880,075.460	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,115.000	3,873,384.100	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	45,042.000	6,720,716.820	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	57,433.000	2,635,026.040	
		INVITATION HOMES INC	129,667.000	3,949,656.820	
		IRON MOUNTAIN INC	62,808.000	8,318,291.520	
		KIMCO REALTY	136,267.000	3,527,952.630	
		MID AMERICA	23,159.000	3,258,934.480	
		PROLOGIS INC	192,985.000	27,012,110.450	
		PUBLIC STORAGE	33,500.000	10,867,065.000	
		REALTY INCOME CORP	195,908.000	12,365,712.960	
		REGENCY CENTERS CORP	33,164.000	2,713,146.840	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	22,004.000	4,043,455.040	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	68,177.000	15,468,679.530	
		SUN COMMUNITIES INC	25,617.000	3,106,061.250	
		VENTAS INC	101,588.000	9,046,411.400	
		VICI PROPERTIES INC	222,086.000	6,042,960.060	
		WELLTOWER INC	147,493.000	33,529,583.690	
		WEYERHAEUSER CO	143,943.000	3,643,197.330	
		WP CAREY INC	44,884.000	3,315,132.240	
	アメリカ・ドル 小計		2,209,474.000	237,074,657.360 (38,349,196,573)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	176,057.000	1,156,694.490	
		SEGRO PLC	250,449.000	2,204,452.090	
	イギリス・ポンド 小計		426,506.000	3,361,146.580	

				(717,638,406)	
ユーロ	COVIVIO		8,731.000	481,514.650	
	GECINA SA		8,697.000	644,012.850	
	KLEPIERRE		48,371.000	1,798,433.780	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD		22,812.000	2,357,620.200	
ユーロ 小計			88,611.000	5,281,581.480 (972,867,309)	
香港・ドル	LINK REIT		499,016.000	18,134,241.440	
香港・ドル 小計			499,016.000	18,134,241.440 (373,928,058)	
投資証券 合計			3,223,607	40,413,630,346 (40,413,630,346)	
合計				43,493,655,693 (43,493,655,693)	

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

（注）

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

通貨	銘柄数	組入株 式 時価比 率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 515銘柄	74.84	—	—	—	77.11
	投資証券 26銘柄	—	—	—	1.36	
イギリス・ポンド	株式 62銘柄	3.55	—	—	—	3.62
	投資証券 2銘柄	—	—	—	0.03	
イスラエル・シェケル	株式 13銘柄	0.23	—	—	—	0.23
オーストラリア・ドル	株式 43銘柄	1.58	—	—	—	1.69
	投資信託受益証 券 4銘柄	—	—	0.09	—	
カナダ・ドル	株式 83銘柄	3.57	—	—	—	3.62
	新株予約権証券 1銘柄	—	0.00	—	—	
シンガポール・ドル	株式 12銘柄	0.36	—	—	—	0.38
	投資信託受益証 券 2銘柄	—	—	0.02	—	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.45	—	—	—	2.48
スウェーデン・クローナ	株式 40銘柄	0.78	—	—	—	0.78
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.43	—	—	—	0.44
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.05	—	—	—	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.15	—	—	—	0.15
ユーロ	株式 215銘柄	8.89	—	—	—	9.03
	投資証券 4銘柄	—	—	—	0.03	

香港・ドル	株式	21銘柄	0.41	—	—	—	0.42
	投資証券	1銘柄	—	—	—	0.01	

（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。

NASDAQ100インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	15,277,073
コール・ローン	29,323,260
株式	1,307,080,499
投資信託受益証券	68,000,571
派生商品評価勘定	570
未収配当金	501,844
流動資産合計	1,420,183,817
資産合計	1,420,183,817
負債の部	
流動負債	
未払金	30,050,450
未払解約金	27,300,000
流動負債合計	57,350,450
負債合計	57,350,450
純資産の部	
元本等	
元本	696,539,837
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	666,293,530
元本等合計	1,362,833,367
純資産合計	1,362,833,367
負債純資産合計	1,420,183,817

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年6月29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	382,536,114円
同期中追加設定元本額	604,476,854円
同期中一部解約元本額	290,473,131円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード NASDAQ100	635,419,896円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	2,508円
One NASDAQ100&ゴールド	61,117,433円
計	696,539,837円
2. 受益権の総数	696,539,837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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	94,156,187
投資信託受益証券	△593,556
合計	93,562,631

（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（2025年10月15日から2026年6月29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	2026年6月29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 アメリカ・ドル	15,122,746	—	15,123,316	570
	15,122,746	—	15,123,316	570
合計	15,122,746	—	15,123,316	570

(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)

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9566円 (19,566円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2026年6月29日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,418	232.690	329,954.420	
	ADVANCED MICRO DEVICES	593	521.580	309,296.940	
	ADOBE INC	147	202.730	29,801.310	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	233	232.210	54,104.930	
	AMGEN INC	196	358.330	70,232.680	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	200	138.690	27,738.000	
	ANALOG DEVICES	177	386.910	68,483.070	
	APPLE INC	1,936	283.780	549,398.080	
	APPLIED MATERIALS INC	289	626.840	181,156.760	
	AUTODESK INC	76	196.260	14,915.760	

AUTOMATIC DATA PROCESSING	145	223.550	32,414.750	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	67	238.530	15,981.510	
THOMSON REUTERS CORP	140	83.870	11,741.800	
CSX CORP	682	47.660	32,504.120	
CINTAS CORP	147	171.900	25,269.300	
CISCO SYSTEMS INC	1,435	113.770	163,259.950	
COPART INC	348	30.550	10,631.400	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	97	377.310	36,599.070	
COMCAST CORP-CL A	1,308	23.170	30,306.360	
ASML HOLDING NV-NY REG SHS	33	1,794.620	59,222.460	
CADENCE DESIGN SYS INC	100	377.270	37,727.000	
ELECTRONIC ARTS INC	92	205.250	18,883.000	
FASTENAL CO	422	47.100	19,876.200	
GILEAD SCIENCES INC	452	127.880	57,801.760	
NVIDIA CORP	3,190	192.530	614,170.700	
MONSTER BEVERAGE CORP	359	96.380	34,600.420	
INTUIT INC	100	267.720	26,772.000	
IDEXX LABORATORIES INC	29	551.500	15,993.500	
INTEL CORP	1,829	128.320	234,697.280	
KLA CORPORATION	475	248.640	118,104.000	
LAM RESEARCH CORP	455	379.090	172,485.950	
MICROSOFT CORP	979	372.970	365,137.630	
MICRON TECH INC	410	1,132.330	464,255.300	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	199	87.930	17,498.070	
XCEL ENERGY INC	229	82.230	18,830.670	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	75	218.790	16,409.250	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	302	89.550	27,044.100	
PACCAR INC	193	120.680	23,291.240	
EXELON CORP	376	47.400	17,822.400	
PAYCHEX INC	132	99.900	13,186.800	
PEPSICO INC	497	141.390	70,270.830	
COSTCO WHOLESALE CORP	161	952.540	153,358.940	
QUALCOMM INC	384	189.390	72,725.760	
REGENERON PHARMACEUTICALS	37	632.900	23,417.300	
ROSS STORES INC	118	213.260	25,164.680	
ROPER TECHNOLOGIES INC	37	338.310	12,517.470	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	471	60.790	28,632.090	
AXON ENTERPRISE INC	30	464.830	13,944.900	
BOOKING HOLDINGS INC	282	181.460	51,171.720	
STARBUCKS CORP	415	104.600	43,409.000	
NETFLIX INC	1,533	73.810	113,150.730	
SYNOPSYS INC	70	454.340	31,803.800	

INTUITIVE SURGICAL INC	129	404.700	52,206.300	
TERADYNE INC	57	436.860	24,901.020	
TEXAS INSTRUMENTS INC	331	285.425	94,475.670	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	92	491.340	45,203.280	
WALMART INC	1,775	115.690	205,349.750	
WESTERN DIGITAL CORP	125	586.450	73,306.250	
STRATEGY INC-CL A	121	82.310	9,959.510	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	49	291.370	14,277.130	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	18	1,313.320	23,639.760	
T-MOBILE US INC	396	182.680	72,341.280	
DEXCOM INC	142	70.140	9,959.880	
MERCADOLIBRE INC	18	1,675.100	30,151.800	
KEURIG DR PEPPER INC	500	33.400	16,700.000	
NXP SEMICONDUCTOR NV	93	277.020	25,762.860	
FORTINET INC	269	151.350	40,713.150	
NEBIUS GROUP NV	81	240.300	19,464.300	
TESLA INC	659	379.710	250,228.890	
META PLATFORMS INC	390	550.250	214,597.500	
DIAMONDBACK ENERGY INC	103	179.910	18,530.730	
PALO ALTO NETWORKS INC	297	304.200	90,347.400	
WORKDAY INC	74	124.210	9,191.540	
BAKER HUGHES CO	364	56.560	20,587.840	
BROADCOM INC	625	365.020	228,137.500	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	93	701.090	65,201.370	
DATADOG INC	121	239.770	29,012.170	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	82	899.900	73,791.800	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	164	65.760	10,784.640	
WARNER BROS DISCOVERY INC	921	26.740	24,627.540	
AIRBNB INC	152	145.560	22,125.120	
CONSTELLATION ENERGY CORP	131	264.020	34,586.620	
ASTERA LABS INC	63	391.740	24,679.620	
APPLOVIN CORP	111	477.080	52,955.880	
DOORDASH INC	151	183.090	27,646.590	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	836	112.930	94,409.480	
MARVELL TECHNOLOGY INC	318	266.770	84,832.860	
ARM HOLDINGS PLC ADR	154	334.270	51,477.580	
LINDE PLC	168	519.620	87,296.160	
FERROVIAL NV	264	68.360	18,047.040	
SANDISK CORP/DE	54	2,090.710	112,898.340	
ROCKET LAB CORP	213	84.540	18,007.020	
COREWEAVE INC	164	96.580	15,839.120	

	SHOPIFY INC	448	116.860	52,353.280	
	LUMENTUM HOLDINGS INC	28	816.980	22,875.440	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	165	101.590	16,762.350	
	KRAFT HEINZ CO	426	23.700	10,096.200	
	PDD HOLDINGS INC ADR	245	76.550	18,754.750	
	ALPHABET INC-CL A	768	337.390	259,115.520	
	PAYPAL HOLDINGS INC	324	44.290	14,349.960	
	ALPHABET INC-CL C	719	334.690	240,642.110	
アメリカ・ドル	小計	38,091		8,080,369.060 (1,307,080,499)	
合計		38,091		1,307,080,499 (1,307,080,499)	

（２）株式以外の有価証券

2026年6月29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	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1	595.000	420,379.400	
	アメリカ・ドル	小計	595.000	420,379.400 (68,000,571)	
投資信託受益証券 合計			595	68,000,571 (68,000,571)	
合計				68,000,571 (68,000,571)	

（注）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。

（注）

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 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 101銘柄	95.91	—	100.00
	投資信託受益証券 1銘柄	—	4.99	

（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。

グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	98,239,184
コール・ローン	9,099,652
株式	5,101,479,643
未収配当金	2,889,132
流動資産合計	5,211,707,611
資産合計	5,211,707,611
負債の部	
流動負債	
未払金	36,850,856
流動負債合計	36,850,856
負債合計	36,850,856
純資産の部	
元本等	
元本	1,617,981,281
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,556,875,474
元本等合計	5,174,856,755
純資産合計	5,174,856,755
負債純資産合計	5,211,707,611

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29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. 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。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年6月29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	1,945,012,088円
同期中追加設定元本額	120,409,257円
同期中一部解約元本額	447,440,064円
元本の内訳	
ファンド名	
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	55,223円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	95,964円
Oneグローバル中小型長期成長株ファンド＜DC年金＞	1,187,684,385円
Oneグローバル中小型長期成長株ファンド	430,145,709円
計	1,617,981,281円
2. 受益権の総数	1,617,981,281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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。
-------------------	--

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	963,798,417
合計	963,798,417

（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（2025年12月23日から2026年6月29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）

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1983円 (31,983円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2026年6月29日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	レゾナック・ホールディングス	7,500	17,865.00	133,987,500	
	日油	19,200	2,626.50	50,428,800	
	上村工業	5,900	26,830.00	158,297,000	
	古河電気工業	28,000	4,419.00	123,732,000	
	SWCC	4,800	13,430.00	64,464,000	
	堀場製作所	3,700	27,270.00	100,899,000	
	サンリオ	42,000	1,126.50	47,313,000	
日本円 小計		111,100		679,121,300	
アメリカ・ドル	RALPH LAUREN CORP	2,124	411.160	873,303.840	
	MATERION CORP	1,808	287.020	518,932.160	
	MASTEC INC	3,698	396.250	1,465,332.500	
	JABIL CIRCUIT INC	3,521	358.600	1,262,630.600	
	LINCOLN ELECTRIC HOLDINGS	1,814	266.560	483,539.840	
	ATI INC	7,730	197.400	1,525,902.000	
	LITTELFUSE INC	1,209	452.360	546,903.240	
	STERLING INFRASTRUCTURE INC	2,456	804.760	1,976,490.560	
	TTM TECHNOLOGIES	5,839	191.490	1,118,110.110	
	NPK INTERNATIONAL INC	59,291	15.610	925,532.510	
	RELIANCE INC	1,151	385.780	444,032.780	
	SANMINA CORP	3,345	236.550	791,259.750	
	VICOR CORP	1,400	326.930	457,702.000	
	WOODWARD INC	2,521	431.620	1,088,114.020	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,138	350.850	750,117.300	
	WILLDAN GROUP INC	4,012	81.320	326,255.840	
	IES HOLDINGS INC	1,188	714.900	849,301.200	
	CONSTRUCTION PARTNERS INC	7,012	122.870	861,564.440	
	NVENT ELECTRIC PLC	5,772	162.920	940,374.240	
	ELEMENT SOLUTIONS INC	14,021	45.660	640,198.860	
	TRADEWEB MARKETS INC	4,224	93.520	395,028.480	
	CELESTICA INC	1,728	337.530	583,251.840	
	DT MIDSTREAM INC	5,447	150.740	821,080.780	
	KODIAK GAS SERVICES INC	11,841	76.270	903,113.070	
	BOOT BARN HOLDINGS INC	1,951	177.580	346,458.580	
	LEGENGE CORP	8,935	80.510	719,356.850	
アメリカ・ドル 小計		166,176		21,613,887.390 (3,496,262,426)	
イギリス・ポンド	GAMES WORKSHOP GROUP PLC	2,498	219.400	548,061.200	
	HALMA PLC	10,505	39.040	410,115.200	
イギリス・ポンド 小計		13,003		958,176.400 (204,580,243)	
オーストラリア・ドル	ORICA LTD	28,174	23.640	666,033.360	

オーストラリア・ドル 小計		28,174		666,033.360 (74,169,475)	
カナダ・ドル	HAMMOND POWER SOLUTIONS INC	4,250	324.670	1,379,847.500	
	5N PLUS INC	15,627	38.630	603,671.010	
	DOLLARAMA INC	6,798	193.930	1,318,336.140	
	ARITZIA INC	3,920	158.220	620,222.400	
カナダ・ドル 小計		30,595		3,922,077.050 (446,959,901)	
ノルウェー・クロネ	KITRON ASA	63,387	101.600	6,440,119.200	
ノルウェー・クロネ 小計		63,387		6,440,119.200 (104,716,338)	
ユーロ	DE'LONGHI SPA	8,901	36.720	326,844.720	
ユーロ 小計		8,901		326,844.720 (60,204,797)	
台湾・ドル	KING SLIDE WORKS CO LTD	1,000	6,990.000	6,990,000.000	
台湾・ドル 小計		1,000		6,990,000.000 (35,465,163)	
合計		422,336		5,101,479,643 (4,422,358,343)	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

(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 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 26銘柄	67.56	68.53
イギリス・ポンド	株式 2銘柄	3.95	4.01
オーストラリア・ドル	株式 1銘柄	1.43	1.45
カナダ・ドル	株式 4銘柄	8.64	8.76
ノルウェー・クロネ	株式 1銘柄	2.02	2.05
ユーロ	株式 1銘柄	1.16	1.18
台湾・ドル	株式 1銘柄	0.69	0.70

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	3,015,004,306
コール・ローン	190,360,781
株式	209,433,275,335
投資信託受益証券	1,100,964,847
投資証券	153,355,127
派生商品評価勘定	7,011,077
未収入金	5,240,226
未収配当金	482,140,849
差入委託証拠金	1,919,393,196
流動資産合計	216,306,745,744
資産合計	216,306,745,744
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	195,750,629
未払金	250
未払解約金	103,912,000
流動負債合計	299,662,879
負債合計	299,662,879
純資産の部	
元本等	
元本	69,421,448,159
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	146,585,634,706
元本等合計	216,007,082,865
純資産合計	216,007,082,865
負債純資産合計	216,306,745,744

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月29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	66,428,120,236円
同期中追加設定元本額	22,471,890,757円
同期中一部解約元本額	19,478,562,834円
元本の内訳	
ファンド名	
インデックスオープン・世界株式	20,206,852円
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	11,691,497,936円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>	4,848,039,947円
たわらノーロード 新興国株式	20,947,177,682円

たわらノーロード バランス (8資産均等型)	5,998,164,334円
たわらノーロード バランス (堅実型)	22,729,792円
たわらノーロード バランス (標準型)	128,212,695円
たわらノーロード バランス (積極型)	305,526,135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)	93,091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)	37,091,163円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	177,286,099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)	257,249,634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)	403,240,044円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	552,443円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	7,037,646円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,319,313円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,485,105円
たわらノーロード 全世界株式	13,346,094,204円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	46,523,027円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	21,597,204円
One DC 新興国株式インデックスファンド	3,779,136,976円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け)	939,033円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け)	485,902円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け)	347,006円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け)	344,219円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／1988～1992年生まれ向け)	282,250円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／1993～1997年生まれ向け)	230,208円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／1998～2002年生まれ向け)	236,263円
未来のわたし (ターゲット・イヤー／2003～2007年生まれ向け)	334,656円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	319,300,385円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	247,706,132円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	482,110,381円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	1,010,823,680円
投資のソムリエ	2,000,918,741円
クルーズコントロール	173,815,710円
投資のソムリエ<DC年金>	434,269,320円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	343,175,306円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	337,270,649円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	558,395,066円
ワールドアセットバランス (基本コース)	176,677,566円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	385,652,000円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	65,935,760円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	36,092,426円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	3,892,071円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	176,754,793円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	168,234,509円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	196,360,206円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	74,161,372円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	40,343,022円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	22,847,937円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	9,952,591円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	10,566,681円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	375,670円
ハイブリッドストラテジーマルチアセットファンド（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	10,071,508円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	9,626,545円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,508,924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）	45,095,864円
DIAM世界アセットバランスファンド３VA（適格機関投資家限定）	20,052,485円
計	69,421,448,159円
２． 受益権の総数	69,421,448,159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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	16,072,600,003
投資信託受益証券	△87,934
投資証券	△13,796,123
合計	16,058,715,946

（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（2026年4月21日から2026年6月29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	2026年6月29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 アメリカ・ドル	546,683,228	—	546,703,846	20,618
	546,683,228	—	546,703,846	20,618
合計	546,683,228	—	546,703,846	20,618

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2026年6月29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	6,000,447,568	—	5,811,687,398	△188,760,170
合計	6,000,447,568	—	5,811,687,398	△188,760,170

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1115円 (31,115円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2026年6月29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	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	16,378	30.420	498,218.760	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,343	384.100	2,820,446.300	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,784	171.260	1,675,607.840	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	299,601	2.580	772,970.580	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	2.633	234,337.000	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	

	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
	VTB BANK PJSC	60,800	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	31,700	13.140	416,538.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	39,877	9.480	378,033.960	
	VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	1.082	970,675.180	
	PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000	
	H WORLD GROUP LTD ADR	19,598	42.370	830,367.260	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	63,052	8.390	529,006.280	
	STONECO LTD	22,909	10.990	251,769.910	
	AURA MINERALS INC	3,419	64.080	219,089.520	
	XP INC	43,477	16.130	701,284.010	
	KANZHUN LTD ADR	39,728	13.290	527,985.120	
	FULL TRUCK ALLIANCE CO LTD ADR	77,609	7.720	599,141.480	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	6,582	28.690	188,837.580	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS	388,046	13.170	5,110,565.820	
	JBS NV	32,951	12.220	402,661.220	
	PDD HOLDINGS INC ADR	60,344	76.550	4,619,333.200	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
アメリカ・ドル 小計		3,598,968		21,746,869.020 (3,517,773,533)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	162,134	20.980	3,401,571.320	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	283,598	7.580	2,149,672.840	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	369,100	19.200	7,086,720.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	325,776	14.580	4,749,814.080	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	469,482	17.420	8,178,376.440	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	676,959	12.200	8,258,899.800	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	400,130	8.510	3,405,106.300	
	AIR ARABIA PJSC	227,560	5.550	1,262,958.000	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	200,313	30.440	6,097,527.720	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	95,686	14.100	1,349,172.600	

	DUBAI ELECTRICITY & WATER AUTHORITY PJSC	601,201	2.750	1,653,302.750	
	SALIK CO PJSC	196,959	5.870	1,156,149.330	
	ADNOC DRILLING CO PJSC	319,228	5.840	1,864,291.520	
	ADNOC GAS PLC	736,529	3.440	2,533,659.760	
	ADNOC LOGISTICS & SERVICES	193,108	5.930	1,145,130.440	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	293,434	3.970	1,164,932.980	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		5,551,197		55,457,285.880 (2,437,902,287)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	646,308	1,318.100	851,898,574.800	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	174,055	309.750	53,913,536.250	
	ASIAN PAINTS LTD	39,512	2,645.200	104,517,142.400	
	BANK OF BARODA	93,834	279.150	26,193,761.100	
	EICHER MOTORS LTD	14,110	7,598.000	107,207,780.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	28,312	3,126.600	88,520,299.200	
	HDFC BANK LTD	1,208,896	796.300	962,643,884.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	94,269	3,182.200	299,982,811.800	
	SHREE CEMENT LTD	901	25,735.000	23,187,235.000	
	ICICI BANK LTD	563,486	1,387.500	781,836,825.000	
	INDUSIND BANK LTD	62,632	918.950	57,555,676.400	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	96,592	409.250	39,530,276.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	196,000	1,045.400	204,898,400.000	
	TATA STEEL LTD	799,847	188.710	150,939,127.370	
	TATA MOTORS PASSENGER VEHICLES LIMITED	199,142	353.200	70,336,954.400	
	JSW STEEL LTD	61,601	1,231.000	75,830,831.000	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	12,260	1,991.900	24,420,694.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	57,048	1,131.300	64,538,402.400	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,731	10,599.000	28,945,869.000	
	TATA POWER CO LTD	156,763	388.950	60,972,968.850	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,311	5,237.000	59,235,707.000	
	NESTLE INDIA LTD	59,445	1,402.600	83,377,557.000	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	132,897	402.700	53,517,621.900	
	GAIL INDIA LTD	220,558	172.850	38,123,450.300	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	582,100	409.000	238,078,900.000	
	VEDANTA LTD	138,518	273.450	37,877,747.100	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	6,516	3,421.900	22,297,100.400	
	AXIS BANK LTD	242,900	1,377.200	334,521,880.000	
	TITAN COMPANY LTD	37,657	4,291.300	161,597,484.100	

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	273,278	233.100	63,701,101.800	
NATIONAL ALUMINIUM CO LTD	88,926	332.150	29,536,770.900	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	13,131	1,993.000	26,170,083.000	
BHARAT ELECTRONICS LTD	371,017	407.200	151,078,122.400	
GE VERNOVA T&D INDIA LTD	12,975	5,043.000	65,432,925.000	
LUPIN LTD	25,380	2,343.500	59,478,030.000	
NMDC LTD	300,771	84.940	25,547,488.740	
MPHASIS LTD	14,024	2,263.400	31,741,921.600	
BAJAJ FINANCE LTD	263,000	980.400	257,845,200.000	
INFOSYS LTD	324,358	1,041.200	337,721,549.600	
WIPRO LTD	259,689	175.000	45,445,575.000	
MRF LTD	235	129,550.000	30,444,250.000	
INDIAN OIL CORP LTD	302,990	143.890	43,597,231.100	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	75,000	2,174.200	163,065,000.000	
TRENT LTD	28,449	3,216.200	91,497,673.800	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	11,157	8,592.000	95,860,944.000	
CUMMINS INDIA LTD	13,288	5,642.000	74,970,896.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	94,147	1,100.700	103,627,602.900	
DABUR INDIA LTD	48,488	423.900	20,554,063.200	
HERO MOTOCORP LTD	11,949	4,896.100	58,503,498.900	
SRF LTD	14,918	2,732.900	40,769,402.200	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,207	2,233.600	18,331,155.200	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	56,361	1,350.500	76,115,530.500	
BHARTI AIRTEL LTD	291,286	1,850.700	539,083,000.200	
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	230,823	107.870	24,898,877.010	
ORACLE FINANCIAL SERVICES SOFTWARE LTD	2,314	10,974.500	25,394,993.000	
UNITED SPIRITS LTD	32,011	1,384.900	44,332,033.900	
UNION BANK OF INDIA LTD	143,317	174.710	25,038,913.070	
CANARA BANK	186,895	128.950	24,100,110.250	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	97,281	1,862.800	181,215,046.800	
DIVI'S LABORATORIES LTD	12,822	6,713.500	86,080,497.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,744	13,745.000	175,166,280.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	26,476	1,555.200	41,175,475.200	
HAVELLS INDIA LTD	22,642	1,178.300	26,679,068.600	
TVS MOTOR COMPANY LTD	24,496	3,569.700	87,443,371.200	
JINDAL STEEL LTD	39,201	1,059.500	41,533,459.500	
JINDAL STAINLESS LTD	34,447	695.050	23,942,387.350	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	415,057	151.710	62,968,297.470	

SHRIRAM FINANCE LTD	149,909	1,031.800	154,676,106.200	
PETRONET LNG LTD	75,518	282.250	21,314,955.500	
CIPLA LTD/INDIA	56,006	1,440.100	80,654,240.600	
LARSEN & TOUBRO LTD	71,885	4,216.400	303,095,914.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,779	11,489.000	123,839,931.000	
ASHOK LEYLAND LTD	279,560	160.680	44,919,700.800	
BOSCH LTD	776	40,440.000	31,381,440.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	84,694	2,094.700	177,408,521.800	
ADANI ENTERPRISES LTD	19,238	3,038.000	58,445,044.000	
NTPC LTD	464,225	352.050	163,430,411.250	
YES BANK LTD	1,634,971	24.870	40,661,728.770	
AMBUJA CEMENTS LTD	61,793	423.750	26,184,783.750	
BHARAT FORGE LTD	25,017	2,145.300	53,668,970.100	
SUZLON ENERGY LTD	1,106,340	57.140	63,216,267.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	136,479	953.200	130,091,782.800	
ITC LTD	320,553	290.000	92,960,370.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,722	1,597.000	47,466,034.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	51,485	590.500	30,401,892.500	
SUNDARAM FINANCE LTD	6,335	4,627.100	29,312,678.500	
PHOENIX MILLS LTD	19,759	1,904.600	37,632,991.400	
COROMANDEL INTERNATIONAL LTD	12,117	2,000.400	24,238,846.800	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	11,421	4,516.200	51,579,520.200	
SIEMENS INDIA LTD	8,270	3,627.900	30,002,733.000	
INFO EDGE INDIA LTD	36,145	978.850	35,380,533.250	
GMR AIRPORTS LTD	269,965	108.440	29,275,004.600	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	72,036	942.100	67,865,115.600	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	39,996	1,034.600	41,379,861.600	
TECH MAHINDRA LTD	57,980	1,437.100	83,323,058.000	
VOLTAS LTD	22,355	1,302.400	29,115,152.000	
INDIAN HOTELS CO LTD	92,709	720.650	66,810,740.850	
TORRENT POWER LTD	17,117	1,413.700	24,198,302.900	
VODAFONE IDEA LTD	2,817,069	14.060	39,607,990.140	
MARICO LTD	55,579	825.800	45,897,138.200	
POWER FINANCE CORP LTD	155,773	432.650	67,395,188.450	
INDIAN BANK	29,247	832.600	24,351,052.200	
PAGE INDUSTRIES LTD	602	40,950.000	24,651,900.000	
FORTIS HEALTHCARE LTD	49,466	954.800	47,230,136.800	
ABB LTD/INDIA	5,092	6,993.000	35,608,356.000	
DLF LTD	73,505	621.350	45,672,331.750	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	433,978	283.900	123,206,354.200	
NHPC LTD	307,784	79.400	24,438,049.600	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	11,595	4,841.500	56,137,192.500	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	52,598	1,796.000	94,466,008.000	
REC LTD	118,641	364.650	43,262,440.650	
BAJAJ FINSERV LTD	40,913	1,764.600	72,195,079.800	
BAJAJ AUTO LTD	7,123	9,843.000	70,111,689.000	
ADANI POWER LTD	329,501	229.270	75,544,694.270	
OIL INDIA LTD	50,564	406.800	20,569,435.200	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,629	3,025.600	35,184,702.400	
OBEROI REALTY LTD	13,246	1,749.200	23,169,903.200	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS LTD	17,525	1,556.300	27,274,157.500	
JSW ENERGY LTD	44,430	573.500	25,480,605.000	
COAL INDIA LTD	180,782	435.400	78,712,482.800	
L&T FINANCE LTD	90,118	299.000	26,945,282.000	
MULTI COMMODITY EXCHANGE OF INDIA LTD	13,671	2,831.700	38,712,170.700	
INDUS TOWERS LTD	130,423	393.550	51,327,971.650	
PI INDUSTRIES LTD	7,263	2,684.900	19,500,428.700	
VARUN BEVERAGES LTD	135,186	507.650	68,627,172.900	
BSE LTD	20,544	3,872.100	79,548,422.400	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,696	3,054.000	35,719,584.000	
LTM LTD	8,144	3,762.600	30,642,614.400	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	103,093	585.450	60,355,796.850	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	54,729	1,033.850	56,581,576.650	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	17,621	4,368.700	76,980,862.700	
FEDERAL BANK LTD	195,961	324.050	63,501,162.050	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	20,722	2,649.700	54,907,083.400	
GODREJ PROPERTIES LTD	17,149	1,850.600	31,735,939.400	
POLYCAB INDIA LTD	5,665	9,531.000	53,993,115.000	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	44,300	1,799.200	79,704,560.000	
HITACHI ENERGY INDIA LTD	1,259	33,965.000	42,761,935.000	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	26,315	624.850	16,442,927.750	
ETERNAL LTD	258,514	255.150	65,959,847.100	
LODHA DEVELOPERS LTD	27,877	947.450	26,412,063.650	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	76,520	1,123.350	85,958,742.000	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	3,949	12,013.000	47,439,337.000	
APL APOLLO TUBES LTD	18,244	1,793.500	32,720,614.000	

	ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	38,768	1,124.800	43,606,246.400	
	FSN E-COMMERCE VENTURES LTD	120,259	301.350	36,240,049.650	
	PB FINTECH LTD	36,762	1,615.200	59,377,982.400	
	MANKIND PHARMA LTD	11,821	2,462.300	29,106,848.300	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	305,795	239.430	73,216,496.850	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	12,169	1,486.900	18,094,086.100	
	SWIGGY LTD	154,307	240.750	37,149,410.250	
	WAAREE ENERGIES LTD	9,279	3,009.400	27,924,222.600	
	TATA MOTORS LTD	206,895	431.900	89,357,950.500	
	VISHAL MEGA MART LTD	259,329	116.390	30,183,302.310	
	SIEMENS ENERGY INDIA LTD	9,101	3,685.800	33,544,465.800	
	VEDANTA ALUMINIUM METAL LTD	138,518	442.820	61,338,540.760	
	ZYDUS LIFESCIENCES LTD	17,682	1,101.400	19,474,954.800	
	ADITYA BIRLA CAPITAL LTD	79,827	390.800	31,196,391.600	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	15,670	4,294.600	67,296,382.000	
	IDFC BANK LTD	509,314	79.220	40,347,855.080	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	24,532	1,813.600	44,491,235.200	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	37,542	491.050	18,434,999.100	
	ALKEM LABORATORIES LTD	4,865	5,425.000	26,392,625.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	19,624	5,450.000	106,950,800.000	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,547	17,428.000	44,389,116.000	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	49,103	1,744.900	85,679,824.700	
インド・ルピー 小計		23,528,220		13,890,958,839.690 (24,031,358,793)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	2,181,173	1,465.000	3,195,418,445.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	135,001	22,600.000	3,051,022,600.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,598,100	4,760.000	7,606,956,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,496,500	2,480.000	11,151,320,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	659,600	3,160.000	2,084,336,000.000	
	BANK MANDIRI	3,975,000	3,990.000	15,860,250,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	6,757,300	2,870.000	19,393,451,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,498,400	3,320.000	4,974,688,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,286,900	6,175.000	32,646,607,500.000	

	BUMI RESOURCES MINERALS TBK PT	5,755,200	498.000	2,866,089,600.000	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	86,702,400	50.000	4,335,120,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		119,045,574		107,165,259,145.000 (975,203,858)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	11,532	62.210	717,405.720	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	12,640	147.280	1,861,619.200	
	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	4,100	240.340	985,394.000	
	TIANSUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	22.560	270,720.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,880	63.380	816,334.400	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	26,000	22.480	584,480.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	12,100	30.000	363,000.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	18,640	25.620	477,556.800	
	KINGNET NETWORK CO LTD	17,300	15.600	269,880.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.140	231,874.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	5,300	118.190	626,407.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	45.050	54,060.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	18.400	298,080.000	
	HGTECH CO LTD	7,300	160.940	1,174,862.000	
	CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	2,100	62.800	131,880.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	41.500	489,700.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	14.350	116,235.000	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	11,800	260.320	3,071,776.000	
	SHANJIN INTERNATIONAL GOLD CO LTD	23,900	17.310	413,709.000	
	SHANDONG HIMILE MECHANICAL SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	8,120	46.740	379,528.800	
	GEM CO LTD	29,100	6.690	194,679.000	
	SHENZHEN EVERWIN PRECISION TECHNOLOGY CO LTD	10,100	26.670	269,367.000	

ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	43,500	13.670	594,645.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	23.980	405,262.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	12,760	151.050	1,927,398.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	13.170	205,359.810	
ZHEJIANG NHU CO LTD	24,512	29.580	725,064.960	
YUNNAN TIN CO LTD	9,000	42.580	383,220.000	
LEO GROUP CO LTD	39,500	4.760	188,020.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	18.080	92,208.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	43.560	405,108.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	26.880	279,552.000	
MUYUAN FOODS GROUP CO LTD	33,900	33.560	1,137,684.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,950	11.380	101,851.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	5.920	106,560.000	
TIANQI LITHIUM CORP	11,700	58.920	689,364.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	18.570	207,984.000	
HAISCO PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	2,800	55.510	155,428.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	35.600	427,200.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	11.380	586,639.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	10,140	22.160	224,702.400	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	14,739	83.980	1,237,781.220	
BLUEFOCUS INTELLIGENT COMMUNICATIONS GROUP CO LTD	21,200	13.410	284,292.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	7,770	63.890	496,425.300	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	67,129	8.000	537,032.000	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	160.050	1,728,540.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	7,900	30.150	238,185.000	

XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	58,700	8.220	482,514.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,800	12.300	194,340.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	20,100	26.410	530,841.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	161.530	807,650.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	70,900	6.220	440,998.000	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLDING GROUP CO LTD	34,500	6.550	225,975.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	18.410	292,719.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,500	75.200	564,000.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	10,000	63.280	632,800.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	11.190	153,023.250	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	38.750	352,625.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,920	242.000	948,640.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	10,800	10.850	117,180.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	44,454	68.000	3,022,872.000	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	28.910	864,409.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	4.760	339,388.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	6.080	120,992.000	
WANXIANG QIANCHAO CO LTD	18,900	12.630	238,707.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	15.980	305,218.000	
IFLYTEK CO LTD	11,500	39.120	449,880.000	
GOERTEK INC	18,100	22.330	404,173.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.660	163,158.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	31.130	1,095,776.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	30,200	55.590	1,678,818.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	238,509	5.400	1,287,948.600	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	9.760	276,208.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	6.860	277,747.680	

HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	26,400	22.800	601,920.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	47.000	494,440.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	91,418	20.070	1,834,759.260	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY CO LTD	7,800	39.220	305,916.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	24,200	73.170	1,770,714.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	58,900	4.310	253,859.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	222,300	7.790	1,731,717.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	6.540	300,186.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	37.020	447,942.000	
MIDEA GROUP CO LTD	20,700	78.550	1,625,985.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.990	422,577.000	
PING AN BANK CO LTD	142,300	10.230	1,455,729.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	40,080	12.160	487,372.800	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	118,600	4.400	521,840.000	
ZTE CORP	22,700	35.670	809,709.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.310	208,335.000	
WEICHAI POWER CO LTD	44,200	27.950	1,235,390.000	
GF SECURITIES CO LTD	31,600	22.350	706,260.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	23.330	492,263.000	
BYD CO LTD	47,000	78.200	3,675,400.000	
CCOOP GROUP CO LTD	127,500	1.360	173,400.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	16.410	559,581.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	50.010	483,096.600	
LB GROUP CO LTD	11,000	17.370	191,070.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	11.390	487,492.000	
INNER MONGOLIA XINGYE SILVER&TIN MINING CO LTD	12,200	33.010	402,722.000	

SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,500	97.670	1,123,205.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	4,280	813.370	3,481,223.600	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	71.600	916,480.000	
CHINA TUNGSTEN AND HIGHTECH MATERIALS CO LTD	13,400	99.510	1,333,434.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	10.420	356,364.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	47,800	3.410	162,998.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	78.970	134,249.000	
GUOCHENG MINING CO LTD	9,200	32.260	296,792.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	58.370	385,242.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	6.640	253,648.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	13,200	27.440	362,208.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	21.410	361,829.000	
SF HOLDING CO LTD	33,000	30.820	1,017,060.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	233.210	583,025.000	
VICTORY GIANT TECHNOLOGY HUIZHOU CO LTD	5,300	319.550	1,693,615.000	
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	7,644	566.000	4,326,504.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	80,290	8.890	713,778.100	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	8.480	329,872.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	33,000	6.910	228,030.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	49.450	113,735.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	21,800	30.250	659,450.000	
YANGTZE OPTICAL FIBRE & CABLE JOINT STOCK LTD CO	3,700	543.000	2,009,100.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	26.400	170,570.400	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	47,800	18.440	881,432.000	
BAIYIN NONFERROUS GROUP CO LTD	43,000	5.040	216,720.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	9.510	213,975.000	

SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	24.870	379,963.860	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	3,500	175.410	613,935.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	33.280	146,764.800	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	5,800	62.860	364,588.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	46.790	426,537.640	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	6,840	1,253.890	8,576,607.600	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY NETWORK & TECHNOLOGY HOLDINGS CO LTD	27,500	9.500	261,250.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,342	433.500	1,882,257.000	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	78.900	236,700.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	10,200	54.880	559,776.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	8.410	106,807.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	3,300	47.600	157,080.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	17.960	382,548.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	69,700	70.220	4,894,334.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,200	133.980	964,656.000	
SHENZHEN MEGMEET ELECTRICAL CO LTD	3,200	160.760	514,432.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	2,500	89.300	223,250.000	
SG MICRO CORP	4,413	131.550	580,530.150	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	27,340	381.000	10,416,540.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,916	770.000	3,015,320.000	
WUXI APPTec CO LTD	13,972	118.180	1,651,210.960	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	30,200	4.930	148,886.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	73,300	6.300	461,790.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	2.720	224,400.000	

MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	100.930	258,380.800	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	45,100	20.740	935,374.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	26.320	195,426.000	
BANK OF SUZHOU CO LTD	40,700	7.120	289,784.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	2,156	143.090	308,502.040	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	97.110	106,821.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	53.100	133,812.000	
ANJI MICROELECTRONICS TECHNOLOGY SHANGHAI CO LTD	1,040	274.480	285,459.200	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	6,258	413.000	2,584,554.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	8,000	261.820	2,094,560.000	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD	5,200	143.280	745,056.000	
OMNIVISION INTEGRATED CIRCUITS GROUP INC	7,330	86.720	635,657.600	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	26,100	8.870	231,507.000	
TIANFENG SECURITIES CO LTD	43,200	3.410	147,312.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.770	316,611.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	110.980	1,187,486.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.280	205,344.000	
JL MAG RARE-EARTH CO LTD	9,400	30.070	282,658.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	3,480	38.020	132,309.600	
HUNAN YUNENG NEW ENERGY BATTERY MATERIAL CO LTD	7,900	75.800	598,820.000	
CITIC PACIFIC SPECIAL STEEL GROUP CO LTD	21,200	12.950	274,540.000	
BEIJING COMPASS TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	2,900	94.790	274,891.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	301,300	4.530	1,364,889.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	182.000	582,400.000	

SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	7,028	318.000	2,234,904.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,700	261.930	445,281.000	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	5,520	25.400	140,208.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	170,800	4.920	840,336.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	12.380	259,980.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	41.690	133,408.000	
GUOLIAN MINSHENG SECURITIES CO LTD	26,200	8.900	233,180.000	
HENAN SHIJIA PHOTONS TECHNOLOGY CO LTD	4,000	179.700	718,800.000	
QUANTUMCTEK CO LTD	600	494.900	296,940.000	
ACM RESEARCH SHANGHAI INC	2,200	414.000	910,800.000	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	3,000	336.000	1,008,000.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	40,600	11.080	449,848.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	7,900	86.190	680,901.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	5,100	139.960	713,796.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	4,700	314.900	1,480,030.000	
SHENZHEN ENVICOOL TECHNOLOGY CO LTD	8,580	82.570	708,450.600	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	7.900	91,418.800	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	5.290	188,324.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	6,577	26.270	172,777.790	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	42.390	122,931.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	14,400	35.560	512,064.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	59.630	274,298.000	
DELTON TECHNOLOGY GUANGZHOU INC	3,800	220.880	839,344.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	4,000	98.230	392,920.000	

SUZHOU EVERBRIGHT PHOTONICS CO LTD	1,600	396.000	633,600.000	
PIOTECH INC	1,876	832.000	1,560,832.000	
DOSILICON CO LTD	2,600	190.530	495,378.000	
RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,100	77.770	707,707.000	
ROBOTECHNIK INTELLIGENT TECHNOLOGY CO LTD	900	587.900	529,110.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	4.700	188,940.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	3,925	1,458.000	5,722,650.000	
SHANGHAI ALLIST PHARMACEUTICALS CO LTD	3,400	93.470	317,798.000	
APT MEDICAL INC	1,450	181.270	262,841.500	
SHANNON SEMICONDUCTOR TECHNOLOGY CO LTD	2,800	301.000	842,800.000	
ADVANCED FIBER RESOURCES ZHUHAI LTD	1,900	362.430	688,617.000	
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD	2,400	113.760	273,024.000	
SHENZHEN LONGSYS ELECTRONICS CO LTD	2,300	679.600	1,563,080.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,900	53.790	263,571.000	
ANKER INNOVATIONS TECHNOLOGY CO LTD	3,400	106.090	360,706.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,540	85.500	131,670.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	7,880	56.810	447,662.800	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	200.030	489,473.410	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	34.860	662,340.000	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	17.460	150,156.000	
LOONGSON TECHNOLOGY CORP LTD	1,600	144.920	231,872.000	
HWATSING TECHNOLOGY CO LTD	4,183	263.600	1,102,638.800	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.650	491,840.000	
SUZHOU CENTEC COMMUNICATIONS CO LTD	2,200	327.500	720,500.000	
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	149,700	1.530	229,041.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	11,700	26.870	314,379.000	

PETROCHINA CO LTD	117,300	8.930	1,047,489.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	356,000	7.150	2,545,400.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	527,900	6.190	3,267,701.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	5.760	1,128,960.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	223,900	4.520	1,012,028.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	35.040	483,552.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	43,600	39.570	1,725,252.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	133,000	36.000	4,788,000.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	64,700	47.230	3,055,781.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	136,000	16.770	2,280,720.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	227,300	8.760	1,991,148.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	237,900	3.290	782,691.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	9.730	413,525.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	8,000	1,168.630	9,349,040.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	340,100	6.510	2,214,051.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD	47,600	7.130	339,388.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	79,400	27.740	2,202,556.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,900	28.430	1,105,927.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	157,800	26.650	4,205,370.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	206,900	4.630	957,947.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	2.970	683,991.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	287,400	4.400	1,264,560.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	6.510	460,257.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	41,900	24.270	1,016,913.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	138,300	4.940	683,202.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	168,900	4.050	684,045.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	117,500	5.390	633,325.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	17.170	398,344.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	20.480	845,824.000	

HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.310	431,290.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	96,300	4.750	457,425.000	
CRRC CORP LTD	162,500	5.220	848,250.000	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS	41,052	48.670	1,998,000.840	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	25,100	47.260	1,186,226.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	20.410	822,523.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	117,500	4.220	495,850.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,000	59.600	834,400.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	38,000	19.720	749,360.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	45,600	17.680	806,208.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.690	475,097.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	127,300	9.780	1,244,994.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	21.210	263,004.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	38,100	21.730	827,913.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	19,800	71.790	1,421,442.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	6.840	538,308.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD	81,400	7.320	595,848.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	139,000	25.100	3,488,900.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	7.150	393,965.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	13.060	498,892.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	55,212	22.740	1,255,520.880	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	53.320	522,536.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	5.060	156,354.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.220	493,950.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	51.590	226,996.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	76,300	8.400	640,920.000	

UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD	10,600	32.940	349,164.000	
AIR CHINA LTD	91,800	6.370	584,766.000	
TBEA CO LTD	24,180	22.450	542,841.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.520	327,120.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	2.470	138,814.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	4.780	498,076.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	41,300	33.400	1,379,420.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,600	23.200	269,120.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	42.390	631,611.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	25,600	15.870	406,272.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	12.670	418,110.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	13.990	331,563.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	15.290	174,306.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	18,300	37.310	682,773.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.240	586,752.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	72,870	13.390	975,729.300	
CMOC GROUP LIMITED	111,200	17.240	1,917,088.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	31,700	18.300	580,110.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	226,900	6.000	1,361,400.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	22.390	201,510.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	23.000	462,760.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	24.840	193,752.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	27.130	751,501.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	67,500	3.030	204,525.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.390	372,937.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	46,800	17.980	841,464.000	
YUTONG BUS CO LTD	16,300	26.800	436,840.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	8.630	370,227.000	

CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	4.050	321,975.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	28.470	427,590.930	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	4.460	258,680.000	
CHINA XD ELECTRIC CO LTD	25,700	14.880	382,416.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	16,400	14.900	244,360.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	20.960	215,133.440	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	8.750	142,187.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	13,100	84.500	1,106,950.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	5.410	243,991.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	50.430	514,386.000	
SICHUAN CHANGHONG ELECTRIC CO LTD	31,900	6.360	202,884.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	7.770	130,536.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	31,800	9.760	310,368.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.580	180,452.000	
WESTERN MINING CO LTD	15,100	26.370	398,187.000	
ZHANGZHOU PIEN TZE HUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	4,300	108.000	464,400.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	21,100	34.280	723,308.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,880	108.100	851,828.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	11,500	76.220	876,530.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	19.560	1,111,008.000	
KINGFA SCI & TECH CO LTD	18,500	15.560	287,860.000	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	9,200	33.960	312,432.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	5,550	27.700	153,735.000	

ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	50.950	1,034,285.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	104,900	4.090	429,041.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	19,000	15.040	285,760.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	26,500	61.290	1,624,185.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	15,900	19.960	317,364.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	7.930	376,357.800	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	32.130	408,051.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	15,400	178.500	2,748,900.000	
WOLONG ELECTRIC GROUP CO LTD	10,700	31.890	341,223.000	
TONGWEI CO LTD	32,600	11.960	389,896.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	12,784	16.360	209,146.240	
JCET GROUP CO LTD	10,900	100.890	1,099,701.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	50.380	342,584.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	25.090	263,194.100	
CHONGQING QIANLI TECHNOLOGY CO LTD	33,000	8.330	274,890.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	74.120	1,500,633.520	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	8,424	108.200	911,476.800	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	13,800	110.810	1,529,178.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	11.730	231,081.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	35.180	172,382.000	
NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	9,004	14.400	129,657.600	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	10,700	42.720	457,104.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CORP	8,985	96.490	866,962.650	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	4,550	110.900	504,595.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	84.720	601,512.000	
GEOVIS TECHNOLOGY CO LTD	5,000	40.150	200,750.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	13.710	152,181.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	3.780	573,804.000	

SICHUAN BIOKIN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	262.590	682,734.000	
BIWIN STORAGE TECHNOLOGY CO LTD	2,800	501.050	1,402,940.000	
YUANJIE SEMICONDUCTOR TECHNOLOGY CO LTD	780	1,776.910	1,385,989.800	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	68.050	789,380.000	
DAZHONG MINING CO LTD	12,300	29.770	366,171.000	
DAJIN HEAVY INDUSTRY CO LTD	6,100	55.550	338,855.000	
REMEGEN CO LTD	3,800	112.990	429,362.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	52,200	8.090	422,298.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	7,760	119.050	923,828.000	
CSI SOLAR CO LTD	32,400	10.670	345,708.000	
SICHUAN HUAFENG TECHNOLOGY CO LTD	4,600	144.820	666,172.000	
SHENGYI ELECTRONICS CO LTD	4,600	131.900	606,740.000	
SHENZHEN TECHWINSEMI TECHNOLOGY CO LTD	1,400	951.000	1,331,400.000	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	15,400	344.900	5,311,460.000	
CICT MOBILE COMMUNICATION TECHNOLOGY CO LTD	20,800	19.510	405,808.000	
GUOBO ELECTRONICS CO LTD	2,400	100.300	240,720.000	
SHARETRONIC DATA TECHNOLOGY CO LTD	3,500	332.470	1,163,645.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	44,968	12.670	569,744.560	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	97.910	176,238.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.240	384,092.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	61,351	20.700	1,269,965.700	
HUAQIN CO LTD	5,320	69.250	368,410.000	
HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR LTD	3,000	323.000	969,000.000	
SHANDONG HONGQIAO ALUMINUM INDUSTRY HOLDING CO LTD	18,900	14.870	281,043.000	
NEXCHIP SEMICONDUCTOR CORP	17,000	58.110	987,870.000	
SKYVERSE TECHNOLOGY CO LTD	2,000	355.000	710,000.000	

	UNITED NOVA TECHNOLOGY CO LTD	76,800	9.980	766,464.000	
	CHENGTON MINING GROUP CO LTD	19,900	10.660	212,134.000	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	25,519	32.980	841,616.620	
	DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	13.210	174,372.000	
	NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	10,150	52.750	535,412.500	
	GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD	126,110	17.400	2,194,314.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	155,200	8.930	1,385,936.000	
	JIANGSU ETERN CO LTD	14,500	65.710	952,795.000	
	SERES GROUP CO LTD	9,000	59.800	538,200.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	108,700	11.090	1,205,483.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	33,900	14.850	503,415.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	21,200	15.290	324,148.000	
	SHENZHEN KINWONG ELECTRONIC CO LTD	4,300	72.630	312,309.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	50,400	12.470	628,488.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.510	275,373.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	15.900	292,560.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,616	16.420	92,214.720	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	13,572	15.670	212,673.240	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	44,800	9.390	420,672.000	
	FOUNDER TECHNOLOGY GROUP CORP	25,600	13.000	332,800.000	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING GROUP LTD	14,900	25.930	386,357.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	47.280	312,048.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	97,300	14.510	1,411,823.000	
	オフショア・人民元 小計	15,660,014		325,940,341.590 (7,748,416,770)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	465,240	17.630	8,202,181.200	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	305,334	4.152	1,267,746.760	
	OOREDOO QSC	91,110	13.400	1,220,874.000	
	QATAR FUEL QSC	57,879	14.060	813,778.740	
	NEBRAS ENERGY	59,319	14.400	854,193.600	

	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	101,753	11.000	1,119,283.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	162,839	11.100	1,807,512.900	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	182,517	21.900	3,997,122.300	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	284,685	4.330	1,232,686.050	
	AL RAYAN BANK	580,363	2.065	1,198,449.590	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	555,481	1.171	650,468.250	
	DUKHAN BANK	178,162	3.351	597,020.860	
カタール・リアル 小計		3,024,682		22,961,317.250 (1,020,860,165)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	1,168,365	0.771	900,809.410	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	213,954	0.600	128,372.400	
	GULF BANK KSCP	233,639	0.354	82,708.200	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	934,120	0.809	755,703.080	
	MABANEE CO KPSC	72,047	0.934	67,291.890	
	BOUBYAN BANK KSCP	154,751	0.636	98,421.630	
	WARBA BANK KSCP	204,410	0.279	57,030.390	
クウェート・ディナール 小計		2,981,286		2,090,337.000 (1,096,047,303)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	49,088	29,540.000	1,450,059,520.000	
	GRUPO CIBEST SA	24,801	78,460.000	1,945,886,460.000	
	GRUPO CIBEST SA	45,569	67,040.000	3,054,945,760.000	
コロンビア・ペソ 小計		119,458		6,450,891,740.000 (301,972,693)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	27,314	30.440	831,438.160	
	JARIR MARKETING CO	60,555	16.340	989,468.700	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	7,248	149.800	1,085,750.400	
	MAKKAH CONSTRUCTION & DEVELOPMENT CO	10,427	85.950	896,200.650	
	ETIHAD ETISALAT CO	39,442	60.000	2,366,520.000	
	SAUDI BRITISH BANK	104,013	33.360	3,469,873.680	
	AL RAJHI BANK	312,490	66.300	20,718,087.000	
	ARAB NATIONAL BANK	97,011	21.600	2,095,437.600	
	BANK ALBILAD	81,739	24.590	2,009,962.010	
	BANK AL-JAZIRA	84,904	11.760	998,471.040	
	BANQUE SAUDI FRANSI	121,586	19.480	2,368,495.280	
	RIYAD BANK	215,176	20.220	4,350,858.720	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	56,260	13.400	753,884.000	
	SAUDI TELECOM CO	209,410	43.580	9,126,087.800	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	25,555	125.400	3,204,597.000	

	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	100,957	53.150	5,365,864.550	
	SAUDI ENERGY CO	84,386	17.950	1,514,728.700	
	ALMARAI CO JSC	47,828	44.820	2,143,650.960	
	JABAL OMAR DEVELOPMENT CO	60,707	14.910	905,141.370	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	54,640	17.700	967,128.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	8,423	178.900	1,506,874.700	
	ALINMA BANK	159,681	24.830	3,964,879.230	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	121,503	60.450	7,344,856.350	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	10,690	63.150	675,073.500	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	637,116	26.600	16,947,285.600	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,562	212.800	1,821,993.600	
	ACWA POWER CO	24,817	192.600	4,779,754.200	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,198	206.000	452,788.000	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	4,735	133.300	631,175.500	
	ELM CO	2,637	686.500	1,810,300.500	
	ADES HOLDING CO	35,063	18.610	652,522.430	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	4,712	177.700	837,322.400	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	310,804	39.500	12,276,758.000	
	サウジアラビア・リアル 小計	3,132,589		119,863,229.630 (5,173,296,991)	
タイ・パーツ	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	381,700	36.500	13,932,050.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	66,000	215.000	14,190,000.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,204,900	2.440	5,379,956.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	375,700	19.600	7,363,720.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	103,900	352.000	36,572,800.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	331,500	304.000	100,776,000.000	
	PTT PCL	1,074,100	35.000	37,593,500.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	77,550	240.000	18,612,000.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	420,900	62.250	26,201,025.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	196,200	66.750	13,096,350.000	

	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,112,200	18.900	21,020,580.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	55,900	188.500	10,537,150.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	327,810	24.800	8,129,688.000	
	CP ALL PCL NVDR	575,800	45.250	26,054,950.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	127,745	130.000	16,606,850.000	
	GULF DEVELOPMENT PCL NVDR	403,874	59.750	24,131,471.500	
	SCB X PCL NVDR	94,700	145.000	13,731,500.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,034,228	12.700	13,134,695.600	
タイ・パーツ 小計		8,964,707		407,064,286.100 (1,970,191,145)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,306	968.000	8,040,208.000	
	CEZ	13,559	1,230.000	16,677,570.000	
	MONETA MONEY BANK AS	23,959	190.400	4,561,793.600	
チェコ・コルナ 小計		45,824		29,279,571.600 (222,293,436)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,919,485	75.000	518,961,375.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	8,508	60,200.000	512,181,600.000	
	BANCO DE CHILE	4,887,223	177.800	868,948,249.400	
	EMPRESAS COPEC SA	36,661	5,765.000	211,350,665.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	37,177,986	26.970	1,002,690,282.420	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	15,257	65,950.000	1,006,199,150.000	
	FALABELLA SA	73,380	5,911.000	433,749,180.000	
	CENCOSUD SA	145,870	2,127.000	310,265,490.000	
	ENEL CHILE SA	2,582,189	81.290	209,906,143.810	
	PLAZA SA	75,590	3,765.000	284,596,350.000	
チリ・ペソ 小計		51,922,149		5,358,848,485.630 (938,221,834)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	328,217	77.250	25,354,763.250	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	121,617	361.500	43,964,545.500	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	348,668	42.120	14,685,896.160	
	KOC HOLDING AS	75,955	198.200	15,054,281.000	
	TURK HAVA YOLLARI	53,238	330.750	17,608,468.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	124,785	110.900	13,838,656.500	
	TURKIYE IS BANKASI	852,515	14.740	12,566,071.100	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	108,640	219.200	23,813,888.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	333,172	40.660	13,546,773.520	

	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	127,546	97.450	12,429,357.700	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	99,212	374.500	37,154,894.000	
トルコ・リラ 小計		2,573,565		230,017,595.230 (799,702,173)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	13,519	12,260.000	165,742,940.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	41,431	3,668.000	151,968,908.000	
	OTP BANK NYRT	23,146	45,810.000	1,060,318,260.000	
ハンガリー・フォリント 小計		78,096		1,378,030,108.000 (716,684,521)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	582,600	15.300	8,913,780.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	211,828	97.500	20,653,230.000	
	AYALA CORP	28,113	422.200	11,869,308.600	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	102,520	885.000	90,730,200.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	152,915	65.900	10,077,098.500	
	BDO UNIBANK INC	235,537	121.000	28,499,977.000	
	PLDT INC	8,765	1,128.000	9,886,920.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	945,875	18.520	17,517,605.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,623	596.500	14,091,119.500	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	25,700	576.000	14,803,200.000	
フィリピン・ペソ 小計		2,317,476		227,042,438.600 (599,096,883)	
ブラジル・レ アル	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	196,000	15.260	2,990,960.000	
	VALE SA	379,089	78.150	29,625,805.350	
	RAIA DROGASIL SA	131,951	17.350	2,289,349.850	
	AXIA ENERGIA SA	135,595	55.620	7,541,793.900	
	BANCO DO BRASIL SA	184,100	20.340	3,744,594.000	
	ITAUSA SA	593,614	13.460	7,990,044.440	
	GERDAU SA	141,637	21.420	3,033,864.540	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	402,810	42.250	17,018,722.500	
	VIBRA ENERGIA SA	116,582	29.690	3,461,319.580	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	453,712	38.060	17,268,278.720	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOBILIDADE SA	112,420	14.480	1,627,841.600	
	WEG SA	152,544	46.900	7,154,313.600	
	BANCO BRADESCO SA PREF	576,702	17.920	10,334,499.840	
	BANCO BRADESCO SA	152,592	15.640	2,386,538.880	
	SUZANO SA	68,975	40.110	2,766,587.250	
	CPFL ENERGIA SA	23,800	45.500	1,082,900.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	583,423	42.240	24,643,787.520	

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	45,400	44.380	2,014,852.000	
	PORTO SEGURO SA	20,100	53.260	1,070,526.000	
	ENGIE BRASIL SA	32,881	34.160	1,123,214.960	
	LOCALIZA RENT A CAR	90,589	43.100	3,904,385.900	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	70,304	25.600	1,799,782.400	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	118,100	39.750	4,694,475.000	
	EMBRAER SA	70,000	81.900	5,733,000.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	185,140	10.960	2,029,134.400	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	249,607	29.600	7,388,367.200	
	MBRF GLOBAL FOODS COMPANY SA	66,640	17.100	1,139,544.000	
	ENEVA SA	101,600	26.810	2,723,896.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	537,548	14.920	8,020,216.160	
	PRIO SA	85,700	53.290	4,566,953.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	81,600	34.790	2,838,864.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	66,300	39.170	2,596,971.000	
	AMBEV SA	476,395	16.730	7,970,088.350	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	52,100	19.620	1,022,202.000	
	TIM SA	88,100	22.730	2,002,513.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	77,200	34.710	2,679,612.000	
	AXIA ENERGIA SA-C	37,274	54.420	2,028,451.080	
	RUMO SA	136,200	13.690	1,864,578.000	
ブラジル・リアル 小計		7,094,324		214,172,828.020 (6,697,826,851)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	68,864	19.525	1,344,569.600	
	MBANK	1,453	1,372.500	1,994,242.500	
	BUDIMEX SA	1,403	721.800	1,012,685.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,890	327.750	4,880,197.500	
	BANK PEKAO SA	18,555	228.800	4,245,384.000	
	ORLEN SA	61,308	123.460	7,569,085.680	
	ASSECO POLAND SA	4,956	167.750	831,369.000	
	LPP SA	122	18,310.000	2,233,820.000	
	ERSTE BANK POLSKA SA	4,377	647.600	2,834,545.200	
	CD PROJEKT RED SA	6,738	217.400	1,464,841.200	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	94,045	103.620	9,744,942.900	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	104,937	9.600	1,007,395.200	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	59,477	65.440	3,892,174.880	

	DINO POLSKA SA	48,070	28.980	1,393,068.600	
	ALLEGRO.EU SA	85,638	37.195	3,185,305.410	
	ZABKA GROUP SA	36,260	26.940	976,844.400	
ポーランド・ズロチ 小計		611,093		48,610,471.470 (2,088,053,080)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	272,300	6.400	1,742,720.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	823,100	7.410	6,099,171.000	
	CELCOMDIGI BHD	372,600	2.700	1,006,020.000	
	RHB BANK BHD	215,180	8.220	1,768,779.600	
	GAMUDA BHD	555,900	4.250	2,362,575.000	
	HONG LEONG BANK BHD	62,908	21.680	1,363,845.440	
	IOI CORP BHD	231,913	4.270	990,268.510	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	47,600	21.300	1,013,880.000	
	MALAYAN BANKING BHD	598,075	10.800	6,459,210.000	
	MISC BHD	157,880	7.890	1,245,673.200	
	PETRONAS GAS BHD	78,500	17.540	1,376,890.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	131,600	7.460	981,736.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	285,550	14.340	4,094,787.000	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,523,650	4.830	7,359,229.500	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	313,320	4.100	1,284,612.000	
	MAXIS BHD	228,800	3.480	796,224.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	265,400	4.020	1,066,908.000	
	SUNWAY BHD	293,800	5.090	1,495,442.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	173,900	8.540	1,485,106.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	396,600	7.700	3,053,820.000	
	SD GUTHRIE BHD	205,700	6.030	1,240,371.000	
マレーシア・リンギット 小計		7,234,276		48,287,268.250 (1,916,270,583)	
メキシコ・ペソ	SIGMA FOODS SAB DE CV	367,756	16.090	5,917,194.040	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	145,000	57.010	8,266,450.000	
	GRUMA SAB DE CV	18,575	283.180	5,260,068.500	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	19,800	277.290	5,490,342.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	56,800	134.150	7,619,720.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	257,100	182.230	46,851,333.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	19,295	777.210	14,996,266.950	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	155,900	38.900	6,064,510.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,965	537.940	9,664,092.100	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	304,862	200.130	61,012,032.060	

	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	147,700	41.040	6,061,608.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	55,380	211.490	11,712,316.200	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	556,000	50.800	28,244,800.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	41,940	439.850	18,447,309.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	26,900	244.920	6,588,348.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,603,878	23.210	37,226,008.380	
メキシコ・ペソ 小計		3,794,851		279,422,398.230 (2,582,170,324)	
ユーロ	GEK TERNA SA	5,566	45.280	252,028.480	
	NATIONAL BANK OF GREECE	90,434	15.000	1,356,510.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,480	19.490	282,215.200	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	ALLWYN AG	17,320	13.870	240,228.400	
	JUMBO SA	11,425	22.400	255,920.000	
	PUBLIC POWER CORP	27,615	23.040	636,249.600	
	ALPHA BANK SA	173,066	3.900	674,957.400	
	PIRAEUS BANK SA	113,139	8.876	1,004,221.760	
	EUROBANK SA	264,312	4.089	1,080,771.760	
ユーロ 小計		720,487		5,783,102.600 (1,065,247,499)	
韓国・ウォン	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	3,819	211,000.000	805,809,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,120	636,000.000	1,984,320,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,735	131,500.000	622,652,500.000	
	KT&G CORP	9,745	167,400.000	1,631,313,000.000	
	KAKAO CORP	31,822	33,150.000	1,054,899,300.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,033	98,000.000	1,375,234,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	11,428	90,600.000	1,035,376,800.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	21,070	40,250.000	848,067,500.000	
	LG UPLUS CORP	8,998	14,220.000	127,951,560.000	
	DOOSAN ENERBILITY	47,915	81,100.000	3,885,906,500.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,213	45,650.000	237,973,450.000	
	LG CHEM LTD	4,872	271,000.000	1,320,312,000.000	
	LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	8,048	203,000.000	1,633,744,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	44,231	91,600.000	4,051,559,600.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	22,754	18,310.000	416,625,740.000	
	S-OIL CORP	4,930	93,200.000	459,476,000.000	
	POSCO FUTURE M CO LTD	3,432	160,600.000	551,179,200.000	

HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,543	345,500.000	1,569,606,500.000	
HYUNDAI MOBIS	6,297	486,500.000	3,063,490,500.000	
SK HYNIX INC	58,729	2,673,000.000	156,982,617,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,612	103,300.000	786,319,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,175	214,000.000	465,450,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	14,184	480,500.000	6,815,412,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	26,462	19,660.000	520,242,920.000	
KIA CORPORATION	24,711	135,300.000	3,343,398,300.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,756	37,100.000	1,029,747,600.000	
KOREAN AIR CO LTD	22,115	28,050.000	620,325,750.000	
HLB INC	12,328	47,700.000	588,045,600.000	
LG ELECTRONICS INC	11,318	195,900.000	2,217,196,200.000	
LG CORP	9,665	98,600.000	952,969,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,334	27,700.000	369,351,800.000	
NAVER CORP	15,075	196,400.000	2,960,730,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,489	200,000.000	897,800,000.000	
DOOSAN CORP	789	1,442,000.000	1,137,738,000.000	
POSCO HOLDINGS INC	7,489	305,000.000	2,284,145,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	6,364	455,000.000	2,895,620,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	5,961	1,993,000.000	11,880,273,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	497,330	339,500.000	168,843,535,000.000	
SAMYANG FOODS CO LTD	432	1,111,000.000	479,952,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	71,710	23,000.000	1,649,330,000.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,519	1,011,000.000	3,557,709,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	85,260	220,500.000	18,799,830,000.000	
YUHAN CORP	5,429	66,400.000	360,485,600.000	
LG DISPLAY CO LTD	31,713	11,370.000	360,576,810.000	
CELLTRION INC	16,188	165,900.000	2,685,589,200.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	4,352	257,500.000	1,120,640,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	29,048	109,700.000	3,186,565,600.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	3,831	180,400.000	691,112,400.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,431	432,500.000	3,646,407,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,716	97,000.000	263,452,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	7,298	89,500.000	653,171,000.000	
ECOPRO CO LTD	10,993	95,400.000	1,048,732,200.000	
SK INC	3,768	815,000.000	3,070,920,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	37,811	149,300.000	5,645,182,300.000	

	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,220	141,600.000	1,022,352,000.000	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,283	100,600.000	833,269,800.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,041	62,000.000	436,542,000.000	
	HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SYSTEM CO LTD	2,470	883,000.000	2,181,010,000.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	4,410	192,700.000	849,807,000.000	
	HYOSUNG HEAVY INDUSTRIES CORP	544	3,103,000.000	1,688,032,000.000	
	HYUNDAI ROTEM CO LTD	7,456	169,800.000	1,266,028,800.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	67,700	28,350.000	1,919,295,000.000	
	ECOPRO BM CO LTD	5,815	133,700.000	777,465,500.000	
	HANWHA SYSTEMS CO LTD	8,286	73,600.000	609,849,600.000	
	KRAFTON INC	3,094	204,000.000	631,176,000.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	3,332	564,000.000	1,879,248,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	9,825	1,720,000.000	16,899,000,000.000	
	HYBE CO LTD	2,400	177,800.000	426,720,000.000	
	APR CORP/KOREA	2,455	363,000.000	891,165,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	5,032	331,500.000	1,668,108,000.000	
	KAKAObANK CORP	16,051	19,750.000	317,007,250.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	4,086	189,900.000	775,931,400.000	
	ALTEOGEN INC	4,112	343,500.000	1,412,472,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,652	494,500.000	4,278,414,000.000	
	SAMSUNG EPISHOLDINGS CO LTD	740	426,500.000	315,610,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,243	1,343,000.000	1,669,349,000.000	
	LIG DEFENSE&AEROSPACE CO LTD	1,300	735,000.000	955,500,000.000	
韓国・ウォン 小計		1,532,937		483,189,421,880.000 (50,781,275,482)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	106,000	31.260	3,313,560.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	124,000	16.900	2,095,600.000	
	BEIJING ENTERPRISES	47,000	27.340	1,284,980.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	396,000	5.390	2,134,440.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	556,000	3.070	1,706,920.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	306,700	11.470	3,517,849.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	77,500	21.820	1,691,050.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	829,600	6.690	5,550,024.000	

CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	421,120	12.170	5,125,030.400	
CHINA RESOURCES LAND LTD	315,888	30.160	9,527,182.080	
CITIC LTD	462,000	11.780	5,442,360.000	
LENOVO GROUP LTD	824,000	23.440	19,314,560.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,266,000	8.780	19,895,480.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	145,990	18.400	2,686,216.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,427,200	4.070	9,878,704.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	282,000	5.680	1,601,760.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	78,600	40.980	3,221,028.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	438,000	6.450	2,825,100.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	122,000	12.710	1,550,620.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	390,000	7.640	2,979,600.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	259,600	5.650	1,466,740.000	
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	695,000	17.060	11,856,700.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	89,800	14.790	1,328,142.000	
BYD CO LTD	393,500	72.650	28,587,775.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	6.270	1,003,200.000	
MMG LTD	456,000	6.770	3,087,120.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	12,500	121.800	1,522,500.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	741,788	14.360	10,652,075.680	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	205,200	17.230	3,535,596.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	222,000	9.090	2,017,980.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	793,000	26.920	21,347,560.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	619,000	27.460	16,997,740.000	
WEICHAI POWER CO LTD	205,440	35.960	7,387,622.400	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	146,000	16.830	2,457,180.000	
TINGYI HOLDING CORP	220,000	9.670	2,127,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	62,000	45.580	2,825,960.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	270,000	7.830	2,114,100.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	179,833	21.400	3,848,426.200	

SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,083,250	4.260	4,614,645.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	306,000	16.650	5,094,900.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	655,100	411.800	269,770,180.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	697,500	50.550	35,258,625.000	
LI NING CO LTD	241,500	14.920	3,603,180.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	416,000	2.720	1,131,520.000	
ZTE CORP	75,488	22.800	1,721,126.400	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	355,500	40.620	14,440,410.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	255,750	13.160	3,365,670.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	862,205	6.970	6,009,568.850	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	82,000	43.020	3,527,640.000	
BAIDU INC	225,250	98.750	22,243,437.500	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,943,530	8.260	73,873,557.800	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	92,000	40.260	3,703,920.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	416,000	5.710	2,375,360.000	
BANK OF CHINA LTD	7,189,200	5.060	36,377,352.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	401,470	44.700	17,945,709.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,956,235	6.620	46,050,275.700	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	173,500	16.640	2,887,040.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	108,000	98.550	10,643,400.000	
CHINA COAL ENERGY CO	192,000	10.060	1,931,520.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	80,000	18.790	1,503,200.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	45,600	37.480	1,709,088.000	
CMOC GROUP LIMITED	387,000	15.220	5,890,140.000	
CHINA CITIC BANK-H	869,800	6.800	5,914,640.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	68,800	60.900	4,189,920.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	134,800	68.750	9,267,500.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	462,000	3.950	1,824,900.000	
KINGSOFT CORP LTD	99,200	21.380	2,120,896.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,537,000	0.680	1,725,160.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	93,000	39.540	3,677,220.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	436,000	3.350	1,460,600.000	

BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	81,500	21.240	1,731,060.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	547,000	3.800	2,078,600.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	286,800	27.000	7,743,600.000	
CRRC CORP LTD - H	400,000	4.550	1,820,000.000	
SINOPHARM GROUP CO	136,000	15.790	2,147,440.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	346,000	20.140	6,968,440.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	232,000	5.960	1,382,720.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	234,000	5.290	1,237,860.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	207,400	11.290	2,341,546.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	220,000	6.030	1,326,600.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	96,000	46.380	4,452,480.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	3.210	2,016,380.760	
CHINA GOLD INTERNATIONAL RESOURCES CORP LTD	24,500	116.100	2,844,450.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,876,000	5.330	15,329,080.000	
FAR EAST HORIZON LTD	243,000	5.120	1,244,160.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	163,000	26.560	4,329,280.000	
CHINA NONFERROUS MINING CORP LTD	137,000	11.490	1,574,130.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	1,000,000	4.700	4,700,000.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	336,000	7.210	2,422,560.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD	205,352	14.310	2,938,587.120	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	875,000	4.770	4,173,750.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	146,000	11.790	1,721,340.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	99,750	17.250	1,720,687.500	
CHINA TOWER CORP LTD	494,000	8.920	4,406,480.000	
XIAOMI CORP	1,827,800	21.420	39,151,476.000	
BEONE MEDICINES LTD	86,700	165.900	14,383,530.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	45,112	145.400	6,559,284.800	

MEITUAN	538,110	64.250	34,573,567.500	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	122,800	12.270	1,506,756.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	157,000	10.870	1,706,590.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	486,000	2.000	972,000.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	149,500	75.150	11,234,925.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	49,000	33.560	1,644,440.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	130,000	28.660	3,725,800.000	
CHINA FEIHE LTD	407,000	2.840	1,155,880.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,781,168	89.500	159,414,536.000	
JD.COM INC	241,735	96.000	23,206,560.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	186,000	7.120	1,324,320.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	270,800	40.880	11,070,304.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	252,600	19.700	4,976,220.000	
BILIBILI INC	27,800	124.700	3,466,660.000	
AKESO INC	69,000	83.300	5,747,700.000	
NETEASE INC	187,000	187.500	35,062,500.000	
REMEGEN CO LTD	19,000	69.650	1,323,350.000	
PONY AI INC	18,900	52.300	988,470.000	
GDS HOLDINGS LTD	110,100	27.860	3,067,386.000	
NONGFU SPRING CO LTD	198,600	42.540	8,448,444.000	
LI AUTO INC	132,400	46.280	6,127,472.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	110,650	31.980	3,538,587.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	75,800	36.960	2,801,568.000	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	41,800	170.300	7,118,540.000	
YUM CHINA HOLDINGS INC	36,250	316.200	11,462,250.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	134,300	34.700	4,660,210.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	52,800	158.500	8,368,800.000	
KE HOLDINGS INC	210,600	35.940	7,568,964.000	
JD LOGISTICS INC	189,500	11.570	2,192,515.000	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	42,400	25.800	1,093,920.000	
TRIP.COM GROUP LTD	62,850	305.200	19,181,820.000	
XPENG INC	135,200	45.580	6,162,416.000	
SENSETIME GROUP INC	3,072,000	1.280	3,932,160.000	
NIO INC	188,720	37.120	7,005,286.400	
SICHUAN KELUN-BIOTECH BIOPHARMACEUTICAL CO LTD	5,300	418.000	2,215,400.000	

	MIDEA GROUP CO LTD	42,500	80.350	3,414,875.000	
	WUXI XDC CAYMAN INC	37,500	55.000	2,062,500.000	
	MINISO GROUP HOLDING LTD	49,000	21.760	1,066,240.000	
	XTALPI HOLDINGS LTD	176,000	6.750	1,188,000.000	
	UBTECH ROBOTICS CORP LTD	20,550	90.050	1,850,527.500	
	HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR LTD	77,000	189.500	14,591,500.000	
	J&T GLOBAL EXPRESS LTD	229,400	8.450	1,938,430.000	
	HORIZON ROBOTICS INC	514,200	3.610	1,856,262.000	
	LAOPU GOLD CO LTD	4,500	371.000	1,669,500.000	
	CGN POWER CO LTD	1,071,000	2.710	2,902,410.000	
	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND CABLE JOINT STOCK LTD CO	39,000	250.600	9,773,400.000	
	ZIJIN GOLD INTERNATIONAL CO LTD	37,400	93.750	3,506,250.000	
	CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	18,900	680.500	12,861,450.000	
	HESAI GROUP	11,480	114.900	1,319,052.000	
	GF SECURITIES CO LTD	111,400	16.430	1,830,302.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	68,800	49.920	3,434,496.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	136,000	16.500	2,244,000.000	
	3SBIO INC	208,500	15.910	3,317,235.000	
	BOC AVIATION LTD	25,000	80.250	2,006,250.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	9.400	1,165,600.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	174,400	19.920	3,474,048.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	377,500	33.040	12,472,600.000	
	HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	1,180,000	1.350	1,593,000.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	50,400	48.900	2,464,560.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	82,000	12.850	1,053,700.000	
香港・ドル 小計		79,329,120		1,481,206,208.590 (30,542,472,021)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	53,826	2,380.000	128,105,880.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	69,258	701.000	48,549,858.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	52,966	740.000	39,194,840.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	710,401	17.750	12,609,617.750	
	GOLD CIRCUIT ELECTRONICS LTD	34,954	1,190.000	41,595,260.000	

VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	131,262	202.000	26,514,924.000	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	55,350	319.500	17,684,325.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	142,637	975.000	139,071,075.000	
QUANTA COMPUTER INC	288,078	362.000	104,284,236.000	
EVA AIRWAYS CORP	270,721	43.800	11,857,579.800	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	774,279	23.400	18,118,128.600	
CHINA STEEL CORP	1,259,775	19.000	23,935,725.000	
ADVANTECH CO LTD	51,304	455.500	23,368,972.000	
CHROMA ATE INC	38,774	2,035.000	78,905,090.000	
DELTA ELECTRONICS INC	207,178	1,810.000	374,992,180.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	406,096	143.000	58,071,728.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	185,636	118.500	21,997,866.000	
ELITE MATERIAL CO LTD	30,511	5,255.000	160,335,305.000	
EVERGREEN MARINE CORP	118,157	181.000	21,386,417.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	57,522	509.000	29,278,698.000	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	14,657	780.000	11,432,460.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	397,769	52.200	20,763,541.800	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	370,722	54.200	20,093,132.400	
KING YUAN ELECTRONICS CO LTD	112,907	308.000	34,775,356.000	
MEDIATEK INC	153,521	3,880.000	595,661,480.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	890,051	134.000	119,266,834.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	971,000	36.900	35,829,900.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	33,668	481.000	16,194,308.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	195,577	107.000	20,926,739.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,131,543	66.300	75,021,300.900	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,012,658	106.000	107,341,748.000	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,607,982	29.900	48,078,661.800	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,519,808	34.550	52,509,366.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,299,889	248.500	323,022,416.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,218,878	46.150	56,251,219.700	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,349	4,720.000	48,847,280.000	
TS FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,251,617	31.900	71,826,582.300	

INVENTEC CO LTD	250,778	63.300	15,874,247.400	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	211,545	201.500	42,626,317.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,267,856	39.150	49,636,562.400	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,788,777	70.300	125,751,023.100	
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	34,472	2,255.000	77,734,360.000	
MPI CORP	9,017	6,500.000	58,610,500.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,203,362	32.650	39,289,769.300	
NAN YA PLASTICS CORP	502,923	148.000	74,432,604.000	
WISTRON CORP	321,533	153.000	49,194,549.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	503,007	74.600	37,524,322.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,940	223.000	12,697,620.000	
E INK HOLDINGS INC	83,129	195.000	16,210,155.000	
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM CO LTD	24,417	745.000	18,190,665.000	
TCC GROUP HOLDINGS	675,532	24.150	16,314,097.800	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,619,396	2,340.000	6,129,386,640.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,206,610	164.000	197,884,040.000	
WAN HAI LINES LTD	63,482	76.700	4,869,069.400	
YAGEO CORP	165,584	1,015.000	168,067,760.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	206,015	50.100	10,321,351.500	
KING SLIDE WORKS CO LTD	6,097	6,990.000	42,618,030.000	
GLOBAL UNICHIP CORP	9,196	4,420.000	40,646,320.000	
INNOLUX CORPORATION	784,074	65.000	50,964,810.000	
LOTES CO LTD	8,806	2,105.000	18,536,630.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,837	2,925.000	19,998,225.000	
JENTECH PRECISION INDUSTRIAL CO LTD	9,423	3,405.000	32,085,315.000	
PEGATRON CORP	219,164	81.000	17,752,284.000	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	7,967	3,870.000	30,832,290.000	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,474	1,360.000	19,684,640.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	155,328	113.500	17,629,728.000	
BIZLINK HOLDING INC	18,806	1,855.000	34,885,130.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	79,150	580.000	45,907,000.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,205,605	24.700	29,778,443.500	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	425,231	42.400	18,029,794.400	
ASPEED TECHNOLOGY INC	3,177	15,615.000	49,608,855.000	

	WIWYNN CORP	10,950	4,280.000	46,866,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	355,086	632.000	224,414,352.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	28,915	1,155.000	33,396,825.000	
	CALIWAY BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	95,155	98.100	9,334,705.500	
	GLOBALWAFERS CO LTD	28,482	936.000	26,659,152.000	
	HON PRECISION INC	8,481	6,500.000	55,126,500.000	
台湾・ドル 小計		32,806,060		11,047,070,714.950 (56,049,522,683)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	32,012	238.140	7,623,337.680	
	CLICKS GROUP LTD	26,121	221.000	5,772,741.000	
	DISCOVERY LTD	57,591	281.000	16,183,071.000	
	GOLD FIELDS LTD	95,778	551.690	52,839,764.820	
	REMGRO LTD	55,901	193.290	10,805,104.290	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	58,146	258.490	15,030,159.540	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,155	4,675.150	42,800,998.250	
	MTN GROUP LTD	185,699	225.970	41,962,403.030	
	FIRSTRAND LTD	536,179	95.520	51,215,818.080	
	NASPERS LTD	81,598	799.530	65,240,048.940	
	NEDBANK GROUP LTD	47,000	270.310	12,704,570.000	
	VALTERRA PLATINUM LIMITED	28,554	1,136.930	32,463,899.220	
	SASOL LTD	59,212	159.880	9,466,814.560	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	50,878	293.970	14,956,605.660	
	STANDARD BANK GROUP LTD	139,430	318.080	44,349,894.400	
	ABSA GROUP LTD	91,225	242.240	22,098,344.000	
	SANLAM LTD	186,989	86.810	16,232,515.090	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	100,431	181.290	18,207,135.990	
	OUTSURANCE GROUP LTD	88,389	76.190	6,734,357.910	
	VODACOM GROUP PTY LTD	66,682	151.000	10,068,982.000	
	NEPI ROCKCASTLE NV	57,465	146.700	8,430,115.500	
	REINET INVESTMENTS SCA	14,066	453.870	6,384,135.420	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	398,857	21.900	8,734,968.300	
	SIBANYE STILLWATER LTD	291,568	36.880	10,753,027.840	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	37,574	245.000	9,205,630.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	54,073	1,341.630	72,545,958.990	
	BID CORP LTD	34,891	437.490	15,264,463.590	
南アフリカ・ランド 小計		2,885,464		628,074,865.100 (6,161,414,427)	
合計		378,552,417		209,433,275,335 (209,433,275,335)	

(2) 株式以外の有価証券

2026年6月29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	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	121,900.000	6,663,054.000	
		ENERGISA SA	31,460.000	1,497,496.000	
		KLABIN SA	79,032.000	1,340,382.720	
	ブラジル・リアル 小計		232,392.000	9,500,932.720 (297,122,669)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,633,475.000	35,185,051.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	59,700.000	11,172,855.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	180,905.000	40,627,644.900	
	メキシコ・ペソ 小計		1,874,080.000	86,985,551.400 (803,842,178)	
投資信託受益証券 合計			2,106,472	1,100,964,847 (1,100,964,847)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	275,500.000	8,171,330.000	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA DE CV	112,105.000	8,423,569.700	
	メキシコ・ペソ 小計		387,605.000	16,594,899.700 (153,355,127)	
投資証券 合計			387,605	153,355,127 (153,355,127)	
合計				1,254,319,974 (1,254,319,974)	

(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 37銘柄	1.63	—	—	1.67
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 16銘柄	1.13	—	—	1.16
インド・ルピー	株式 165銘柄	11.13	—	—	11.41
インドネシア・ルピア	株式 11銘柄	0.45	—	—	0.46
オフショア・人民元	株式 407銘柄	3.59	—	—	3.68
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.47	—	—	0.48
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.51	—	—	0.52
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.14	—	—	0.14
サウジアラビア・リアル	株式 33銘柄	2.39	—	—	2.46
タイ・バーツ	株式 18銘柄	0.91	—	—	0.94

チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.10	—	—	0.11
チリ・ペソ	株式	10銘柄	0.43	—	—	0.45
トルコ・リラ	株式	11銘柄	0.37	—	—	0.38
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.33	—	—	0.34
フィリピン・ペソ	株式	10銘柄	0.28	—	—	0.28
ブラジル・リアル	株式	38銘柄	3.10	—	—	3.32
	投資信託受益証券	3銘柄	—	0.14	—	
ポーランド・ズロチ	株式	16銘柄	0.97	—	—	0.99
マレーシア・リンギット	株式	21銘柄	0.89	—	—	0.91
メキシコ・ペソ	株式	16銘柄	1.20	—	—	1.68
	投資信託受益証券	3銘柄	—	0.37	—	
	投資証券	2銘柄	—	—	0.07	
ユーロ	株式	10銘柄	0.49	—	—	0.51
韓国・ウォン	株式	77銘柄	23.51	—	—	24.10
香港・ドル	株式	159銘柄	14.14	—	—	14.50
台湾・ドル	株式	77銘柄	25.95	—	—	26.60
南アフリカ・ランド	株式	27銘柄	2.85	—	—	2.92

（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)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,454,966,576
国債証券	392,734,251,850
地方債証券	22,551,183,524
特殊債券	16,785,392,489
社債券	14,093,940,000
未収利息	812,298,668
前払費用	108,227,476
流動資産合計	449,540,260,583
資産合計	449,540,260,583
負債の部	
流動負債	
未払金	698,592,000
未払解約金	39,112,000
流動負債合計	737,704,000
負債合計	737,704,000
純資産の部	
元本等	
元本	405,559,815,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	43,242,741,140
元本等合計	448,802,556,583
純資産合計	448,802,556,583
負債純資産合計	449,540,260,583

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29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	2026年6月29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	403,635,565,026円
同期中追加設定元本額	171,239,176,338円
同期中一部解約元本額	169,314,925,921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	40,539,759,972円
たわらノーロード 国内債券	20,651,683,889円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	14,547,451,765円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,308,927,718円
たわらノーロード バランス（標準型）	6,050,366,350円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,092,536,557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）	218,578,772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）	3,258,878,583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）	4,375,282,656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）	1,172,746,357円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	72,581,037円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	35,022,722円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	307,330,394円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	33,426,968円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	46,915,122円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	25,806,163円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	11,716,095,184円
One グローバルバランス	509,979,443円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け）	15,040,631円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け）	5,643,904円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け）	2,515,831円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け）	1,445,260円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1988～1992年生まれ向け）	459,891円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1993～1997年生まれ向け）	130,747円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1998～2002年生まれ向け）	117,487円

未来のわたし（ターゲット・イヤー／２００３～２００７年生まれ向け）	166,951円
D I A M バランス・ファンド＜DC年金＞１安定型	14,814,191,322円
D I A M バランス・ファンド＜DC年金＞２安定・成長型	23,304,110,187円
D I A M バランス・ファンド＜DC年金＞３成長型	12,066,309,690円
D I A M DC バランス３０インデックスファンド	3,051,604,349円
D I A M DC バランス５０インデックスファンド	3,371,263,757円
D I A M DC バランス７０インデックスファンド	789,268,737円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	95,238,660円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	4,079,446,425円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	10,287,537円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国１０）	6,820,594,139円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国２０）	3,609,573,494円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国３０）	837,289,547円
投資のソムリエ	28,513,923,134円
クルーズコントロール	651,213,982円
投資のソムリエ＜DC年金＞	6,283,247,622円
D I A M ８資産バランスファンドN＜DC年金＞	9,866,382,214円
４資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	5,654,606,474円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	12,355,168,466円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	20,328,843,723円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	567,435,511円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	296,801,425円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	139,520,729円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	2,971,692,023円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	11,002,292,614円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,032,447,048円
９資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	8,160,916,901円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	765,194,574円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	352,910,804円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	196,518,372円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	7,657,869,063円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	86,332,820円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	130,283,813円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	3,359,409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）	467,800,814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）	765,352,737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）	1,021,822,386円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	1,987,520,271円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,146,045,363円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	856,486,766円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	873,901,456円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	1,395,891,085円
AMOne収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅠ（適格機関投資家限定）	448,269,680円

AMOne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）	454,215,117円
AMOne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）	452,857,532円
DIAM国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	6,958,475,771円
ハイブリッドストラテジーマルチアセットファンド（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	54,914,882円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	132,613,633円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	248,798,642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）	1,233,462,016円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	20,523,664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）	93,283,382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）	109,295,566円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	23,006,689円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	63,495,494円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	24,897,108円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	538,171円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	1,833,466,796円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,202,594,841円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,844,901,647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）	44,270,517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）	132,138,464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）	908,582,027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）	70,388,067円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	728,837円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	1,014,482,020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）	30,547,679円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	152,746,037円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	229,492,389円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	367,288,945円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	178,537,524円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	51,462,778円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	456,244,779円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	308,148,016円
コア資産形成ファンド	101,254,072円
たわらノーロード 国内債券＜ラップ専用＞	12,382,529,497円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	28,972,025,582円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	30,589,181,754円
計	405,559,815,443円
2. 受益権の総数	405,559,815,443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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△7,254,132,050
地方債証券	△211,454,236
特殊債券	△479,512,822
社債券	△132,914,000
合計	△8,078,013,108

（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（2026年2月17日から2026年6月29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）

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1066円 (11,066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

2026年6月29日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	476回 利付国庫債券（2年）	2,800,000,000	2,789,780,000	
	477回 利付国庫債券（2年）	2,000,000,000	1,994,060,000	
	478回 利付国庫債券（2年）	2,400,000,000	2,391,768,000	
	481回 利付国庫債券（2年）	2,680,000,000	2,678,954,800	
	482回 利付国庫債券（2年）	1,700,000,000	1,698,878,000	
	483回 利付国庫債券（2年）	4,100,000,000	4,102,788,000	
	484回 利付国庫債券（2年）	1,500,000,000	1,500,660,000	
	154回 利付国庫債券（5年）	3,570,000,000	3,522,162,000	
	155回 利付国庫債券（5年）	1,500,000,000	1,478,505,000	
	156回 利付国庫債券（5年）	3,100,000,000	3,051,113,000	
	157回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,666,986,000	
	158回 利付国庫債券（5年）	3,600,000,000	3,524,004,000	
	159回 利付国庫債券（5年）	1,900,000,000	1,852,215,000	
	160回 利付国庫債券（5年）	600,000,000	586,062,000	
	161回 利付国庫債券（5年）	870,000,000	851,460,300	
	162回 利付国庫債券（5年）	2,100,000,000	2,047,941,000	
	163回 利付国庫債券（5年）	3,150,000,000	3,078,715,500	

164回 利付国庫債券（5年）	1,100,000,000	1,066,142,000	
165回 利付国庫債券（5年）	1,200,000,000	1,165,920,000	
166回 利付国庫債券（5年）	1,350,000,000	1,314,886,500	
167回 利付国庫債券（5年）	1,800,000,000	1,746,864,000	
168回 利付国庫債券（5年）	1,260,000,000	1,229,545,800	
169回 利付国庫債券（5年）	1,240,000,000	1,206,792,800	
170回 利付国庫債券（5年）	1,400,000,000	1,361,808,000	
171回 利付国庫債券（5年）	1,700,000,000	1,643,730,000	
172回 利付国庫債券（5年）	2,850,000,000	2,763,759,000	
173回 利付国庫債券（5年）	1,100,000,000	1,065,614,000	
174回 利付国庫債券（5年）	2,200,000,000	2,137,960,000	
175回 利付国庫債券（5年）	1,600,000,000	1,559,792,000	
176回 利付国庫債券（5年）	1,000,000,000	978,320,000	
177回 利付国庫債券（5年）	1,400,000,000	1,374,240,000	
178回 利付国庫債券（5年）	3,900,000,000	3,802,461,000	
179回 利付国庫債券（5年）	2,790,000,000	2,710,261,800	
180回 利付国庫債券（5年）	1,020,000,000	994,816,200	
181回 利付国庫債券（5年）	2,240,000,000	2,195,155,200	
182回 利付国庫債券（5年）	2,340,000,000	2,302,794,000	
183回 利付国庫債券（5年）	3,400,000,000	3,365,558,000	
184回 利付国庫債券（5年）	1,300,000,000	1,295,762,000	
185回 利付国庫債券（5年）	2,700,000,000	2,715,201,000	
1回 利付国庫債券（40年）	110,000,000	89,856,800	
2回 利付国庫債券（40年）	330,000,000	255,944,700	
3回 利付国庫債券（40年）	540,000,000	413,386,200	
4回 利付国庫債券（40年）	720,000,000	539,784,000	
5回 利付国庫債券（40年）	710,000,000	500,173,700	
6回 利付国庫債券（40年）	940,000,000	638,833,400	
7回 利付国庫債券（40年）	1,030,000,000	658,036,100	

8回 利付国庫債券（４０年）	890,000,000	516,814,100	
9回 利付国庫債券（４０年）	1,800,000,000	727,884,000	
10回 利付国庫債券（４０年）	1,430,000,000	693,306,900	
11回 利付国庫債券（４０年）	1,180,000,000	544,050,800	
12回 利付国庫債券（４０年）	1,420,000,000	566,665,200	
13回 利付国庫債券（４０年）	1,820,000,000	719,955,600	
14回 利付国庫債券（４０年）	1,720,000,000	730,019,600	
15回 利付国庫債券（４０年）	1,870,000,000	879,386,200	
16回 利付国庫債券（４０年）	2,270,000,000	1,178,674,800	
17回 利付国庫債券（４０年）	1,900,000,000	1,306,250,000	
18回 利付国庫債券（４０年）	1,400,000,000	1,213,184,000	
1回 CT利付国庫債券（１０年）	500,000,000	445,565,000	
2回 CT利付国庫債券（１０年）	500,000,000	453,220,000	
348回 利付国庫債券（１０年）	4,370,000,000	4,311,442,000	
349回 利付国庫債券（１０年）	3,050,000,000	2,997,479,000	
350回 利付国庫債券（１０年）	5,660,000,000	5,540,517,400	
351回 利付国庫債券（１０年）	4,400,000,000	4,289,340,000	
352回 利付国庫債券（１０年）	3,370,000,000	3,272,303,700	
353回 利付国庫債券（１０年）	3,690,000,000	3,568,008,600	
354回 利付国庫債券（１０年）	4,460,000,000	4,293,954,200	
355回 利付国庫債券（１０年）	3,340,000,000	3,200,989,200	
356回 利付国庫債券（１０年）	3,400,000,000	3,241,118,000	
357回 利付国庫債券（１０年）	3,300,000,000	3,128,829,000	
358回 利付国庫債券（１０年）	3,150,000,000	2,969,977,500	
359回 利付国庫債券（１０年）	3,850,000,000	3,608,682,000	
360回 利付国庫債券（１０年）	3,800,000,000	3,540,802,000	

361回 利付国庫債券（10年）	3,900,000,000	3,611,244,000	
362回 利付国庫債券（10年）	3,770,000,000	3,469,983,400	
363回 利付国庫債券（10年）	3,770,000,000	3,449,927,000	
364回 利付国庫債券（10年）	3,910,000,000	3,554,346,400	
365回 利付国庫債券（10年）	4,090,000,000	3,693,801,700	
366回 利付国庫債券（10年）	4,380,000,000	3,952,950,000	
367回 利付国庫債券（10年）	4,450,000,000	3,989,647,500	
368回 利付国庫債券（10年）	4,750,000,000	4,229,875,000	
369回 利付国庫債券（10年）	6,220,000,000	5,615,975,800	
370回 利付国庫債券（10年）	5,430,000,000	4,873,805,100	
371回 利付国庫債券（10年）	5,450,000,000	4,820,525,000	
372回 利付国庫債券（10年）	4,500,000,000	4,069,215,000	
373回 利付国庫債券（10年）	4,060,000,000	3,592,288,000	
374回 利付国庫債券（10年）	4,290,000,000	3,830,412,300	
375回 利付国庫債券（10年）	3,890,000,000	3,534,998,600	
376回 利付国庫債券（10年）	3,820,000,000	3,393,764,400	
377回 利付国庫債券（10年）	4,100,000,000	3,711,689,000	
378回 利付国庫債券（10年）	4,370,000,000	4,002,876,300	
379回 利付国庫債券（10年）	4,120,000,000	3,787,516,000	
380回 利付国庫債券（10年）	4,200,000,000	3,910,032,000	
381回 利付国庫債券（10年）	4,200,000,000	4,032,672,000	
382回 利付国庫債券（10年）	3,700,000,000	3,634,103,000	
1回 利付国庫債券（30年）	110,000,000	114,134,900	
2回 利付国庫債券（30年）	100,000,000	102,542,000	
4回 利付国庫債券（30年）	200,000,000	209,124,000	
6回 利付国庫債券（30年）	200,000,000	204,440,000	
11回 利付国庫債券（30年）	250,000,000	242,077,500	

12回 利付国庫債券（30年）	230,000,000	227,854,100	
13回 利付国庫債券（30年）	650,000,000	637,357,500	
14回 利付国庫債券（30年）	340,000,000	341,778,200	
15回 利付国庫債券（30年）	260,000,000	262,618,200	
16回 利付国庫債券（30年）	240,000,000	241,730,400	
17回 利付国庫債券（30年）	270,000,000	269,052,300	
18回 利付国庫債券（30年）	400,000,000	394,552,000	
19回 利付国庫債券（30年）	280,000,000	275,290,400	
20回 利付国庫債券（30年）	330,000,000	328,765,800	
21回 利付国庫債券（30年）	310,000,000	302,814,200	
22回 利付国庫債券（30年）	290,000,000	287,303,000	
23回 利付国庫債券（30年）	350,000,000	345,856,000	
25回 利付国庫債券（30年）	330,000,000	318,050,700	
26回 利付国庫債券（30年）	620,000,000	601,034,200	
27回 利付国庫債券（30年）	620,000,000	602,311,400	
28回 利付国庫債券（30年）	770,000,000	742,726,600	
29回 利付国庫債券（30年）	860,000,000	814,205,000	
30回 利付国庫債券（30年）	880,000,000	816,886,400	
31回 利付国庫債券（30年）	720,000,000	654,609,600	
32回 利付国庫債券（30年）	970,000,000	884,649,700	
33回 利付国庫債券（30年）	1,180,000,000	1,027,520,400	
34回 利付国庫債券（30年）	1,200,000,000	1,062,900,000	
35回 利付国庫債券（30年）	1,060,000,000	905,674,600	
36回 利付国庫債券（30年）	1,370,000,000	1,159,252,900	
37回 利付国庫債券（30年）	1,360,000,000	1,122,612,000	

38回 利付国庫債券（30年）	850,000,000	683,876,000	
39回 利付国庫債券（30年）	1,110,000,000	902,629,800	
40回 利付国庫債券（30年）	530,000,000	421,842,900	
41回 利付国庫債券（30年）	1,060,000,000	825,369,000	
42回 利付国庫債券（30年）	1,000,000,000	774,330,000	
43回 利付国庫債券（30年）	810,000,000	623,351,700	
44回 利付国庫債券（30年）	1,130,000,000	865,161,900	
45回 利付国庫債券（30年）	1,250,000,000	918,500,000	
46回 利付国庫債券（30年）	540,000,000	394,426,800	
47回 利付国庫債券（30年）	1,340,000,000	992,028,800	
48回 利付国庫債券（30年）	1,470,000,000	1,041,612,600	
49回 利付国庫債券（30年）	1,300,000,000	915,460,000	
50回 利付国庫債券（30年）	1,250,000,000	769,162,500	
51回 利付国庫債券（30年）	1,620,000,000	873,520,200	
52回 利付国庫債券（30年）	1,350,000,000	759,334,500	
53回 利付国庫債券（30年）	1,120,000,000	640,539,200	
54回 利付国庫債券（30年）	1,300,000,000	774,683,000	
55回 利付国庫債券（30年）	1,280,000,000	756,352,000	
56回 利付国庫債券（30年）	1,540,000,000	902,794,200	
57回 利付国庫債券（30年）	1,130,000,000	657,241,900	
58回 利付国庫債券（30年）	1,110,000,000	640,236,900	
59回 利付国庫債券（30年）	900,000,000	501,372,000	
60回 利付国庫債券（30年）	630,000,000	367,371,900	
61回 利付国庫債券（30年）	960,000,000	526,771,200	
62回 利付国庫債券（30年）	1,570,000,000	806,917,200	

63回 利付国庫債券（30年）	1,050,000,000	518,616,000	
64回 利付国庫債券（30年）	900,000,000	440,442,000	
65回 利付国庫債券（30年）	800,000,000	387,728,000	
66回 利付国庫債券（30年）	890,000,000	427,208,900	
67回 利付国庫債券（30年）	1,360,000,000	688,758,400	
68回 利付国庫債券（30年）	1,540,000,000	772,695,000	
69回 利付国庫債券（30年）	1,260,000,000	646,606,800	
70回 利付国庫債券（30年）	1,400,000,000	712,012,000	
71回 利付国庫債券（30年）	1,230,000,000	619,895,400	
72回 利付国庫債券（30年）	1,190,000,000	594,321,700	
73回 利付国庫債券（30年）	1,290,000,000	638,820,900	
74回 利付国庫債券（30年）	1,170,000,000	632,759,400	
75回 利付国庫債券（30年）	1,340,000,000	786,888,200	
76回 利付国庫債券（30年）	1,420,000,000	853,519,400	
77回 利付国庫債券（30年）	1,130,000,000	713,821,000	
78回 利付国庫債券（30年）	1,610,000,000	960,204,000	
79回 利付国庫債券（30年）	1,440,000,000	807,393,600	
80回 利付国庫債券（30年）	1,180,000,000	777,336,800	
81回 利付国庫債券（30年）	1,600,000,000	996,880,000	
82回 利付国庫債券（30年）	1,550,000,000	1,015,017,500	
83回 利付国庫債券（30年）	1,300,000,000	937,846,000	
84回 利付国庫債券（30年）	1,330,000,000	934,870,300	
85回 利付国庫債券（30年）	1,400,000,000	1,031,016,000	
86回 利付国庫債券（30年）	1,420,000,000	1,069,856,400	
87回 利付国庫債券（30年）	1,000,000,000	822,400,000	

88回 利付国庫債券（30年）	930,000,000	829,746,000	
89回 利付国庫債券（30年）	920,000,000	853,410,400	
90回 利付国庫債券（30年）	900,000,000	883,737,000	
97回 利付国庫債券（20年）	660,000,000	667,959,600	
98回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	161,737,600	
99回 利付国庫債券（20年）	750,000,000	758,895,000	
100回 利付国庫債券（20年）	830,000,000	842,068,200	
101回 利付国庫債券（20年）	230,000,000	234,119,300	
102回 利付国庫債券（20年）	500,000,000	509,695,000	
103回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	162,795,200	
104回 利付国庫債券（20年）	110,000,000	111,499,300	
105回 利付国庫債券（20年）	640,000,000	649,241,600	
106回 利付国庫債券（20年）	500,000,000	508,300,000	
107回 利付国庫債券（20年）	600,000,000	609,096,000	
108回 利付国庫債券（20年）	690,000,000	697,162,200	
109回 利付国庫債券（20年）	350,000,000	353,612,000	
110回 利付国庫債券（20年）	440,000,000	446,899,200	
111回 利付国庫債券（20年）	460,000,000	468,763,000	
112回 利付国庫債券（20年）	740,000,000	751,884,400	
113回 利付国庫債券（20年）	2,270,000,000	2,306,206,500	
116回 利付国庫債券（20年）	530,000,000	539,741,400	
117回 利付国庫債券（20年）	1,870,000,000	1,897,489,000	
118回 利付国庫債券（20年）	955,000,000	964,578,650	
119回 利付国庫債券（20年）	470,000,000	471,132,700	
120回 利付国庫債券（20年）	500,000,000	497,395,000	

121回 利付国庫債券（20年）	1,040,000,000	1,044,898,400	
122回 利付国庫債券（20年）	870,000,000	870,504,600	
123回 利付国庫債券（20年）	1,450,000,000	1,466,791,000	
125回 利付国庫債券（20年）	900,000,000	913,473,000	
126回 利付国庫債券（20年）	910,000,000	915,523,700	
127回 利付国庫債券（20年）	840,000,000	841,268,400	
128回 利付国庫債券（20年）	200,000,000	200,044,000	
130回 利付国庫債券（20年）	1,110,000,000	1,102,884,900	
131回 利付国庫債券（20年）	1,100,000,000	1,087,471,000	
132回 利付国庫債券（20年）	530,000,000	522,537,600	
133回 利付国庫債券（20年）	130,000,000	128,844,300	
134回 利付国庫債券（20年）	900,000,000	889,839,000	
135回 利付国庫債券（20年）	130,000,000	127,832,900	
136回 利付国庫債券（20年）	560,000,000	547,657,600	
137回 利付国庫債券（20年）	480,000,000	470,683,200	
138回 利付国庫債券（20年）	1,060,000,000	1,027,606,400	
139回 利付国庫債券（20年）	680,000,000	663,006,800	
140回 利付国庫債券（20年）	950,000,000	928,824,500	
141回 利付国庫債券（20年）	1,560,000,000	1,521,390,000	
142回 利付国庫債券（20年）	730,000,000	716,290,600	
143回 利付国庫債券（20年）	2,130,000,000	2,057,580,000	
144回 利付国庫債券（20年）	1,050,000,000	1,007,842,500	
145回 利付国庫債券（20年）	1,950,000,000	1,888,204,500	
146回 利付国庫債券（20年）	2,040,000,000	1,966,600,800	
147回 利付国庫債券（20年）	2,290,000,000	2,182,873,800	

148回 利付国庫債券（20年）	1,730,000,000	1,629,642,700	
149回 利付国庫債券（20年）	1,490,000,000	1,396,979,300	
150回 利付国庫債券（20年）	2,230,000,000	2,064,043,400	
151回 利付国庫債券（20年）	660,000,000	597,491,400	
152回 利付国庫債券（20年）	1,640,000,000	1,476,770,800	
153回 利付国庫債券（20年）	2,660,000,000	2,403,150,400	
154回 利付国庫債券（20年）	2,420,000,000	2,154,284,000	
155回 利付国庫債券（20年）	2,480,000,000	2,152,987,200	
156回 利付国庫債券（20年）	1,680,000,000	1,363,572,000	
157回 利付国庫債券（20年）	1,680,000,000	1,322,966,400	
158回 利付国庫債券（20年）	1,990,000,000	1,605,750,900	
159回 利付国庫債券（20年）	2,040,000,000	1,651,114,800	
160回 利付国庫債券（20年）	1,820,000,000	1,478,040,200	
161回 利付国庫債券（20年）	1,860,000,000	1,481,080,800	
162回 利付国庫債券（20年）	1,830,000,000	1,444,821,600	
163回 利付国庫債券（20年）	2,330,000,000	1,823,854,100	
164回 利付国庫債券（20年）	2,470,000,000	1,891,871,800	
165回 利付国庫債券（20年）	1,870,000,000	1,418,806,400	
166回 利付国庫債券（20年）	1,860,000,000	1,436,236,200	
167回 利付国庫債券（20年）	1,950,000,000	1,452,750,000	
168回 利付国庫債券（20年）	2,120,000,000	1,542,893,600	
169回 利付国庫債券（20年）	2,020,000,000	1,434,321,200	
170回 利付国庫債券（20年）	1,800,000,000	1,265,544,000	
171回 利付国庫債券（20年）	1,820,000,000	1,267,011,200	
172回 利付国庫債券（20年）	1,810,000,000	1,268,140,300	

	173回 利付国庫債券（20年）	2,060,000,000	1,429,887,200	
	174回 利付国庫債券（20年）	2,440,000,000	1,677,841,600	
	175回 利付国庫債券（20年）	2,270,000,000	1,572,678,700	
	176回 利付国庫債券（20年）	1,780,000,000	1,222,593,000	
	177回 利付国庫債券（20年）	2,760,000,000	1,845,970,800	
	178回 利付国庫債券（20年）	1,700,000,000	1,146,752,000	
	179回 利付国庫債券（20年）	1,890,000,000	1,263,162,600	
	180回 利付国庫債券（20年）	1,910,000,000	1,335,567,500	
	181回 利付国庫債券（20年）	2,230,000,000	1,574,669,900	
	182回 利付国庫債券（20年）	2,050,000,000	1,487,746,500	
	183回 利付国庫債券（20年）	1,900,000,000	1,440,922,000	
	184回 利付国庫債券（20年）	1,780,000,000	1,273,643,400	
	185回 利付国庫債券（20年）	2,050,000,000	1,456,361,000	
	186回 利付国庫債券（20年）	2,120,000,000	1,604,861,200	
	187回 利付国庫債券（20年）	1,740,000,000	1,263,953,400	
	188回 利付国庫債券（20年）	1,750,000,000	1,331,715,000	
	189回 利付国庫債券（20年）	1,500,000,000	1,194,360,000	
	190回 利付国庫債券（20年）	1,630,000,000	1,270,079,700	
	191回 利付国庫債券（20年）	1,350,000,000	1,083,294,000	
	192回 利付国庫債券（20年）	1,600,000,000	1,365,424,000	
	193回 利付国庫債券（20年）	1,100,000,000	950,730,000	
	194回 利付国庫債券（20年）	1,170,000,000	1,040,305,500	
	195回 利付国庫債券（20年）	1,460,000,000	1,396,329,400	
	196回 利付国庫債券（20年）	1,000,000,000	982,600,000	
国債証券 合計		459,405,000,000	392,734,251,850	
地方債証券	783回 東京都公募公債	110,000,000	107,234,600	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	189,582,000	

802回 東京都公募公債	400,000,000	375,908,000	
806回 東京都公募公債	100,000,000	93,314,000	
813回 東京都公募公債	300,000,000	277,323,000	
816回 東京都公募公債	100,000,000	91,417,000	
866回 東京都公募公債	300,000,000	276,918,000	
1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	198,092,000	
14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	80,969,000	
18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	101,576,000	
21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	101,438,000	
31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	180,250,000	
33回 東京都公募公債 20年	100,000,000	77,185,000	
30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	388,936,000	
30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	386,312,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	91,852,000	
36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	231,505,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	192,950,000	
243回 神奈川県公募公債 10年	100,000,000	94,337,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	183,898,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	268,125,000	
3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	97,103,000	
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	101,207,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	301,572,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	98,336,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	183,462,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	183,138,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	182,002,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	180,344,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	269,601,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	193,890,000	

13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	87,613,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	79,646,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	107,008,924	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	375,384,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	184,134,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	189,248,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	91,631,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	89,727,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	298,965,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	98,078,000	
15年度11回 兵庫県公募公債	200,000,000	191,696,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	99,380,000	
10回 兵庫県公募公債 20年	100,000,000	101,556,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	189,642,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	92,838,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	183,390,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	99,647,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	192,246,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	304,977,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	301,809,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	82,995,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	186,108,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	107,112,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	191,912,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	138,702,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	97,140,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	184,076,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	58,168,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	67,616,000	

令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	188,576,000	
令和3年度第4回 埼玉県公募公債	100,000,000	91,167,000	
令和3年度第8回 埼玉県公募公債	100,000,000	90,114,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	119,414,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	140,826,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	101,146,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	95,293,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	279,372,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	88,689,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	193,252,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	190,554,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	92,624,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	99,907,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	94,360,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	101,108,000	
21年度2回 福岡県公募公債（20年）	100,000,000	101,522,000	
24年度2回 福岡県公募公債（20年）	300,000,000	289,755,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	180,430,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	92,567,000	
16回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	93,291,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	88,135,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	78,252,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	183,510,000	
令和3年1回 茨城県公募公債	100,000,000	91,021,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	92,781,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	394,920,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,526,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,134,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	490,100,000	

189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,625,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	286,959,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	475,855,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	93,997,000	
221回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	90,265,000	
222回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	270,786,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	449,340,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	447,220,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	96,621,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	184,796,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	197,094,000	
令和2年 2回 大阪市公募公債	300,000,000	280,797,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	202,978,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	187,470,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	92,767,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	88,387,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	201,668,000	
24年度3回 神戸市公募公債	100,000,000	96,615,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	193,266,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	291,471,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	95,600,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	378,672,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	98,763,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	101,155,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	92,879,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	84,345,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	231,777,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	194,016,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	203,160,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	83,511,000	

	6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	101,060,000	
	11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	299,550,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	92,773,000	
	22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	88,035,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	150,484,000	
	2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	68,800,000	
	29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	155,322,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	294,012,000	
	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	75,518,000	
	令和3年 4回 千葉市公募公債	100,000,000	89,755,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	188,862,000	
	19回 さいたま市公募公債	100,000,000	89,706,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	184,796,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	192,088,000	
地方債証券 合計		24,719,330,000	22,551,183,524	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	197,652,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	195,200,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	337,315,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	48,544,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	358,268,000	
	64回 政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	93,271,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	269,406,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	125,571,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	193,392,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	251,439,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	215,655,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,106,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	93,194,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	88,818,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	71,364,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	61,211,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	64,918,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	155,594,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	75,063,000	

97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,117,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	83,058,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	497,395,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	98,378,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	94,271,000	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	266,115,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	88,955,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	137,544,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	433,350,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	66,913,000	
272回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	160,724,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	155,886,000	
293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	78,216,000	
301回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	158,832,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	156,322,000	
322回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	77,280,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	76,422,000	
346回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	75,198,000	
379回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	142,760,000	
387回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	189,920,000	
398回 政保道路債	300,000,000	138,930,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	77,286,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	92,776,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	93,750,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	512,220,000	
198回 地方公共団体金融機構債券	100,000,000	92,314,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	202,022,000	

1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	304,626,000	
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	304,596,000	
1 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	100,406,000	
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,568,000	
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	96,720,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	193,258,000	
F 1 7 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	263,985,000	
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	93,153,000	
3 9 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	456,660,000	
4 2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	262,233,000	
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	177,628,000	
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	236,337,000	
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	78,906,000	
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,817,000	
1 0 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,186,000	
1 1 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,978,000	
7 7 回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	202,014,000	
1 0 回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	138,441,000	
F 5 6 4 回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	153,086,000	
1 5 回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	199,210,000	
9 3 回 都市再生債券	100,000,000	98,153,000	
1 0 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	192,244,000	
1 6 5 回 都市再生機構債券	200,000,000	97,366,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	202,258,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	349,464,500	
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,241,000	
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,937,000	
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	197,352,500	

159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,616,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	294,900,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	293,964,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	75,274,000	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,323,000	11,360,705	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,455,000	71,918,108	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,432,000	107,117,224	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,610,000	15,338,073	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,429,000	13,357,557	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,725,000	15,387,541	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,656,000	16,214,116	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,214,000	19,194,607	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,816,000	46,530,686	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,623,000	20,888,947	
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,604,000	24,735,116	
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,053,000	25,100,702	
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,471,000	27,759,939	
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,676,000	28,239,906	
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,731,000	31,322,389	
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,435,000	34,812,029	
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,634,000	36,367,629	
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,077,000	129,374,338	
117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,985,000	44,195,007	
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,693,000	44,120,144	
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,305,000	44,501,291	

	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	182,685,000	136,902,312	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	181,731,000	135,974,768	
	1 3 0 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	124,578,000	92,768,253	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	185,472,000	137,269,681	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	182,730,000	135,461,403	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	321,050,000	237,246,318	
	1 3 9 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	63,772,000	46,991,673	
	1 4 2 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	66,040,000	47,914,661	
	1 5 4 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	215,043,000	153,312,756	
	1 5 6 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	285,576,000	204,101,167	
	1 6 0 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	221,247,000	157,439,365	
	1 6 8 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	224,619,000	159,740,048	
	1 7 0 回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	684,243,000	483,055,030	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	96,713,000	
	7 7 回 東日本高速道路社債	300,000,000	294,012,000	
	7 8 回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	95,771,000	
	9 0 回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	182,370,000	
特殊債券 合計		20,220,733,000	16,785,392,489	
社債券	2 5 回 フランス相互信用連合 銀行（B F C M）円貨社債（2 0 1 7）	300,000,000	295,392,000	
	3 7 回 成田国際空港社債	100,000,000	68,282,000	
	3 9 回 成田国際空港社債	100,000,000	80,277,000	
	6 7 回 東日本高速道路社債	200,000,000	188,570,000	
	1 1 4 回 中日本高速道路債券	200,000,000	194,548,000	
	1 0 3 回 西日本高速道路債券	200,000,000	194,990,000	
	2 5 回 アサヒグループホール ディングス社債	200,000,000	193,306,000	
	3 回 ダイドーグループHD社 債	300,000,000	279,177,000	
	9 回 野村不動産ホールディン グス社債	100,000,000	81,249,000	
	3 0 回 東レ社債	300,000,000	296,625,000	
	2 3 回 三菱ケミカルホール ディングス社債	200,000,000	159,034,000	
	1 7 回 ダイセル社債	300,000,000	276,903,000	

16回 武田薬品工業社債	500,000,000	446,065,000	
4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	271,575,000	
14回 プリチストン社債	300,000,000	287,958,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	93,673,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	183,430,000	
43回 ソニー社債	100,000,000	91,444,000	
58回 川崎重工業社債	300,000,000	270,183,000	
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	96,944,000	
18回 本田技研工業 社債	100,000,000	95,030,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	75,883,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	381,640,000	
58回 住友商事社債	100,000,000	92,815,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	294,186,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	370,312,000	
22回 NTTファイナンス社債	100,000,000	89,583,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,400,000	
115回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	96,028,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	188,876,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	275,712,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	95,799,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	185,708,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	294,456,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	98,333,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	73,538,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	100,793,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,336,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	199,900,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	68,397,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	59,619,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	75,839,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	93,734,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	43,573,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	132,880,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	95,150,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,280,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	186,988,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	50,016,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	44,003,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,206,000	

75回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	132,632,000	
83回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	92,216,000	
32回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	101,018,000	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	42,705,000	
7回	ニッコンHD社債	300,000,000	283,200,000	
6回	横浜高速鉄道社債	200,000,000	185,684,000	
12回	ソフトバンク社債	400,000,000	387,908,000	
30回	光通信社債	200,000,000	182,344,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	75,695,000	
532回	中部電力社債	200,000,000	190,052,000	
530回	関西電力社債	400,000,000	382,888,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	138,904,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	270,213,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	180,118,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	93,186,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	99,151,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	375,048,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	196,472,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	268,953,000	
320回	四国電力社債	300,000,000	268,548,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	73,732,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	72,556,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	273,111,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	64,889,000	
507回	九州電力社債	200,000,000	179,512,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	147,348,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	98,336,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	179,526,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	156,084,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	69,970,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	67,078,000	
57回	東京瓦斯社債	300,000,000	119,655,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	195,046,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	151,524,000	
社債券 合計		16,100,000,000	14,093,940,000	
合計			446,164,767,863	

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)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	680,939,999
コール・ローン	2,552,011,619
国債証券	333,960,009,669
派生商品評価勘定	897,349
未収利息	2,800,522,509
前払費用	270,367,513
流動資産合計	340,264,748,658
資産合計	340,264,748,658
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	673,815
未払金	1,723,021,380
未払解約金	45,771,000
流動負債合計	1,769,466,195
負債合計	1,769,466,195
純資産の部	
元本等	
元本	121,959,541,882
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	216,535,740,581
元本等合計	338,495,282,463
純資産合計	338,495,282,463
負債純資産合計	340,264,748,658

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月29日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	121,182,814,511円
同期中追加設定元本額	36,581,336,054円
同期中一部解約元本額	35,804,608,683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	9,610,246,654円
たわらノーロード 先進国債券	27,675,027,382円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	6,051,812,074円
たわらノーロード バランス（堅実型）	77,831,336円
たわらノーロード バランス（標準型）	585,074,572円
たわらノーロード バランス（積極型）	174,605,724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）	17,051,367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）	926,520,098円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,805,970,225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）	1,015,370,072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）	681,252,628円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,756,743円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,100,387円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	149,920,648円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	43,401,231円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	33,603,333円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	54,857,394円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	12,725,900円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	447,717円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,858,336,364円
One DC 先進国債券インデックスファンド	5,440,778,265円
One グローバルバランス	221,757,665円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	771,236,833円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,608,980,983円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,522,272,523円

DIAM DC バランス30インデックスファンド	357,878,589円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	840,298,768円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	939,872,648円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	24,772,124円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,055,863,906円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	38,305,990円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	156,797,134円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	176,543,663円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	334,821,296円
投資のソムリエ	1,160,489,074円
クルーズコントロール	528,035,359円
投資のソムリエ＜DC年金＞	250,768,083円
DIAM 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	225,130,824円
4資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	1,640,416,097円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	488,984,395円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	808,322,061円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	51,800,565円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	27,783,714円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	5,641,255円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	102,622,212円
4資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	1,260,085,648円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	174,341,663円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	58,199,935円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	32,298,708円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	18,269,434円
4資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	1,235,937,792円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	8,103,025円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	3,175,226円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	30,786,136円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	319,005円
Oneパッシブ資産分散ファンド	771,045,550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）	345,372,830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）	256,996,631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）	122,159,867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）	667,809,458円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	553,579,981円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	287,873,144円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	609,433,498円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	835,352,399円
ハイブリッドストラテジーマルチアセットファンド（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	56,069,943円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	4,949,549,835円
DIAM外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,310,226,202円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	3,841,885,357円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	5,203,682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）	30,412,598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）	410,022,897円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）	829,802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）	150,038,666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）	175,820,811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）	9,245,202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）	16,998,469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）	3,999,073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）	54,068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）	641,526,593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）	958,570,600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）	1,937,453,089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）	29,429,182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）	74,055,995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）	487,075,285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）	103,781,564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）	146,129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）	101,917,241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）	91,774,467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）	118,055,593円
D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家限定）	21,838,708円
動的パッケージファンド＜D C年金＞	61,176,154円
コア資産形成ファンド	20,430,524円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	3,063,262,595円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞	6,593,824,536円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,926,177,576円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	5,928,463,641円
計	121,959,541,882円
2. 受益権の総数	121,959,541,882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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△3,765,706,360
合計	△3,765,706,360

（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（2026年2月25日から2026年6月29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	2026年6月29日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	1,777,900,000	—	1,778,123,534	223,534
アメリカ・ドル	1,031,088,000	—	1,030,429,912	△658,088
イギリス・ポンド	162,216,000	—	162,200,273	△15,727
ユーロ	584,596,000	—	585,493,349	897,349
合計	1,777,900,000	—	1,778,123,534	223,534

(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)

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額	2.7755円
(1万口当たり純資産額)	(27,755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

2026年6月29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 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,632,491.390	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,639,442.980	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,885,621.870	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,680,000.000	2,587,500.840	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,935,986.330	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,490,582.040	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,350,000.000	4,687,310.520	
		US T N/B 0.625 08/15/30	3,836,000.000	3,332,225.330	

US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,715,130.870	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,818,528.880	
US T N/B 0.75 01/31/28	5,678,000.000	5,388,776.860	
US T N/B 0.875 11/15/30	7,200,000.000	6,272,578.150	
US T N/B 1.0 07/31/28	5,270,000.000	4,947,315.410	
US T N/B 1.125 02/15/31	3,267,000.000	2,860,475.460	
US T N/B 1.125 02/29/28	6,000,000.000	5,715,234.360	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,000,000.000	638,906.250	
US T N/B 1.125 08/15/40	2,460,000.000	1,555,661.690	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,230,000.000	3,971,408.200	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,310,000.000	3,152,128.510	
US T N/B 1.25 04/30/28	2,700,000.000	2,565,369.140	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,380,000.000	2,111,467.940	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,924,348.060	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,500,000.000	3,310,439.440	
US T N/B 1.25 08/15/31	6,360,000.000	5,517,300.000	
US T N/B 1.25 09/30/28	1,413,000.000	1,327,254.070	
US T N/B 1.375 08/15/50	2,500,000.000	1,242,480.470	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,426,664.050	
US T N/B 1.375 11/15/31	1,000,000.000	867,070.310	
US T N/B 1.375 11/15/40	2,000,000.000	1,306,171.880	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,305,132.810	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,330,000.000	3,954,000.370	
US T N/B 1.5 11/30/28	3,500,000.000	3,292,666.020	
US T N/B 1.625 05/15/31	6,340,000.000	5,643,962.070	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,460,000.000	3,213,069.500	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,932,000.000	2,611,455.450	
US T N/B 1.75 01/31/29	6,400,000.000	6,034,124.990	
US T N/B 1.75 08/15/41	2,480,000.000	1,678,892.190	
US T N/B 1.75 11/15/29	4,250,000.000	3,939,716.780	
US T N/B 1.875 02/15/32	7,780,000.000	6,890,466.380	
US T N/B 1.875 02/15/41	308,000.000	215,744.370	
US T N/B 1.875 02/15/51	3,068,000.000	1,726,888.480	
US T N/B 1.875 02/28/29	3,700,000.000	3,494,404.270	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,370,000.000	2,432,348.800	
US T N/B 2.0 02/15/50	2,800,000.000	1,651,289.040	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,350,508.970	
US T N/B 2.0 11/15/41	2,850,000.000	1,994,276.350	
US T N/B 2.25 02/15/52	2,350,000.000	1,432,811.520	
US T N/B 2.25 05/15/41	3,420,000.000	2,517,774.610	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	4,155,282.800	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,570,000.000	1,695,597.640	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,940,000.000	1,849,903.100	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,190,102.160	
US T N/B 2.375 02/15/42	1,700,000.000	1,252,388.660	
US T N/B 2.375 03/31/29	5,150,000.000	4,921,770.480	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,596,521.100	
US T N/B 2.375 05/15/51	4,760,000.000	3,012,466.360	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,690,000.000	1,733,683.970	

US T N/B 2.5 02/15/45	1,200,000.000	850,593.740	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,170,000.000	2,209,836.730	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,534,000.000	1,065,650.620	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,200,000.000	5,011,398.440	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,847,525.880	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,940,664.240	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,444,411.700	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,179,408.190	
US T N/B 2.75 07/31/27	828,000.000	816,420.930	
US T N/B 2.75 08/15/32	6,340,000.000	5,847,535.550	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,000,000.000	1,543,437.500	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,594,362.870	
US T N/B 2.75 11/15/42	2,056,000.000	1,578,542.190	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,604,091.780	
US T N/B 2.875 04/30/29	4,500,000.000	4,354,541.010	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,060,000.000	3,971,425.370	
US T N/B 2.875 05/15/32	6,050,000.000	5,640,207.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,890,000.000	2,240,991.780	
US T N/B 2.875 05/15/49	2,512,000.000	1,803,439.380	
US T N/B 2.875 05/15/52	8,329,000.000	5,829,486.580	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,906,313.090	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,102,500.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,580,000.000	1,166,731.250	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,200,000.000	902,671.870	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	1,972,179.670	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,010,000.000	2,218,581.620	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,481,000.000	1,190,411.590	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	991,133.190	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,215,569.520	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,510,000.000	1,858,576.550	
US T N/B 3.0 08/15/52	5,240,000.000	3,759,495.320	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,800,000.000	1,390,851.550	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	763,203.120	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,360,000.000	1,937,228.120	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,243,730.460	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,149,031.250	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,590,000.000	1,257,280.070	
US T N/B 3.125 08/31/27	4,540,000.000	4,491,053.120	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	3,020,587.500	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	4,089,378.880	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,020,000.000	2,489,966.400	
US T N/B 3.25 05/15/42	1,560,000.000	1,296,780.460	
US T N/B 3.25 06/30/27	2,700,000.000	2,678,848.870	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,417,558.570	
US T N/B 3.375 05/15/33	12,230,000.000	11,604,167.880	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,100,000.000	4,201,921.870	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,460,157.020	
US T N/B 3.375 09/15/27	4,000,000.000	3,967,187.520	
US T N/B 3.375 09/15/28	1,000,000.000	984,824.220	

US T N/B 3.375 11/15/48	3,650,000.000	2,884,925.760	
US T N/B 3.5 01/15/29	2,600,000.000	2,562,726.550	
US T N/B 3.5 01/31/28	5,680,000.000	5,627,637.490	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,700,000.000	2,645,947.260	
US T N/B 3.5 02/15/29	2,000,000.000	1,970,468.760	
US T N/B 3.5 02/15/33	2,164,000.000	2,074,143.270	
US T N/B 3.5 02/15/39	700,000.000	634,812.500	
US T N/B 3.5 02/28/31	4,184,000.000	4,074,823.750	
US T N/B 3.5 03/15/29	2,600,000.000	2,561,000.000	
US T N/B 3.5 04/30/28	4,500,000.000	4,452,890.620	
US T N/B 3.5 04/30/30	3,500,000.000	3,424,804.670	
US T N/B 3.5 09/30/29	3,500,000.000	3,436,630.850	
US T N/B 3.5 10/15/28	3,000,000.000	2,960,625.000	
US T N/B 3.5 11/15/28	7,500,000.000	7,399,218.750	
US T N/B 3.5 11/30/30	2,500,000.000	2,437,695.300	
US T N/B 3.5 12/15/28	1,500,000.000	1,479,257.820	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,395,114.450	
US T N/B 3.625 02/15/53	5,857,000.000	4,736,848.750	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,472,246.070	
US T N/B 3.625 03/31/30	5,500,000.000	5,408,154.290	
US T N/B 3.625 05/15/53	4,210,000.000	3,402,699.600	
US T N/B 3.625 05/31/28	3,500,000.000	3,469,990.230	
US T N/B 3.625 08/15/28	279,000.000	276,340.780	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,264,889.050	
US T N/B 3.625 08/31/29	5,000,000.000	4,930,468.740	
US T N/B 3.625 08/31/30	2,800,000.000	2,747,281.260	
US T N/B 3.625 09/30/30	3,000,000.000	2,942,871.090	
US T N/B 3.625 09/30/31	2,500,000.000	2,439,257.800	
US T N/B 3.625 10/31/30	6,700,000.000	6,568,878.920	
US T N/B 3.625 12/31/30	3,700,000.000	3,624,626.960	
US T N/B 3.75 01/31/31	1,200,000.000	1,181,250.000	
US T N/B 3.75 04/15/28	4,600,000.000	4,572,507.820	
US T N/B 3.75 05/15/28	1,000,000.000	993,789.060	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,454,472.660	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,157,000.000	
US T N/B 3.75 08/15/27	7,200,000.000	7,174,124.990	
US T N/B 3.75 08/15/41	4,920,000.000	4,412,625.000	
US T N/B 3.75 08/31/31	2,000,000.000	1,963,476.560	
US T N/B 3.75 10/31/32	2,500,000.000	2,436,865.220	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,274,591.390	
US T N/B 3.75 11/30/32	1,100,000.000	1,071,662.100	
US T N/B 3.75 12/31/28	4,000,000.000	3,966,953.120	
US T N/B 3.75 12/31/30	2,600,000.000	2,560,085.940	
US T N/B 3.875 02/15/43	2,000,000.000	1,789,453.110	
US T N/B 3.875 03/15/28	6,000,000.000	5,978,437.500	
US T N/B 3.875 03/31/31	4,500,000.000	4,451,396.490	
US T N/B 3.875 04/15/29	4,000,000.000	3,977,343.760	
US T N/B 3.875 04/30/30	2,500,000.000	2,479,492.200	
US T N/B 3.875 05/15/29	7,000,000.000	6,959,804.670	

US T N/B 3.875 05/15/43	1,800,000.000	1,606,570.300	
US T N/B 3.875 06/15/28	3,000,000.000	2,987,871.090	
US T N/B 3.875 06/30/30	2,000,000.000	1,982,421.880	
US T N/B 3.875 07/15/28	9,200,000.000	9,159,570.320	
US T N/B 3.875 07/31/30	2,200,000.000	2,180,406.250	
US T N/B 3.875 08/15/33	9,200,000.000	8,989,945.310	
US T N/B 3.875 08/15/34	7,000,000.000	6,796,699.190	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,600,000.000	1,472,249.990	
US T N/B 3.875 08/31/32	6,500,000.000	6,386,884.790	
US T N/B 3.875 09/30/29	6,240,000.000	6,198,440.590	
US T N/B 3.875 09/30/32	2,000,000.000	1,964,335.940	
US T N/B 3.875 10/15/27	4,000,000.000	3,989,609.360	
US T N/B 3.875 11/30/27	4,300,000.000	4,287,402.330	
US T N/B 3.875 11/30/29	5,800,000.000	5,757,859.400	
US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,584,906.250	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,779,273.440	
US T N/B 3.875 12/31/32	1,700,000.000	1,667,328.120	
US T N/B 4.0 01/31/29	3,819,000.000	3,809,601.660	
US T N/B 4.0 01/31/31	6,262,000.000	6,228,366.230	
US T N/B 4.0 01/31/33	3,316,000.000	3,274,550.000	
US T N/B 4.0 02/15/34	3,317,000.000	3,257,138.490	
US T N/B 4.0 02/28/30	6,400,000.000	6,377,500.030	
US T N/B 4.0 02/29/28	4,700,000.000	4,693,207.040	
US T N/B 4.0 03/31/30	4,000,000.000	3,985,234.360	
US T N/B 4.0 04/30/32	6,000,000.000	5,945,039.040	
US T N/B 4.0 05/31/30	3,000,000.000	2,987,988.270	
US T N/B 4.0 06/30/28	3,500,000.000	3,493,984.370	
US T N/B 4.0 06/30/32	3,000,000.000	2,970,585.930	
US T N/B 4.0 07/31/29	2,400,000.000	2,393,484.380	
US T N/B 4.0 07/31/30	3,500,000.000	3,484,824.210	
US T N/B 4.0 07/31/32	5,000,000.000	4,948,535.150	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,800,000.000	2,791,031.260	
US T N/B 4.0 11/15/35	9,015,000.000	8,768,496.090	
US T N/B 4.0 11/15/42	2,300,000.000	2,095,515.620	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	4,117,678.870	
US T N/B 4.0 12/15/27	4,400,000.000	4,394,328.130	
US T N/B 4.125 02/15/36	6,000,000.000	5,888,437.500	
US T N/B 4.125 02/29/32	3,000,000.000	2,993,437.500	
US T N/B 4.125 03/31/29	3,800,000.000	3,802,894.530	
US T N/B 4.125 03/31/31	2,200,000.000	2,199,355.460	
US T N/B 4.125 03/31/32	3,500,000.000	3,491,591.810	
US T N/B 4.125 05/31/32	4,800,000.000	4,785,093.740	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,501,611.320	
US T N/B 4.125 07/31/31	8,500,000.000	8,495,185.510	
US T N/B 4.125 08/15/44	2,000,000.000	1,826,835.940	
US T N/B 4.125 08/31/30	1,741,000.000	1,741,170.020	
US T N/B 4.125 09/30/27	4,000,000.000	4,002,187.520	
US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,341,043.750	
US T N/B 4.125 10/31/29	4,000,000.000	4,002,812.480	

US T N/B 4.125 10/31/31	2,500,000.000	2,496,728.520	
US T N/B 4.125 11/15/27	8,000,000.000	8,002,968.720	
US T N/B 4.125 11/15/32	4,000,000.000	3,981,874.990	
US T N/B 4.125 11/30/29	4,000,000.000	4,003,125.000	
US T N/B 4.125 11/30/31	6,714,000.000	6,703,771.620	
US T N/B 4.25 01/15/28	5,500,000.000	5,511,816.420	
US T N/B 4.25 01/31/30	3,000,000.000	3,014,003.910	
US T N/B 4.25 02/15/28	4,300,000.000	4,309,826.180	
US T N/B 4.25 02/15/54	11,300,000.000	10,194,939.430	
US T N/B 4.25 02/28/29	3,930,000.000	3,945,581.820	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,334,000.000	2,345,989.100	
US T N/B 4.25 05/15/35	8,000,000.000	7,948,906.240	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	924,876.940	
US T N/B 4.25 06/30/29	3,000,000.000	3,012,832.020	
US T N/B 4.25 06/30/31	2,800,000.000	2,814,109.360	
US T N/B 4.25 08/15/35	9,500,000.000	9,430,976.610	
US T N/B 4.25 08/15/54	5,000,000.000	4,513,867.200	
US T N/B 4.25 11/15/34	3,570,000.000	3,553,474.770	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	1,913,906.240	
US T N/B 4.375 01/31/32	4,548,000.000	4,594,723.600	
US T N/B 4.375 02/15/38	500,000.000	499,179.690	
US T N/B 4.375 05/15/34	7,000,000.000	7,039,375.000	
US T N/B 4.375 05/15/36	7,500,000.000	7,502,929.650	
US T N/B 4.375 05/15/40	994,000.000	968,722.880	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,750,000.000	1,691,689.450	
US T N/B 4.375 07/15/27	3,500,000.000	3,511,366.070	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,898,906.240	
US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,520,097.660	
US T N/B 4.375 11/15/39	500,000.000	489,628.900	
US T N/B 4.375 11/30/28	4,690,000.000	4,719,678.880	
US T N/B 4.375 11/30/30	3,000,000.000	3,030,175.770	
US T N/B 4.375 12/31/29	3,800,000.000	3,833,621.100	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,102,000.000	2,140,591.410	
US T N/B 4.5 02/15/44	1,300,000.000	1,250,107.410	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,108,464.830	
US T N/B 4.5 05/31/29	4,300,000.000	4,347,535.160	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	974,296.090	
US T N/B 4.5 11/15/33	7,100,000.000	7,206,222.670	
US T N/B 4.5 11/15/54	4,500,000.000	4,235,449.230	
US T N/B 4.5 12/31/31	2,000,000.000	2,033,398.440	
US T N/B 4.625 02/15/35	8,200,000.000	8,375,371.100	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,390,000.000	1,393,366.400	
US T N/B 4.625 02/15/46	2,180,000.000	2,113,237.500	
US T N/B 4.625 04/30/29	4,250,000.000	4,309,682.620	
US T N/B 4.625 04/30/31	3,000,000.000	3,064,160.160	
US T N/B 4.625 05/15/44	2,000,000.000	1,951,406.240	
US T N/B 4.625 05/15/54	4,600,000.000	4,416,628.910	
US T N/B 4.625 05/31/31	2,000,000.000	2,043,125.000	
US T N/B 4.625 06/15/27	4,500,000.000	4,524,644.920	

	US T N/B 4.625 09/30/28	4,600,000.000	4,651,839.820	
	US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,058,535.160	
	US T N/B 4.625 11/15/44	2,000,000.000	1,946,640.620	
	US T N/B 4.625 11/15/45	3,700,000.000	3,589,000.000	
	US T N/B 4.625 11/15/55	1,700,000.000	1,634,921.870	
	US T N/B 4.75 02/15/41	2,230,000.000	2,249,599.590	
	US T N/B 4.75 02/15/45	2,000,000.000	1,975,625.000	
	US T N/B 4.75 02/15/56	3,900,000.000	3,829,921.870	
	US T N/B 4.75 05/15/55	4,000,000.000	3,922,031.240	
	US T N/B 4.75 08/15/55	4,200,000.000	4,119,445.290	
	US T N/B 4.75 11/15/43	2,020,000.000	2,006,230.850	
	US T N/B 4.75 11/15/53	4,100,000.000	4,010,312.500	
	US T N/B 4.875 08/15/45	2,000,000.000	2,004,140.620	
	US T N/B 4.875 10/31/28	4,000,000.000	4,068,046.880	
	US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,574,023.450	
	US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	845,156.240	
	US T N/B 5.0 05/15/45	1,000,000.000	1,018,320.310	
	US T N/B 5.25 11/15/28	3,162,000.000	3,245,743.600	
	US T N/B 5.375 02/15/31	5,860,000.000	6,174,059.370	
	US T N/B 6.125 11/15/27	3,200,000.000	3,289,500.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	2,559,000.000	2,753,424.010	
アメリカ・ドル 小計		996,789,000.000 (161,240,588,640)	931,136,017.620 (150,620,562,212)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/31/28	2,190,000.000	2,064,722.280	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	3,570,000.000	2,928,253.270	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,990,000.000	1,695,423.120	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,680,000.000	1,534,743.440	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,160,000.000	521,334.680	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	3,521,000.000	2,472,995.150	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,340,000.000	475,952.780	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,035,000.000	474,173.980	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,135,000.000	1,669,992.400	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,030,000.000	1,828,584.740	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,370,000.000	1,980,885.000	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	250,000.000	160,725.580	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	1,166,000.000	344,620.190	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,210,000.000	1,175,578.970	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,430,000.000	609,985.940	

UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,350,000.000	1,388,045.320	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	322,000.000	164,464.290	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	621,693.950	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,330,000.000	2,206,601.960	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	571,301.070	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	316,784.850	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,100,000.000	576,256.580	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,562,000.000	701,579.810	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,790,000.000	1,311,823.270	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	350,000.000	186,407.430	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,660,000.000	1,271,147.730	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,300,000.000	2,144,893.590	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,137,917.140	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	607,112.000	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	2,250,000.000	2,014,067.870	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,370,000.000	1,048,639.370	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,362,596.150	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	1,016,600.000	
UK TREASURY 4.0 05/22/29	800,000.000	796,238.190	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	2,200,000.000	2,167,777.260	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,720,000.000	1,331,624.000	
UK TREASURY 4.125 03/07/31	200,000.000	198,759.390	
UK TREASURY 4.125 03/07/33	2,000,000.000	1,962,820.040	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	2,100,000.000	2,097,283.910	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,851,000.000	2,739,327.180	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,470,000.000	2,460,761.710	
UK TREASURY 4.25 07/31/34	1,633,000.000	1,594,733.640	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,160,000.000	1,072,568.860	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,210,000.000	2,216,466.460	

	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,401,000.000	2,191,913.640	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,830,000.000	1,577,219.170	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,147,000.000	970,857.960	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,163,000.000	959,951.850	
	UK TREASURY 4.375 01/31/40	1,300,000.000	1,211,544.170	
	UK TREASURY 4.375 03/07/28	1,550,000.000	1,556,550.920	
	UK TREASURY 4.375 03/07/30	3,020,000.000	3,036,957.300	
	UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,180,000.000	995,306.420	
	UK TREASURY 4.5 03/07/35	1,657,000.000	1,637,010.960	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,850,000.000	1,863,416.200	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,850,000.000	1,838,922.750	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,245,000.000	1,145,622.320	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	2,200,000.000	2,210,206.010	
	UK TREASURY 4.625 03/07/37	500,000.000	490,019.790	
	UK TREASURY 4.75 10/22/35	1,990,000.000	1,992,380.040	
	UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,852,000.000	1,738,102.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,595,000.000	1,632,944.570	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,430,000.000	1,400,265.220	
	UK TREASURY 4.875 07/31/36	250,000.000	251,394.400	
	UK TREASURY 5.25 01/31/41	1,350,000.000	1,366,117.780	
	UK TREASURY 5.375 01/31/56	293,000.000	289,938.830	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,180,000.000	1,233,716.780	
イギリス・ポンド 小計		106,578,000.000 (22,755,468,780)	88,814,623.620 (18,962,810,289)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,700,000.000	1,719,793.100	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	2,250,000.000	2,311,688.250	
	ISRAEL FIXED BOND 07/31/28	400,000.000	406,701.600	
	ISRAEL FIXED BOND 07/31/31	2,240,000.000	2,278,373.440	

	ISRAEL FIXED BOND 08/31/29	700,000.000	726,679.800	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	3,310,000.000	3,041,218.070	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	4,280,000.000	3,803,751.560	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,440,000.000	2,741,084.880	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,638,000.000	1,255,456.560	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,810,000.000	3,725,840.910	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,711,700.710	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	300,000.000	301,848.600	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	2,242,000.000	2,643,669.980	
イスラエル・シュケル 小計		28,120,000.000 (1,515,260,260)	26,667,807.460 (1,437,008,139)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,500,000.000	1,256,370.000	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	2,320,000.000	2,005,361.600	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,950,000.000	2,464,754.500	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	860,000.000	750,040.400	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,490,000.000	765,785.500	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	4,578,000.000	3,884,936.580	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	880,000.000	845,776.800	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,060,000.000	1,924,925.800	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	737,107.200	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,350,000.000	1,160,271.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	830,000.000	810,968.100	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,541,568.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,750,000.000	2,612,252.500	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	791,067.500	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,070,000.000	965,600.100	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,400,000.000	2,330,304.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	550,000.000	464,596.000	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,820,000.000	1,674,764.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	880,000.000	804,689.600	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	221,000.000	208,575.380	
	AUSTRALIAN 4.25 03/21/36	2,700,000.000	2,601,990.000	
	AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	1,950,000.000	1,903,180.500	
	AUSTRALIAN 4.25 10/21/36	2,031,000.000	1,949,841.240	
	AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	557,000.000	537,772.360	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,068,000.000	1,066,632.960	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	800,000.000	741,016.000	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/37	870,000.000	867,120.300	
	AUSTRALIAN 5.0 06/21/36	900,000.000	918,990.000	
オーストラリア・ドル 小計		43,035,000.000	38,586,257.920	

		(4,792,377,600)	(4,296,965,682)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.32 02/25/29	7,000,000.000	7,012,618.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.4 11/25/28	9,000,000.000	9,028,355.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28	9,000,000.000	9,028,746.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27	47,000,000.000	47,153,953.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30	46,000,000.000	46,134,826.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	79,000,000.000	79,331,310.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28	57,000,000.000	57,262,718.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.49 12/25/31	14,000,000.000	13,998,183.640	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.5 04/15/31	30,000,000.000	30,095,097.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.54 01/25/31	4,000,000.000	4,020,186.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.55 07/25/30	10,000,000.000	10,078,753.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35	25,000,000.000	24,877,741.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	47,440,000.000	47,695,786.990	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30	37,000,000.000	37,327,490.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.65 05/15/35	12,000,000.000	11,974,020.120	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 03/25/33	3,000,000.000	3,020,280.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 12/25/32	23,000,000.000	23,151,452.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 05/25/35	34,050,000.000	34,023,549.270	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.72 05/15/36	27,100,000.000	27,093,736.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.74 10/15/29	27,000,000.000	27,350,576.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.75 02/25/36	14,300,000.000	14,323,063.040	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32	8,000,000.000	8,120,736.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 11/15/35	6,000,000.000	6,022,847.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32	35,000,000.000	35,569,625.000	

CHINA GOVERNMENT BOND 1.83 08/25/35	21,000,000.000	21,176,379.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	21,000,000.000	21,437,459.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	36,000,000.000	36,655,491.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.92 01/15/55	4,550,000.000	4,237,016.410	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 11/25/34	8,000,000.000	8,246,660.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	32,740,000.000	33,439,349.310	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	31,000,000.000	32,166,269.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	65,410,000.000	67,542,065.110	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	31,590,000.000	33,145,700.090	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	30,000,000.000	31,176,231.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	26,000,000.000	27,430,036.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	29,000,000.000	29,822,735.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.38 01/15/56	22,700,000.000	23,300,642.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	6,910,000.000	7,078,439.540	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,328,597.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	31,410,000.000	31,833,428.780	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	31,000,000.000	33,024,256.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	17,000,000.000	17,840,993.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	11,300,000.000	11,645,013.860	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	19,300,000.000	20,534,051.650	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	28,000,000.000	29,394,582.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	24,000,000.000	24,638,184.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	31,000,000.000	32,522,276.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,765,118.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	19,500,000.000	20,955,364.950	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	23,850,000.000	25,686,108.940	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	7,600,000.000	7,974,677.720	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	16,000,000.000	17,067,644.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,500,000.000	21,915,650.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	7,000,000.000	7,306,298.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,642,918.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	23,125,757.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,472,875.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,552,591.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	19,300,000.000	20,832,906.360	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	18,000,000.000	18,314,811.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	4,200,000.000	4,569,774.720	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	11,100,000.000	11,947,160.880	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	27,100,000.000	28,190,493.160	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	20,400,000.000	23,629,589.280	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	22,000,000.000	22,809,688.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	28,000,000.000	30,219,492.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,522,118.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	10,800,000.000	12,841,863.120	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 11/22/28	37,000,000.000	38,949,992.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	9,000,000.000	9,778,163.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,124,160.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	25,000,000.000	26,591,922.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	15,820,000.000	19,190,028.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	16,100,000.000	19,469,981.160	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	10,450,000.000	13,068,314.380	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,161,407.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	9,717,603.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	13,590,000.000	17,485,339.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	16,300,000.000	21,033,637.360	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,300,000.000	13,668,813.790	
オフショア・人民元 小計		1,708,810,000.000 (40,622,685,725)	1,782,893,782.430 (42,383,842,443)	
カナダ・ドル	CANADA 0.5 12/01/30	3,550,000.000	3,188,592.860	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,150,000.000	1,134,380.630	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,940,000.000	1,818,095.650	
	CANADA 1.5 06/01/31	3,070,000.000	2,855,530.130	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,840,000.000	1,696,090.120	
	CANADA 1.75 12/01/53	3,447,000.000	2,248,882.310	
	CANADA 2.0 06/01/28	3,030,000.000	2,988,308.830	
	CANADA 2.0 06/01/32	3,540,000.000	3,328,292.250	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,760,000.000	1,248,157.350	
	CANADA 2.25 02/01/28	620,000.000	615,603.100	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,300,000.000	1,278,774.640	
	CANADA 2.25 12/01/29	900,000.000	881,086.720	
	CANADA 2.5 12/01/32	820,000.000	789,189.540	
	CANADA 2.75 03/01/30	1,750,000.000	1,738,453.990	
	CANADA 2.75 03/01/31	380,000.000	375,613.770	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,740,000.000	1,693,667.650	
	CANADA 2.75 08/01/28	870,000.000	869,418.050	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,051,706.330	
	CANADA 2.75 09/01/30	3,050,000.000	3,022,366.430	
	CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	425,805.750	
	CANADA 2.75 12/01/55	1,450,000.000	1,181,750.350	
	CANADA 2.75 12/01/64	550,000.000	433,763.040	
	CANADA 3.0 03/01/32	2,500,000.000	2,489,331.760	
	CANADA 3.0 06/01/34	1,259,000.000	1,237,620.700	
	CANADA 3.0 09/01/31	380,000.000	379,080.660	
	CANADA 3.25 06/01/35	3,208,000.000	3,192,380.930	
	CANADA 3.25 06/01/36	452,000.000	446,772.490	
	CANADA 3.25 09/01/28	500,000.000	504,860.720	
	CANADA 3.25 12/01/33	1,263,000.000	1,266,126.630	
	CANADA 3.25 12/01/34	1,070,000.000	1,067,900.120	
	CANADA 3.25 12/01/35	2,110,000.000	2,092,537.020	
	CANADA 3.5 03/01/28	3,130,000.000	3,169,935.850	
	CANADA 3.5 03/01/34	1,450,000.000	1,477,206.220	
	CANADA 3.5 09/01/29	1,300,000.000	1,323,591.880	
	CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	879,081.580	

	CANADA 3.5 12/01/57	1,150,000.000	1,087,651.680	
	CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,750,085.060	
	CANADA 4.0 06/01/41	197,000.000	206,817.620	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,650,000.000	1,884,295.370	
	CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	691,649.220	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,010,000.000	1,170,220.920	
カナダ・ドル 小計		64,176,000.000 (7,313,496,960)	61,180,675.920 (6,972,149,828)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 07/01/31	1,290,000.000	1,282,205.180	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	710,000.000	685,684.750	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	540,000.000	521,275.150	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	910,000.000	930,270.250	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	600,000.000	620,068.360	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	244,686.930	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	880,000.000	918,558.860	
	SINGAPORE 2.75 03/01/35	360,000.000	382,204.180	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	470,000.000	521,631.850	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	831,301.360	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	642,202.980	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	203,157.800	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	520,000.000	544,884.600	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	120,000.000	124,425.420	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	153,000.000	190,330.690	
	SINGAPORE 3.25 06/01/54	160,000.000	198,630.400	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	550,000.000	605,816.530	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	200,000.000	218,943.500	
シンガポール・ドル 小計		9,283,000.000 (1,160,189,340)	9,666,278.790 (1,208,091,523)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,220,000.000	3,805,147.560	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,090,000.000	3,989,766.180	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	6,160,000.000	5,874,395.820	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	6,550,000.000	6,244,055.390	
	SWEDEN 2.25 05/11/35	1,140,000.000	1,113,872.860	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	5,530,000.000	5,499,331.980	
	SWEDEN 2.5 10/15/36	3,440,000.000	3,397,705.200	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,820,000.000	5,227,731.010	
スウェーデン・クローナ 小計		35,950,000.000 (597,129,500)	35,152,006.000 (583,874,820)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,980,000.000	5,263,121.820	
	DENMARK 0.25 11/15/52	5,063,000.000	2,528,352.060	
	DENMARK 0.5 11/15/27	2,850,000.000	2,785,446.070	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,040,000.000	3,805,422.990	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,310,000.000	2,261,819.170	
	DENMARK 2.25 11/15/35	2,994,000.000	2,870,946.600	
	DENMARK 4.5 11/15/39	6,009,000.000	7,084,727.550	
デンマーク・クローネ 小計		29,246,000.000	26,599,836.260	

		(720,621,440)	(655,419,965)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,050,000.000	992,191.130	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	2,610,000.000	2,336,863.500	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	273,620.150	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,110,000.000	995,556.800	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	510,000.000	435,917.680	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	810,000.000	553,042.750	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	740,132.250	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	1,080,000.000	1,042,670.640	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	860,000.000	864,399.230	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	730,000.000	721,897.000	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	500,000.000	514,802.200	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	450,000.000	457,725.730	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	200,000.000	199,918.570	
ニュージーランド・ドル 小計		11,060,000.000 (1,008,008,400)	10,128,737.630 (923,133,148)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,850,000.000	2,455,031.550	
	NORWAY 1.375 08/19/30	8,610,000.000	7,664,923.350	
	NORWAY 1.75 09/06/29	5,120,000.000	4,723,489.350	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,526,000.000	2,431,047.660	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,230,000.000	1,096,843.630	
	NORWAY 3.0 08/15/33	5,000,000.000	4,645,571.780	
	NORWAY 3.5 10/06/42	4,910,000.000	4,495,057.110	
	NORWAY 3.625 04/13/34	1,570,000.000	1,513,523.170	
	NORWAY 3.625 05/31/39	1,950,000.000	1,837,221.750	
	NORWAY 3.75 06/12/35	1,810,000.000	1,752,393.430	
ノルウェー・クローネ 小計		35,576,000.000 (578,465,760)	32,615,102.780 (530,321,571)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.25 10/25/30	6,420,000.000	5,610,824.070	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,250,000.000	2,759,240.900	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	4,996,295.270	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,958,000.000	3,878,166.880	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,906,515.930	
	POLAND 4.0 07/25/31	950,000.000	918,301.040	
	POLAND 4.5 01/25/31	2,200,000.000	2,191,412.890	
	POLAND 4.5 07/25/30	3,300,000.000	3,301,727.880	
	POLAND 4.75 07/25/29	4,220,000.000	4,279,121.350	
	POLAND 5.0 01/25/30	6,993,000.000	7,133,804.740	
	POLAND 5.0 10/25/34	3,250,000.000	3,229,430.790	
	POLAND 5.0 10/25/35	4,150,000.000	4,088,406.800	
	POLAND 5.25 04/25/36	1,300,000.000	1,297,726.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,990,000.000	2,068,185.500	

	POLAND 6.0 10/25/33	4,862,000.000	5,160,977.010	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,400,000.000	2,559,144.240	
ポーランド・ズロチ 小計		56,303,000.000 (2,418,484,104)	55,379,281.290 (2,378,805,952)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,932,598.170	
	MALAYSIA 3.476 07/02/35	4,080,000.000	4,039,022.880	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,250,000.000	1,254,371.620	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	3,100,000.000	3,107,440.930	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,018,805.000	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,400,000.000	1,387,229.700	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,304,950.280	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,689,927.630	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,100,000.000	1,120,406.100	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	661,000.000	667,857.280	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	1,050,000.000	1,076,798.830	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,480,000.000	1,480,483.660	
	MALAYSIA 4.18 05/16/44	700,000.000	722,845.130	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,070,000.000	2,147,786.460	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	900,000.000	943,404.390	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,820,000.000	1,927,516.500	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,248,385.800	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,642,858.590	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	250,000.000	267,102.620	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,160,000.000	1,270,445.790	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	800,000.000	883,480.160	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,500,000.000	3,808,781.900	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	500,000.000	552,623.600	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,240,000.000	1,401,223.310	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,801,608.320	
マレーシア・リンギット 小計		39,381,000.000 (1,562,827,109)	40,697,954.650 (1,615,090,191)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 02/28/30	11,500,000.000	11,617,586.810	
	MEXICAN BONDS 03/01/29	55,823,000.000	56,728,236.360	
	MEXICAN BONDS 03/02/28	18,000,000.000	18,328,140.000	
	MEXICAN BONDS 04/15/32	10,000,000.000	9,755,818.100	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	20,500,000.000	19,418,398.880	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,790,000.000	18,656,391.790	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	34,838,000.000	29,957,054.060	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	12,805,000.000	13,805,111.720	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	19,146,000.000	19,222,282.430	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	34,648,000.000	33,868,466.070	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	29,993,000.000	25,994,252.510	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	30,235,000.000	28,529,210.220	

	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	16,487,000.000	14,363,223.790	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	15,419,000.000	15,650,188.150	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,442,000.000	16,600,677.440	
メキシコ・ペソ 小計		346,626,000.000 (3,203,205,529)	332,495,038.330 (3,072,619,899)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,163,783.680	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,360,000.000	1,200,759.950	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	474,859.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	710,000.000	530,228.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,439,521.310	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	128,316.780	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,214,000.000	1,179,460.760	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	314,061.910	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	95,824.100	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	850,000.000	766,768.620	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	650,000.000	453,258.000	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	90,516.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	921,000.000	672,203.350	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	233,140.830	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,580,000.000	1,517,835.690	
	AUSTRIA 2.8 09/20/32	500,000.000	498,650.000	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,151,309.500	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	448,380.000	
	AUSTRIA 2.9 05/23/29	798,000.000	805,023.990	
	AUSTRIA 2.95 02/20/35	1,470,000.000	1,460,004.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	523,925.170	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	200,000.000	182,166.250	
	AUSTRIA 3.2 02/20/36	1,100,000.000	1,107,480.000	
	AUSTRIA 3.2 07/15/39	491,000.000	483,782.300	
	AUSTRIA 3.75 03/20/56	127,000.000	127,787.400	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	480,000.000	488,237.640	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	530,000.000	576,634.530	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	638,473.130	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	996,947.800	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	740,000.000	636,141.830	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	930,000.000	837,930.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	1,450,000.000	1,244,390.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	681,000.000	434,656.220	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	470,000.000	143,032.070	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	260,000.000	255,800.420	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	905,220.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,631,000.000	1,550,560.490	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,440,000.000	1,317,747.260	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	780,000.000	696,781.270	
	BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	844,749.090	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	600,960.110	

BELGIUM 1.7 06/22/50	1,020,000.000	641,081.090	
BELGIUM 1.9 06/22/38	400,000.000	334,686.400	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	268,785.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	254,649.390	
BELGIUM 2.6 10/22/30	500,000.000	496,112.890	
BELGIUM 2.7 10/22/29	850,000.000	850,735.670	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	291,058.250	
BELGIUM 2.85 10/22/34	2,070,000.000	2,014,985.890	
BELGIUM 3.0 06/22/33	800,000.000	796,892.330	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,180,000.000	1,166,478.810	
BELGIUM 3.1 06/22/35	800,000.000	787,255.820	
BELGIUM 3.3 06/22/54	620,000.000	524,774.660	
BELGIUM 3.4 06/22/36	1,623,000.000	1,620,972.010	
BELGIUM 3.45 06/22/42	660,000.000	625,172.460	
BELGIUM 3.45 06/22/43	640,000.000	602,739.790	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	619,411.080	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,140,000.000	1,205,066.860	
BELGIUM 4.25 03/28/41	880,000.000	925,486.660	
BELGIUM 4.35 06/22/56	380,000.000	383,394.920	
BELGIUM 5.0 03/28/35	870,000.000	983,335.940	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,678,601.430	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,580,000.000	2,541,816.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,050,000.000	2,020,111.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,300,000.000	1,285,856.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,200,000.000	1,187,148.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,200,000.000	2,188,428.000	
BUNDESOBL 2.2 10/10/30	800,000.000	788,416.000	
BUNDESOBL 2.4 04/18/30	1,900,000.000	1,890,272.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,000,000.000	1,995,500.000	
BUNDESOBL 2.5 10/11/29	1,500,000.000	1,498,920.000	
BUNDESSCHAT 1.7 06/10/27	1,457,000.000	1,446,640.730	
BUNDESSCHAT 2.0 12/16/27	300,000.000	297,840.000	
BUNDESSCHAT 2.1 03/15/28	700,000.000	695,163.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,845,916.400	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,340,000.000	1,192,774.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,800,000.000	1,557,278.100	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,260,000.000	983,946.600	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,441,000.000	1,842,027.420	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,230,000.000	2,012,195.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,690,000.000	2,427,644.300	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	650,000.000	570,459.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,100,000.000	1,843,723.350	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,540,000.000	1,130,560.350	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,140,000.000	509,203.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,927,000.000	801,670.540	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,566,621.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	852,000.000	804,168.720	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,630,000.000	1,539,145.430	

DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	57,000.000	54,415.050	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	2,053,750.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,592,000.000	1,557,636.000	
DEUTSCHLAND 08/15/29	190,000.000	175,955.820	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	3,709,000.000	2,963,936.080	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	3,040,000.000	2,043,474.310	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,980,000.000	1,876,901.400	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,167,000.000	837,929.340	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,400,000.000	1,008,378.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,700,000.000	1,676,812.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	2,900,000.000	2,792,787.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,150,000.000	3,077,487.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,327,000.000	3,251,044.590	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	2,100,000.000	2,085,720.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	3,800,000.000	3,715,070.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,950,000.000	1,906,944.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,320,000.000	2,073,894.400	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	1,970,446.770	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	1,860,000.000	1,558,363.800	
DEUTSCHLAND 2.5 11/15/32	1,600,000.000	1,584,448.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,000,000.000	930,820.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	803,000.000	748,532.510	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,476,000.000	1,465,343.280	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,700,000.000	1,679,311.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/35	1,102,000.000	1,082,582.760	
DEUTSCHLAND 2.9 02/15/36	2,352,000.000	2,361,596.160	
DEUTSCHLAND 2.9 08/15/56	1,100,000.000	995,313.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,480,000.000	1,484,514.000	
DEUTSCHLAND 3.4 05/15/47	500,000.000	504,770.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,230,000.000	1,350,483.050	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,080,000.000	1,215,216.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,055,000.000	1,101,462.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,320,000.000	1,510,040.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	1,903,857.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,720,000.000	1,932,798.400	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,140,000.000	2,238,418.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,640,000.000	1,842,900.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,250,000.000	1,299,925.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	110,000.000	98,333.870	
FINLAND 0.125 04/15/36	693,000.000	516,793.860	

FINLAND 0.125 04/15/52	660,000.000	267,063.090	
FINLAND 0.125 09/15/31	1,100,000.000	959,466.200	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	184,983.170	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	232,365.200	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	390,411.020	
FINLAND 0.5 09/15/28	530,000.000	507,128.000	
FINLAND 0.5 09/15/29	715,000.000	668,922.540	
FINLAND 0.75 04/15/31	500,000.000	455,654.870	
FINLAND 1.125 04/15/34	770,000.000	670,949.510	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	186,103.930	
FINLAND 1.5 09/15/32	750,000.000	691,446.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	400,000.000	355,146.520	
FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	349,190.790	
FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	321,381.710	
FINLAND 2.875 04/15/29	400,000.000	402,960.000	
FINLAND 2.95 04/15/55	251,000.000	214,429.300	
FINLAND 3.0 09/15/33	1,100,000.000	1,104,810.960	
FINLAND 3.0 09/15/34	300,000.000	299,359.800	
FINLAND 3.0 09/15/35	400,000.000	396,160.000	
FINLAND 3.2 04/15/45	200,000.000	188,040.000	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,590,000.000	2,998,727.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,610,000.000	3,288,123.370	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,980,000.000	3,510,958.990	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,870,000.000	1,592,479.840	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,369,293.060	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,250,000.000	796,122.090	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	1,790,000.000	464,567.650	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	3,790,000.000	2,076,541.000	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	5,680,000.000	5,506,902.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,290,000.000	4,139,635.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,000,000.000	449,016.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,156,000.000	503,216.910	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,000,000.000	3,821,068.990	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,730,000.000	2,336,711.400	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,067,000.000	2,477,522.600	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	4,000,000.000	3,039,600.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,280,000.000	4,001,101.340	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,620,000.000	1,539,236.220	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,075,000.000	1,056,687.840	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	3,050,000.000	2,408,610.920	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,334,209.500	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,650,000.000	2,474,576.620	
FRANCE OAT 2.4 09/24/28	700,000.000	695,653.000	
FRANCE OAT 2.4 09/24/29	847,000.000	836,920.700	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,606,296.720	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	2,150,000.000	1,743,818.220	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	4,300,000.000	4,294,066.000	
FRANCE OAT 2.7 02/25/31	4,200,000.000	4,158,012.600	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,710,000.000	3,712,425.220	

FRANCE OAT 2.75 02/25/30	4,300,000.000	4,289,976.700	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,840,000.000	4,847,937.600	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,120,000.000	3,077,267.690	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,550,000.000	1,210,030.750	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	2,150,000.000	1,761,591.750	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	3,200,000.000	3,106,864.000	
FRANCE OAT 3.2 05/25/35	2,050,000.000	2,009,621.880	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	996,000.000	883,900.690	
FRANCE OAT 3.25 05/25/55	1,300,000.000	1,060,041.450	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	8,700,000.000	8,820,200.940	
FRANCE OAT 3.5 11/25/35	1,000,000.000	998,000.000	
FRANCE OAT 3.6 05/25/42	1,300,000.000	1,235,910.000	
FRANCE OAT 3.75 05/25/56	1,600,000.000	1,427,310.770	
FRANCE OAT 3.8 06/25/37	1,000,000.000	1,012,400.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,436,916.170	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,060,000.000	1,904,072.420	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,340,000.000	1,369,064.600	
FRANCE OAT 4.4 05/25/57	1,450,000.000	1,448,840.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,190,000.000	1,265,288.920	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,668,000.000	6,227,457.100	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	3,760,811.250	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,526,000.000	1,753,038.580	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	316,080.350	
IRISH 0.4 05/15/35	820,000.000	659,120.830	
IRISH 0.55 04/22/41	610,000.000	414,576.740	
IRISH 0.9 05/15/28	810,000.000	786,997.300	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	701,111.880	
IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	263,512.560	
IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	509,939.770	
IRISH 1.5 05/15/50	624,000.000	424,713.410	
IRISH 1.7 05/15/37	547,000.000	476,831.240	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	678,290.760	
IRISH 2.4 05/15/30	970,000.000	962,743.150	
IRISH 2.6 10/18/34	771,000.000	754,498.670	
IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	266,121.020	
IRISH 3.15 10/18/55	200,000.000	183,960.170	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,402,914.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,792,080.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,520,000.000	1,349,797.240	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,510,000.000	1,373,326.490	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	2,786,000.000	2,127,668.200	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,500,000.000	1,327,200.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,250,235.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,880,000.000	1,844,468.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,430,000.000	1,282,405.410	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,753,746.790	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	2,003,000.000	1,661,087.900	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,210,000.000	794,849.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,845,190.680	

ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,340,000.000	1,269,880.810	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,670,000.000	1,005,107.870	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	875,725.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	960,000.000	951,021.600	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,691,389.500	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	860,000.000	512,732.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,060,000.000	702,886.000	
ITALY BTPS 2.2 02/28/28	1,996,000.000	1,980,830.400	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,590,000.000	2,582,929.300	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	750,000.000	665,700.000	
ITALY BTPS 2.35 01/15/29	200,000.000	198,140.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	980,000.000	931,157.780	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,180,000.000	855,382.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,700,000.000	1,635,570.000	
ITALY BTPS 2.65 06/15/28	442,000.000	441,867.400	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	320,000.000	320,160.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	550,000.000	437,140.000	
ITALY BTPS 2.7 10/01/30	1,000,000.000	991,200.000	
ITALY BTPS 2.7 10/15/27	1,500,000.000	1,505,100.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,200,000.000	855,120.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,800,000.000	1,802,160.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,946,459.030	
ITALY BTPS 2.85 02/01/31	2,500,000.000	2,487,750.000	
ITALY BTPS 2.95 07/01/30	1,200,000.000	1,202,640.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	720,000.000	660,960.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,710,000.000	1,722,807.900	
ITALY BTPS 3.0 10/01/29	1,000,000.000	1,005,550.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,560,000.000	1,432,852.200	
ITALY BTPS 3.15 03/15/33	1,800,000.000	1,791,180.000	
ITALY BTPS 3.15 11/15/31	1,400,000.000	1,406,720.000	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	694,000.000	662,353.600	
ITALY BTPS 3.25 07/15/32	2,300,000.000	2,314,030.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,206,038.450	
ITALY BTPS 3.25 11/15/32	2,100,000.000	2,108,190.000	
ITALY BTPS 3.3 06/15/33	1,300,000.000	1,303,380.000	
ITALY BTPS 3.35 07/01/29	1,400,000.000	1,422,400.000	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	2,050,000.000	2,076,240.000	
ITALY BTPS 3.45 02/01/36	620,000.000	615,040.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,140,000.000	1,017,323.630	
ITALY BTPS 3.45 07/15/27	1,200,000.000	1,210,560.000	
ITALY BTPS 3.45 07/15/31	2,500,000.000	2,551,500.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	396,000.000	404,989.200	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,300,000.000	2,354,529.090	
ITALY BTPS 3.6 10/01/35	2,000,000.000	2,012,600.000	
ITALY BTPS 3.65 08/01/35	1,900,000.000	1,922,230.000	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,700,000.000	1,750,830.000	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	300,000.000	306,810.000	
ITALY BTPS 3.85 02/01/35	1,000,000.000	1,029,600.000	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	1,280,000.000	1,321,728.000	

ITALY BTPS 3.85 10/01/40	1,600,000.000	1,585,600.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	2,300,000.000	2,376,820.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,240,000.000	1,283,400.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,106,000.000	1,152,230.800	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,400,000.000	1,467,200.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,042,900.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	900,000.000	929,880.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	827,040.000	
ITALY BTPS 4.1 04/30/46	1,000,000.000	991,100.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	1,260,000.000	1,297,422.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,300,000.000	1,375,010.000	
ITALY BTPS 4.3 10/01/54	900,000.000	890,640.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	1,400,000.000	1,495,480.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,300,000.000	1,392,820.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,730,000.000	1,808,196.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	1,270,000.000	1,299,845.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,480,000.000	1,544,459.180	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,583,519.940	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	860,000.000	958,384.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,590,000.000	1,781,118.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,050,000.000	1,176,210.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,860,000.000	2,140,302.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,560,000.000	1,771,692.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,111,907.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,240,000.000	1,164,983.720	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	240,000.000	168,171.840	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,646,000.000	692,807.550	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,081,679.390	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,300,000.000	1,139,372.390	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,160,000.000	1,083,080.400	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,160,000.000	817,624.620	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,800,000.000	1,580,040.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,300,000.000	1,277,373.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	630,000.000	608,386.270	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	890,000.000	665,737.290	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	580,000.000	578,360.040	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,093,912.210	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	250,000.000	245,442.250	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	2,000,000.000	1,950,800.000	
NETHERLANDS 2.5 07/15/35	888,000.000	859,584.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,351,000.000	1,226,462.110	
NETHERLANDS 2.75 07/15/36	430,000.000	422,107.350	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	590,000.000	583,728.000	

NETHERLANDS 3.5 01/15/56	490,000.000	497,448.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	990,000.000	1,045,644.710	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,520,000.000	2,746,296.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	490,000.000	512,736.000	
PORTUGUESE 0.3 10/17/31	514,000.000	452,671.830	
PORTUGUESE 1.0 04/12/52	50,000.000	27,030.920	
PORTUGUESE 1.15 04/11/42	600,000.000	424,627.620	
PORTUGUESE 1.95 06/15/29	500,000.000	490,900.000	
PORTUGUESE 2.125 10/17/28	1,900,000.000	1,884,745.980	
PORTUGUESE 2.25 04/18/34	2,400,000.000	2,274,082.270	
PORTUGUESE 2.875 10/14/33	500,000.000	496,450.000	
PORTUGUESE 2.875 10/20/34	400,000.000	394,675.000	
PORTUGUESE 3.0 06/15/35	501,000.000	496,353.820	
PORTUGUESE 3.375 06/15/40	400,000.000	392,710.590	
PORTUGUESE 3.625 06/12/54	50,000.000	47,645.000	
PORTUGUESE 3.875 02/15/30	98,000.000	102,189.500	
PORTUGUESE 4.1 02/15/45	400,000.000	419,800.000	
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	2,170,000.000	2,329,777.100	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.625 01/21/31	730,000.000	690,888.450	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 2.0 10/17/47	500,000.000	349,102.150	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625 01/16/29	200,000.000	204,338.000	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625 11/04/37	500,000.000	497,551.460	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/23/35	1,020,000.000	1,048,456.870	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 4.0 10/19/32	900,000.000	948,576.060	
SPAIN 0.0 01/31/28	2,680,000.000	2,574,300.800	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,700,000.000	2,488,795.240	
SPAIN 0.5 10/31/31	2,340,000.000	2,075,200.920	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,830,000.000	1,711,963.170	
SPAIN 0.7 04/30/32	2,150,000.000	1,902,769.950	
SPAIN 0.8 07/30/27	2,400,000.000	2,353,584.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,605,480.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,223,914.940	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,640,000.000	1,103,884.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,499,000.000	816,500.800	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,420,000.000	1,038,433.500	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,000,000.000	1,879,500.000	

	SPAIN 1.4 04/30/28	1,470,000.000	1,440,597.650	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,434,720.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	350,000.000	339,202.200	
	SPAIN 1.45 10/31/27	842,000.000	830,192.040	
	SPAIN 1.45 10/31/71	1,010,000.000	479,882.320	
	SPAIN 1.85 07/30/35	2,091,000.000	1,870,906.830	
	SPAIN 1.9 10/31/52	470,000.000	312,681.740	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,070,000.000	1,039,885.240	
	SPAIN 2.35 03/31/29	500,000.000	493,850.000	
	SPAIN 2.35 07/30/33	517,000.000	495,027.500	
	SPAIN 2.4 05/31/28	1,500,000.000	1,494,840.000	
	SPAIN 2.5 05/31/27	400,000.000	399,668.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,683,210.960	
	SPAIN 2.6 05/31/31	300,000.000	296,070.000	
	SPAIN 2.7 01/31/30	1,300,000.000	1,300,065.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,160,000.000	957,357.650	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,600,000.000	1,389,825.990	
	SPAIN 3.0 01/31/33	2,000,000.000	2,002,600.000	
	SPAIN 3.1 07/30/31	2,000,000.000	2,029,053.000	
	SPAIN 3.15 04/30/33	3,356,000.000	3,388,511.570	
	SPAIN 3.15 04/30/35	1,800,000.000	1,793,505.320	
	SPAIN 3.2 10/31/35	1,000,000.000	996,500.000	
	SPAIN 3.25 04/30/34	1,820,000.000	1,837,823.800	
	SPAIN 3.3 04/30/36	900,000.000	901,244.880	
	SPAIN 3.45 07/30/43	1,440,000.000	1,382,526.830	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	988,561.940	
	SPAIN 3.45 10/31/34	2,150,000.000	2,196,552.870	
	SPAIN 3.5 01/31/41	800,000.000	785,102.040	
	SPAIN 3.5 05/31/29	2,600,000.000	2,663,325.340	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,937,000.000	1,999,565.100	
	SPAIN 3.9 07/30/39	260,000.000	269,113.460	
	SPAIN 3.95 10/31/56	420,000.000	412,430.250	
	SPAIN 4.0 10/31/54	900,000.000	899,292.370	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,885,000.000	3,098,601.640	
	SPAIN 4.7 07/30/41	700,000.000	783,397.440	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,177,209.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,754,703.000		
SPAIN 5.15 10/31/44	1,110,000.000	1,308,715.750		
SPAIN 5.75 07/30/32	2,135,000.000	2,473,593.920		
SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,125,801.690		
ユーロ 小計		561,317,000.000 (103,394,591,400)	521,524,980.110 (96,064,901,336)	
韓国・ウォン	KOREA TREASURY BOND (TAX) 4.0 12/10/31	900,000,000.000	898,958,970.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.5 09/10/36	2,100,000,000.000	1,644,729,576.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.875 03/10/51	3,360,000,000.000	2,107,110,129.600	

	KOREA TREASURY BOND 2.0 03/10/49	700,000,000.000	465,813,173.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.375 12/10/28	2,500,000,000.000	2,425,533,075.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.625 03/10/30	900,000,000.000	861,396,687.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.625 09/10/55	2,000,000,000.000	1,443,509,660.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.75 12/10/28	1,400,000,000.000	1,370,483,940.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.875 09/10/44	2,000,000,000.000	1,639,740,120.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.0 12/10/34	900,000,000.000	831,251,700.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/29	1,000,000,000.000	987,896,690.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/53	3,000,000,000.000	2,474,540,040.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 12/10/35	1,500,000,000.000	1,399,437,060.000	
	KOREA TREASURY BOND 4.25 12/10/32	1,000,000,000.000	1,011,811,800.000	
	KOREA TREASURY BOND 4.75 12/10/30	1,830,000,000.000	1,888,771,914.000	
	韓国・ウォン 小計	25,090,000,000.000 (2,636,858,640)	21,450,984,534.600 (2,254,412,671)	
国債証券 合計		355,520,259,186.800 (355,520,259,187)	333,960,009,669 (333,960,009,669)	
合計			333,960,009,669 (333,960,009,669)	

(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 274銘柄	44.50	45.10
イギリス・ポンド	国債証券 66銘柄	5.60	5.68
イスラエル・シェケル	国債証券 13銘柄	0.42	0.43
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	1.27	1.29
オフショア・人民元	国債証券 80銘柄	12.52	12.69
カナダ・ドル	国債証券 41銘柄	2.06	2.09
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.36	0.36
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.17	0.17
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.19	0.20
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.27	0.28
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.16	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	0.70	0.71

マレーシア・リングgit	国債証券	25銘柄	0.48	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.91	0.92
ユーロ	国債証券	395銘柄	28.38	28.77
韓国・ウォン	国債証券	15銘柄	0.67	0.68

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	438,883,880
コール・ローン	999,309,382
国債証券	263,141,661,094
派生商品評価勘定	976,406,265
未収入金	2,681,647
未収利息	2,175,225,613
前払費用	378,679,284
流動資産合計	268,112,847,165
資産合計	268,112,847,165
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,271,214,829
未払金	261,981,588
未払解約金	315,543,000
流動負債合計	2,848,739,417
負債合計	2,848,739,417
純資産の部	
元本等	
元本	230,398,541,063
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	34,865,566,685
元本等合計	265,264,107,748
純資産合計	265,264,107,748
負債純資産合計	268,112,847,165

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月29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	231,642,030,114円
同期中追加設定元本額	83,663,561,281円
同期中一部解約元本額	84,907,050,332円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券＜為替ヘッジあり＞	14,120,256,478円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,063,009,036円
たわらノーロード バランス（標準型）	8,114,738,237円
たわらノーロード バランス（積極型）	5,476,754,638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）	71,868,311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）	2,555,152,542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）	3,360,347,939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）	519,588,314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）	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	5,921,761円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	32,839,445円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	303,805,528円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	40,551,107円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	91,804円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	157,152,462円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	458,581,413円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	49,154,213円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け）	16,117,502円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け）	5,459,304円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け）	2,178,446円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け）	871,639円

未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	28,030円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	21,842円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９８～２００２年生まれ向け）	20,990円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／２００３～２００７年生まれ向け）	32,240円
投資のソムリエ	66,144,919,262円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	14,629,181,538円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	18,773,716,125円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	30,702,606,558円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,581,987,196円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,455,671,751円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,351,185,490円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	672,355,641円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	212,489,668円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	5,739,492,296円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	9,677,642,538円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	7,846,371,972円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	1,980,548,731円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	795,301,321円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	444,821,305円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	194,676,004円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	10,636,402円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	7,444,389円
ハイブリッドストラテジーマルチアセットファンド（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	211,640,212円
外国債券パッシブファンド２（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	19,092,724,595円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	8,107,446,650円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	312,473,958円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	48,356,620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）	244,004,857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）	29,401,479円
DIAM世界アセットバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	147,055,996円
DIAM世界アセットバランスファンド３VA（適格機関投資家限定）	276,172,707円
DIAM世界アセットバランスファンド４VA（適格機関投資家限定）	353,499,188円
計	230,398,541,063円
２． 受益権の総数	230,398,541,063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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,282,107,683
合計	1,282,107,683

（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（2026年6月23日から2026年6月29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	2026年6月29日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	263,985,822,250	—	265,280,630,814	△1,294,808,564
アメリカ・ドル	117,279,711,631	—	119,179,882,904	△1,900,171,273
イギリス・ポンド	15,000,104,702	—	14,959,873,333	40,231,369
イスラエル・シェケル	1,240,541,499	—	1,179,937,308	60,604,191
オーストラリア・ドル	3,517,664,542	—	3,429,559,892	88,104,650
オフショア・人民元	33,557,034,320	—	33,890,885,680	△333,851,360
カナダ・ドル	5,607,938,335	—	5,536,069,288	71,869,047
シンガポール・ドル	983,766,505	—	985,338,774	△1,572,269
スウェーデン・クローナ	477,214,884	—	460,166,151	17,048,733
デンマーク・クローネ	541,832,058	—	537,542,246	4,289,812
ニュージーランド・ドル	763,987,427	—	731,591,618	32,395,809
ノルウェー・クローネ	443,584,123	—	419,547,354	24,036,769
ポーランド・ズロチ	1,947,664,364	—	1,907,669,921	39,994,443
マレーシア・リンギット	1,345,381,679	—	1,331,192,961	14,188,718
メキシコ・ペソ	2,453,571,398	—	2,480,774,464	△27,203,066
ユーロ	76,888,084,151	—	76,320,538,912	567,545,239
韓国・ウォン	1,937,740,632	—	1,930,060,008	7,680,624
合計	263,985,822,250	—	265,280,630,814	△1,294,808,564

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額	1.1513円
（1万口当たり純資産額）	（11,513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

2026年6月29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 0.375 07/31/27	2,600,000.000	2,498,539.050	
		US T N/B 0.375 09/30/27	2,820,000.000	2,693,760.950	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,600,000.000	2,517,656.670	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,500,000.000	2,413,713.470	
		US T N/B 0.5 08/31/27	2,900,000.000	2,782,470.710	
		US T N/B 0.5 10/31/27	1,300,000.000	1,239,824.220	
		US T N/B 0.625 05/15/30	1,690,000.000	1,480,664.440	
		US T N/B 0.625 08/15/30	5,190,000.000	4,508,407.040	
		US T N/B 0.625 11/30/27	2,200,000.000	2,095,714.850	
		US T N/B 0.625 12/31/27	2,860,000.000	2,716,664.830	
		US T N/B 0.75 01/31/28	870,000.000	825,684.370	
		US T N/B 0.875 11/15/30	2,690,000.000	2,343,504.880	
		US T N/B 1.0 07/31/28	7,770,000.000	7,294,239.240	
		US T N/B 1.125 02/15/31	4,000,000.000	3,502,265.640	
		US T N/B 1.125 02/29/28	1,520,000.000	1,447,859.370	
		US T N/B 1.125 05/15/40	1,500,000.000	958,359.370	
		US T N/B 1.125 08/15/40	1,060,000.000	670,325.770	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,970,000.000	3,727,302.740	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,500,000.000	3,333,066.400	
		US T N/B 1.25 04/30/28	2,600,000.000	2,470,355.470	
		US T N/B 1.25 05/15/50	2,700,000.000	1,301,589.820	
		US T N/B 1.25 05/31/28	3,140,000.000	2,976,437.900	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,570,000.000	3,376,648.220	
		US T N/B 1.25 08/15/31	2,000,000.000	1,735,000.000	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,250,000.000	3,052,778.330	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,300,000.000	2,137,066.410	
		US T N/B 1.375 10/31/28	2,300,000.000	2,161,640.620	
		US T N/B 1.375 11/15/31	2,800,000.000	2,427,796.860	
		US T N/B 1.375 11/15/40	1,730,000.000	1,129,838.670	
		US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	3,275,644.540	
		US T N/B 1.5 02/15/30	1,500,000.000	1,369,746.090	
		US T N/B 1.5 11/30/28	3,840,000.000	3,612,525.000	
		US T N/B 1.625 05/15/31	2,950,000.000	2,626,133.770	
		US T N/B 1.625 08/15/29	1,200,000.000	1,114,359.370	
		US T N/B 1.625 11/15/50	2,400,000.000	1,270,781.240	
		US T N/B 1.75 01/31/29	1,600,000.000	1,508,531.240	
		US T N/B 1.75 08/15/41	500,000.000	338,486.330	
		US T N/B 1.75 11/15/29	3,000,000.000	2,780,976.570	
		US T N/B 1.875 02/15/32	4,780,000.000	4,233,474.200	
		US T N/B 1.875 02/15/41	2,900,000.000	2,031,359.370	

US T N/B 1.875 02/15/51	2,000,000.000	1,125,742.170	
US T N/B 1.875 02/28/29	2,600,000.000	2,455,527.330	
US T N/B 1.875 11/15/51	2,500,000.000	1,391,503.900	
US T N/B 2.0 02/15/50	1,000,000.000	589,746.090	
US T N/B 2.0 08/15/51	1,300,000.000	749,683.590	
US T N/B 2.0 11/15/41	1,200,000.000	839,695.300	
US T N/B 2.25 02/15/52	4,370,000.000	2,664,419.720	
US T N/B 2.25 05/15/41	1,000,000.000	736,191.400	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,900,000.000	2,842,056.630	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	2,968,945.290	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,890,000.000	1,818,442.180	
US T N/B 2.25 11/15/27	2,140,000.000	2,087,712.110	
US T N/B 2.375 02/15/42	1,000,000.000	736,699.220	
US T N/B 2.375 03/31/29	2,200,000.000	2,102,503.890	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,320,000.000	3,167,228.140	
US T N/B 2.375 05/15/51	1,180,000.000	746,787.880	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,880,000.000	1,856,137.490	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,110,000.000	1,495,627.330	
US T N/B 2.5 02/15/46	900,000.000	627,398.440	
US T N/B 2.5 05/15/46	800,000.000	555,750.000	
US T N/B 2.625 02/15/29	1,400,000.000	1,349,222.650	
US T N/B 2.625 05/31/27	3,300,000.000	3,258,011.280	
US T N/B 2.625 07/31/29	7,600,000.000	7,279,820.270	
US T N/B 2.75 02/15/28	2,200,000.000	2,153,679.680	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,900,000.000	3,757,482.410	
US T N/B 2.75 07/31/27	2,150,000.000	2,119,933.580	
US T N/B 2.75 08/15/32	3,580,000.000	3,301,920.700	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,080,000.000	833,456.250	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,300,000.000	929,449.220	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,500,000.000	1,151,660.160	
US T N/B 2.75 11/15/47	800,000.000	570,343.740	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,150,000.000	3,048,178.700	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,440,000.000	3,364,951.540	
US T N/B 2.875 05/15/32	2,500,000.000	2,330,664.050	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,590,000.000	1,232,933.200	
US T N/B 2.875 05/15/49	2,700,000.000	1,938,410.150	
US T N/B 2.875 05/15/52	3,900,000.000	2,729,619.120	
US T N/B 2.875 08/15/28	2,900,000.000	2,828,689.460	
US T N/B 2.875 08/15/45	500,000.000	375,000.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	2,550,000.000	1,883,015.620	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,390,000.000	1,045,594.910	
US T N/B 3.0 02/15/48	1,700,000.000	1,265,171.870	
US T N/B 3.0 02/15/49	2,100,000.000	1,547,847.640	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,200,000.000	964,546.870	
US T N/B 3.0 05/15/45	2,500,000.000	1,920,800.770	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,200,000.000	900,421.870	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,010,000.000	1,488,342.180	
US T N/B 3.0 08/15/52	3,200,000.000	2,295,875.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,500,000.000	1,159,042.960	

US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	763,203.120	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,000,000.000	820,859.380	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,260,000.000	1,017,597.650	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,220,000.000	1,685,812.500	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,000,000.000	1,581,484.380	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,000,000.000	2,913,750.000	
US T N/B 3.125 11/15/28	3,210,000.000	3,140,408.180	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,280,000.000	1,055,350.000	
US T N/B 3.25 05/15/42	1,550,000.000	1,288,467.770	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,390,000.000	3,363,443.580	
US T N/B 3.25 06/30/29	1,000,000.000	976,445.310	
US T N/B 3.375 02/29/28	7,000,000.000	6,920,429.670	
US T N/B 3.375 05/15/33	2,900,000.000	2,751,601.540	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,800,000.000	1,483,031.250	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,300,000.000	1,937,794.910	
US T N/B 3.375 09/15/28	5,600,000.000	5,515,015.630	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,550,000.000	2,015,496.080	
US T N/B 3.5 01/15/29	5,200,000.000	5,125,453.110	
US T N/B 3.5 01/31/28	5,900,000.000	5,845,609.370	
US T N/B 3.5 01/31/30	1,500,000.000	1,469,970.700	
US T N/B 3.5 02/15/29	4,500,000.000	4,433,554.710	
US T N/B 3.5 02/15/33	1,600,000.000	1,533,562.490	
US T N/B 3.5 02/15/39	700,000.000	634,812.500	
US T N/B 3.5 02/28/31	2,000,000.000	1,947,812.500	
US T N/B 3.5 03/15/29	2,200,000.000	2,167,000.000	
US T N/B 3.5 04/30/28	2,800,000.000	2,770,687.500	
US T N/B 3.5 04/30/30	1,900,000.000	1,859,179.670	
US T N/B 3.5 09/30/27	1,000,000.000	993,007.810	
US T N/B 3.5 09/30/29	2,700,000.000	2,651,115.230	
US T N/B 3.5 10/15/28	2,800,000.000	2,763,250.000	
US T N/B 3.5 10/31/27	2,000,000.000	1,984,453.120	
US T N/B 3.5 11/15/28	2,800,000.000	2,762,375.000	
US T N/B 3.5 11/30/30	3,400,000.000	3,315,265.600	
US T N/B 3.5 12/15/28	2,000,000.000	1,972,343.760	
US T N/B 3.625 02/15/44	2,000,000.000	1,711,796.880	
US T N/B 3.625 02/15/53	4,350,000.000	3,518,062.500	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,000,000.000	2,976,210.930	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,600,000.000	2,556,582.020	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,880,000.000	3,135,979.690	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,650,000.000	2,627,278.310	
US T N/B 3.625 08/15/28	1,600,000.000	1,584,750.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,800,000.000	1,548,843.740	
US T N/B 3.625 08/31/27	200,000.000	198,968.750	
US T N/B 3.625 08/31/29	2,000,000.000	1,972,187.500	
US T N/B 3.625 08/31/30	2,300,000.000	2,256,695.320	
US T N/B 3.625 09/30/30	2,300,000.000	2,256,201.160	
US T N/B 3.625 09/30/31	2,500,000.000	2,439,257.800	
US T N/B 3.625 10/31/30	7,200,000.000	7,059,093.760	
US T N/B 3.625 12/31/30	1,600,000.000	1,567,406.250	

US T N/B 3.75 01/31/31	4,500,000.000	4,429,687.500	
US T N/B 3.75 02/28/33	2,000,000.000	1,945,937.500	
US T N/B 3.75 04/15/28	3,000,000.000	2,982,070.320	
US T N/B 3.75 05/15/28	3,500,000.000	3,478,261.710	
US T N/B 3.75 05/31/30	2,200,000.000	2,171,382.810	
US T N/B 3.75 06/30/27	5,500,000.000	5,483,905.070	
US T N/B 3.75 06/30/30	2,500,000.000	2,466,406.250	
US T N/B 3.75 08/15/27	3,200,000.000	3,188,499.990	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	896,875.000	
US T N/B 3.75 08/31/31	3,500,000.000	3,436,083.980	
US T N/B 3.75 10/31/32	1,500,000.000	1,462,119.130	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	873,007.810	
US T N/B 3.75 11/30/32	3,000,000.000	2,922,714.840	
US T N/B 3.75 12/31/28	3,200,000.000	3,173,562.490	
US T N/B 3.75 12/31/30	2,390,000.000	2,353,309.770	
US T N/B 3.875 02/15/43	2,500,000.000	2,236,816.400	
US T N/B 3.875 03/15/28	1,000,000.000	996,406.250	
US T N/B 3.875 03/31/31	4,000,000.000	3,956,796.880	
US T N/B 3.875 04/15/29	4,500,000.000	4,474,511.730	
US T N/B 3.875 04/30/30	3,900,000.000	3,868,007.830	
US T N/B 3.875 04/30/31	2,500,000.000	2,472,460.950	
US T N/B 3.875 05/15/29	4,000,000.000	3,977,031.240	
US T N/B 3.875 05/15/43	1,900,000.000	1,695,824.210	
US T N/B 3.875 05/31/27	3,000,000.000	2,995,580.880	
US T N/B 3.875 06/15/28	2,500,000.000	2,489,892.560	
US T N/B 3.875 06/30/30	3,900,000.000	3,865,722.660	
US T N/B 3.875 07/15/28	4,400,000.000	4,380,664.060	
US T N/B 3.875 07/31/27	5,000,000.000	4,989,648.450	
US T N/B 3.875 07/31/30	3,000,000.000	2,973,281.250	
US T N/B 3.875 08/15/33	5,100,000.000	4,983,556.630	
US T N/B 3.875 08/15/34	3,500,000.000	3,398,349.600	
US T N/B 3.875 08/15/40	600,000.000	552,093.750	
US T N/B 3.875 08/31/32	4,200,000.000	4,126,910.170	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,500,000.000	2,483,349.600	
US T N/B 3.875 09/30/32	5,500,000.000	5,401,923.830	
US T N/B 3.875 10/15/27	1,000,000.000	997,402.340	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,100,000.000	2,084,742.190	
US T N/B 3.875 12/31/27	2,800,000.000	2,790,812.500	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,500,000.000	2,481,494.150	
US T N/B 3.875 12/31/32	2,500,000.000	2,451,953.120	
US T N/B 4.0 01/31/29	3,600,000.000	3,591,140.610	
US T N/B 4.0 01/31/31	1,500,000.000	1,491,943.360	
US T N/B 4.0 01/31/33	4,000,000.000	3,950,000.000	
US T N/B 4.0 02/15/34	5,500,000.000	5,400,742.150	
US T N/B 4.0 02/28/30	5,100,000.000	5,082,070.330	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,100,000.000	3,095,519.530	
US T N/B 4.0 03/31/30	2,000,000.000	1,992,617.180	
US T N/B 4.0 04/30/32	2,000,000.000	1,981,679.680	
US T N/B 4.0 05/31/30	2,000,000.000	1,991,992.180	

US T N/B 4.0 06/30/28	2,800,000.000	2,795,187.500	
US T N/B 4.0 06/30/32	2,000,000.000	1,980,390.620	
US T N/B 4.0 07/31/29	1,210,000.000	1,206,715.040	
US T N/B 4.0 07/31/30	2,500,000.000	2,489,160.150	
US T N/B 4.0 07/31/32	3,000,000.000	2,969,121.090	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,400,000.000	2,392,312.510	
US T N/B 4.0 11/15/35	5,100,000.000	4,960,546.870	
US T N/B 4.0 11/15/42	2,500,000.000	2,277,734.370	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,170,000.000	3,607,294.310	
US T N/B 4.0 12/15/27	1,500,000.000	1,498,066.410	
US T N/B 4.125 02/15/36	8,800,000.000	8,636,375.000	
US T N/B 4.125 02/29/32	2,500,000.000	2,494,531.250	
US T N/B 4.125 03/31/29	5,000,000.000	5,003,808.600	
US T N/B 4.125 03/31/31	1,753,000.000	1,752,486.410	
US T N/B 4.125 03/31/32	3,700,000.000	3,691,111.340	
US T N/B 4.125 04/30/33	1,000,000.000	993,593.750	
US T N/B 4.125 05/31/32	2,700,000.000	2,691,615.220	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,600,000.000	2,601,675.760	
US T N/B 4.125 07/31/31	3,000,000.000	2,998,300.770	
US T N/B 4.125 08/15/44	2,000,000.000	1,826,835.930	
US T N/B 4.125 08/15/53	3,950,000.000	3,488,729.500	
US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,500,244.150	
US T N/B 4.125 09/30/27	2,580,000.000	2,581,410.950	
US T N/B 4.125 10/31/27	1,500,000.000	1,500,468.750	
US T N/B 4.125 10/31/29	4,000,000.000	4,002,812.480	
US T N/B 4.125 10/31/31	2,500,000.000	2,496,728.520	
US T N/B 4.125 11/15/27	2,800,000.000	2,801,039.040	
US T N/B 4.125 11/15/32	4,200,000.000	4,180,968.740	
US T N/B 4.125 11/30/29	6,000,000.000	6,004,687.500	
US T N/B 4.125 11/30/31	2,500,000.000	2,496,191.400	
US T N/B 4.25 01/15/28	3,000,000.000	3,006,445.310	
US T N/B 4.25 01/31/30	3,700,000.000	3,717,271.480	
US T N/B 4.25 02/15/28	2,000,000.000	2,004,570.320	
US T N/B 4.25 02/15/54	3,800,000.000	3,428,386.700	
US T N/B 4.25 02/28/29	2,500,000.000	2,509,912.100	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,400,000.000	2,412,328.120	
US T N/B 4.25 03/31/33	2,000,000.000	2,003,085.940	
US T N/B 4.25 05/15/35	4,800,000.000	4,769,343.730	
US T N/B 4.25 05/15/39	600,000.000	584,132.800	
US T N/B 4.25 06/30/29	2,900,000.000	2,912,404.280	
US T N/B 4.25 06/30/31	2,500,000.000	2,512,597.650	
US T N/B 4.25 08/15/35	5,000,000.000	4,963,671.900	
US T N/B 4.25 08/15/54	4,700,000.000	4,243,035.160	
US T N/B 4.25 11/15/34	8,300,000.000	8,261,580.040	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	956,953.120	
US T N/B 4.375 01/31/32	2,500,000.000	2,525,683.600	
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	599,015.620	
US T N/B 4.375 05/15/34	4,100,000.000	4,123,062.500	
US T N/B 4.375 05/15/36	3,000,000.000	3,001,171.860	

US T N/B 4.375 05/15/40	1,300,000.000	1,266,941.390	
US T N/B 4.375 05/15/41	300,000.000	290,003.900	
US T N/B 4.375 07/15/27	2,400,000.000	2,407,793.880	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,700,000.000	2,563,523.420	
US T N/B 4.375 08/31/28	2,500,000.000	2,514,355.470	
US T N/B 4.375 11/15/39	760,000.000	744,235.930	
US T N/B 4.375 11/30/28	2,700,000.000	2,717,085.920	
US T N/B 4.375 11/30/30	2,600,000.000	2,626,152.330	
US T N/B 4.375 12/31/29	4,100,000.000	4,136,275.400	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,630,000.000	2,678,285.150	
US T N/B 4.5 02/15/44	1,000,000.000	961,621.090	
US T N/B 4.5 05/31/29	3,000,000.000	3,033,164.070	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,830,000.000	1,819,348.830	
US T N/B 4.5 11/15/33	6,100,000.000	6,191,261.730	
US T N/B 4.5 11/15/54	5,600,000.000	5,270,781.250	
US T N/B 4.5 12/31/31	2,500,000.000	2,541,748.050	
US T N/B 4.625 02/15/35	7,600,000.000	7,762,539.070	
US T N/B 4.625 02/15/40	900,000.000	902,179.690	
US T N/B 4.625 02/15/46	1,500,000.000	1,454,062.500	
US T N/B 4.625 02/15/55	2,500,000.000	2,401,855.470	
US T N/B 4.625 04/30/29	3,500,000.000	3,549,150.390	
US T N/B 4.625 04/30/31	2,100,000.000	2,144,912.100	
US T N/B 4.625 05/15/44	1,000,000.000	975,703.120	
US T N/B 4.625 05/15/54	4,500,000.000	4,320,615.240	
US T N/B 4.625 05/31/31	7,500,000.000	7,661,718.750	
US T N/B 4.625 06/15/27	2,800,000.000	2,815,334.610	
US T N/B 4.625 09/30/28	1,500,000.000	1,516,904.290	
US T N/B 4.625 09/30/30	2,500,000.000	2,548,779.300	
US T N/B 4.625 11/15/44	1,400,000.000	1,362,648.430	
US T N/B 4.625 11/15/45	5,500,000.000	5,335,000.000	
US T N/B 4.625 11/15/55	1,500,000.000	1,442,578.120	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,400,000.000	1,412,304.680	
US T N/B 4.75 02/15/45	2,200,000.000	2,173,187.500	
US T N/B 4.75 02/15/56	2,300,000.000	2,258,671.860	
US T N/B 4.75 05/15/55	2,700,000.000	2,647,371.080	
US T N/B 4.75 08/15/55	2,400,000.000	2,353,968.740	
US T N/B 4.75 11/15/43	2,500,000.000	2,482,958.970	
US T N/B 4.75 11/15/53	4,230,000.000	4,137,468.750	
US T N/B 4.875 08/15/45	1,000,000.000	1,002,070.310	
US T N/B 4.875 10/31/28	9,300,000.000	9,458,208.990	
US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,574,023.450	
US T N/B 5.0 05/15/37	300,000.000	316,933.590	
US T N/B 5.0 05/15/45	1,000,000.000	1,018,320.310	
US T N/B 5.25 11/15/28	2,100,000.000	2,155,617.190	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,053,593.750	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,500,000.000	2,569,921.870	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,600,000.000	2,797,539.050	
アメリカ・ドル 小計	779,473,000.000 (126,087,552,480)	732,222,314.170 (118,444,281,539)	

イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.125 01/31/28	930,000.000	876,799.870	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,250,000.000	1,845,537.770	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,752,000.000	1,492,653.910	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,650,000.000	1,507,337.310	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	870,000.000	209,982.020	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,950,000.000	1,369,594.000	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	780,000.000	277,047.140	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,070,000.000	490,208.870	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,530,000.000	1,196,762.700	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,550,000.000	1,396,210.020	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	1,200,000.000	1,002,979.750	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,720,000.000	1,105,792.030	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	870,000.000	257,135.130	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,410,000.000	1,369,889.560	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	780,000.000	332,719.610	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,230,000.000	726,508.820	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	950,000.000	485,220.730	
	UK TREASURY 1.5 07/31/53	2,800,000.000	1,234,569.560	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,150,000.000	1,089,095.400	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,200,000.000	539,812.050	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	900,000.000	471,482.650	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	950,000.000	426,697.080	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,050,000.000	769,505.260	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,070,000.000	569,874.150	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,300,000.000	995,477.140	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	1,700,000.000	1,585,356.140	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,000,000.000	784,770.450	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	400,000.000	275,960.000	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,050,000.000	939,898.340	

UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,120,000.000	857,281.830	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,670,000.000	1,264,186.430	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	970,000.000	758,540.000	
UK TREASURY 4.0 05/22/29	1,000,000.000	995,297.720	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	2,050,000.000	2,019,974.260	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,050,000.000	812,910.000	
UK TREASURY 4.125 03/07/31	1,000,000.000	993,796.980	
UK TREASURY 4.125 03/07/33	1,200,000.000	1,177,692.030	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	2,490,000.000	2,486,779.500	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,600,000.000	1,537,328.480	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,020,000.000	1,016,185.000	
UK TREASURY 4.25 07/31/34	1,600,000.000	1,562,506.950	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	850,658.060	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,090,000.000	1,093,189.340	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,040,000.000	949,433.640	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	730,000.000	629,163.930	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	950,000.000	804,110.790	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	841,918.220	
UK TREASURY 4.375 01/31/40	1,650,000.000	1,537,729.140	
UK TREASURY 4.375 03/07/28	2,220,000.000	2,229,382.600	
UK TREASURY 4.375 03/07/30	1,300,000.000	1,307,299.500	
UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,500,000.000	1,265,220.020	
UK TREASURY 4.5 03/07/35	2,630,000.000	2,598,273.260	
UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,230,000.000	1,238,919.960	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,750,000.000	1,739,521.520	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	880,000.000	809,757.140	
UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,030,000.000	1,034,778.270	
UK TREASURY 4.625 03/07/37	1,300,000.000	1,274,051.480	
UK TREASURY 4.75 10/22/35	1,350,000.000	1,351,614.600	

	UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,990,000.000	1,867,615.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	1,740,442.480	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	530,000.000	518,979.410	
	UK TREASURY 4.875 07/31/36	930,000.000	935,187.160	
	UK TREASURY 5.25 01/31/41	800,000.000	809,551.280	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,100,000.000	1,150,074.970	
イギリス・ポンド 小計		83,472,000.000 (17,822,106,720)	69,684,228.410 (14,878,279,608)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,450,000.000	1,466,882.350	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	2,960,000.000	3,041,154.320	
	ISRAEL FIXED BOND 07/31/28	1,300,000.000	1,321,780.200	
	ISRAEL FIXED BOND 07/31/31	1,000,000.000	1,017,131.000	
	ISRAEL FIXED BOND 08/31/29	1,500,000.000	1,557,171.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,810,000.000	1,663,022.570	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,490,000.000	1,324,203.230	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,655,000.000	2,115,575.680	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,620,000.000	1,241,660.340	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,300,000.000	1,271,284.300	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,820,000.000	1,721,157.620	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	2,000,000.000	2,012,324.000	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,475,000.000	1,739,256.570	
イスラエル・シュケル 小計		22,380,000.000 (1,205,957,490)	21,492,603.180 (1,158,139,669)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,190,000.000	996,720.200	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	730,000.000	630,997.400	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,580,000.000	1,320,105.800	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,390,000.000	2,084,414.600	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,010,000.000	519,089.500	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,100,000.000	1,782,081.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	900,000.000	864,999.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,890,000.000	1,766,072.700	

	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	800,000.000	614,256.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	2,000,000.000	1,718,920.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,260,000.000	1,231,108.200	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,200,000.000	1,156,176.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,670,000.000	1,586,349.700	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	770,000.000	558,827.500	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,150,000.000	1,037,794.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,600,000.000	1,553,536.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	920,000.000	777,142.400	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,780,000.000	1,637,956.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	800,000.000	731,536.000	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,370,000.000	1,292,978.600	
	AUSTRALIAN 4.25 03/21/36	1,080,000.000	1,040,796.000	
	AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	580,000.000	566,074.200	
	AUSTRALIAN 4.25 10/21/36	750,000.000	720,030.000	
	AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	1,360,000.000	1,313,052.800	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	960,000.000	958,771.200	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	670,000.000	620,600.900	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/37	1,560,000.000	1,554,836.400	
オーストラリア・ドル 小計		34,070,000.000 (3,794,035,200)	30,635,222.600 (3,411,538,389)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.32 02/25/29	22,000,000.000	22,039,657.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.4 11/25/28	12,000,000.000	12,037,807.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28	53,000,000.000	53,169,282.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27	10,000,000.000	10,032,756.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30	54,000,000.000	54,158,274.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	30,000,000.000	30,125,814.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28	42,000,000.000	42,193,582.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.49 12/25/31	20,500,000.000	20,497,340.330	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.54 01/25/31	35,000,000.000	35,176,634.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.55 07/25/30	5,000,000.000	5,039,376.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35	38,000,000.000	37,814,167.080	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	63,500,000.000	63,842,379.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30	36,000,000.000	36,318,639.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.65 05/15/35	9,000,000.000	8,980,515.090	

CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 03/25/33	5,000,000.000	5,033,801.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 12/25/32	5,000,000.000	5,032,924.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 05/25/35	10,000,000.000	9,992,231.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.74 10/15/29	18,000,000.000	18,233,717.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.75 02/25/36	14,000,000.000	14,022,579.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32	39,000,000.000	39,588,588.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 11/15/35	11,000,000.000	11,041,886.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32	43,000,000.000	43,699,825.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.83 08/25/35	12,000,000.000	12,100,788.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	12,500,000.000	12,760,392.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	11,000,000.000	11,200,289.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.92 01/15/55	13,000,000.000	12,105,761.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 11/25/34	20,000,000.000	20,616,652.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	29,000,000.000	29,619,460.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	30,000,000.000	31,128,648.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	39,000,000.000	40,271,220.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	28,500,000.000	29,903,528.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	7,000,000.000	7,274,453.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	26,500,000.000	27,957,537.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	13,000,000.000	13,368,812.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.38 01/15/56	3,500,000.000	3,592,610.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	15,000,000.000	15,234,712.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	7,500,000.000	7,714,813.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,500,000.000	20,776,354.350	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	5,000,000.000	5,326,493.000	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	22,500,000.000	23,613,079.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	20,500,000.000	21,125,910.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,500,000.000	15,427,137.250	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	11,000,000.000	11,547,871.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	10,500,000.000	10,779,205.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	12,220,000.000	12,820,071.650	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	7,590,000.000	7,912,625.090	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	28,100,000.000	30,263,298.170	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	39,000,000.000	40,922,688.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	10,500,000.000	11,200,641.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	5,000,000.000	5,345,280.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	8,400,000.000	8,767,557.960	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	2,300,000.000	2,464,301.420	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	8,000,000.000	8,409,366.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	13,000,000.000	13,558,853.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	29,500,000.000	31,130,143.450	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	3,000,000.000	3,238,275.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	36,000,000.000	36,629,622.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	15,000,000.000	16,320,624.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	7,000,000.000	7,534,245.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	42,000,000.000	43,690,063.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	14,500,000.000	16,795,541.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	12,000,000.000	12,441,648.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	4,000,000.000	4,317,070.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	6,800,000.000	7,991,131.520	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	7,600,000.000	9,036,866.640	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	13,500,000.000	13,955,468.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	6,900,000.000	8,369,860.770	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	19,000,000.000	22,976,996.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	9,000,000.000	11,255,007.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.69 05/17/28	10,000,000.000	10,527,978.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	5,800,000.000	7,416,065.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	15,000,000.000	19,299,492.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	15,800,000.000	20,388,433.760	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	4,000,000.000	5,308,277.200	
オフショア・人民元 小計		1,357,510,000.000 (32,271,406,475)	1,411,805,005.430 (33,562,134,492)	
カナダ・ドル	CANADA 0.5 12/01/30	2,070,000.000	1,859,264.010	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,140,000.000	1,124,516.450	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,720,000.000	1,611,919.870	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,530,000.000	1,423,114.370	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,250,000.000	1,152,235.140	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,650,000.000	1,076,488.490	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,030,000.000	1,015,827.740	
	CANADA 2.0 06/01/32	900,000.000	846,176.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,860,000.000	1,319,075.390	
	CANADA 2.25 02/01/28	1,200,000.000	1,191,489.870	
	CANADA 2.25 06/01/29	940,000.000	924,652.420	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,000,000.000	978,985.250	
	CANADA 2.5 05/01/28	1,900,000.000	1,891,676.130	
	CANADA 2.5 11/01/27	300,000.000	299,378.040	
	CANADA 2.5 12/01/32	2,000,000.000	1,924,852.550	
	CANADA 2.75 03/01/30	1,000,000.000	993,402.280	
	CANADA 2.75 03/01/31	1,900,000.000	1,878,068.840	
	CANADA 2.75 06/01/33	400,000.000	389,348.880	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,100,000.000	1,101,787.590	
	CANADA 2.75 09/01/30	630,000.000	624,292.080	
	CANADA 2.75 12/01/48	550,000.000	468,386.340	
	CANADA 2.75 12/01/55	1,460,000.000	1,189,900.360	
	CANADA 2.75 12/01/64	1,060,000.000	835,979.720	
	CANADA 3.0 03/01/32	500,000.000	497,866.350	
	CANADA 3.0 06/01/34	1,570,000.000	1,543,339.550	
	CANADA 3.25 06/01/35	2,150,000.000	2,139,532.110	
	CANADA 3.25 06/01/36	1,000,000.000	988,434.720	

	CANADA 3.25 09/01/28	1,650,000.000	1,666,040.370	
	CANADA 3.25 12/01/34	1,570,000.000	1,566,918.870	
	CANADA 3.25 12/01/35	2,650,000.000	2,628,067.820	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,500,000.000	1,519,138.580	
	CANADA 3.5 03/01/34	700,000.000	713,134.030	
	CANADA 3.5 09/01/29	1,400,000.000	1,425,406.640	
	CANADA 3.5 12/01/45	650,000.000	634,892.250	
	CANADA 3.5 12/01/57	810,000.000	766,085.090	
	CANADA 4.0 03/01/29	2,090,000.000	2,151,575.150	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	598,406.320	
	CANADA 5.0 06/01/37	750,000.000	856,497.900	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,050,000.000	1,134,737.010	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,000,000.000	1,158,634.570	
カナダ・ドル 小計		50,200,000.000 (5,720,792,000)	48,109,525.140 (5,482,561,485)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 07/01/31	240,000.000	238,549.800	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	310,000.000	299,383.480	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	260,000.000	250,984.330	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	660,000.000	674,701.500	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	540,000.000	558,061.540	
	SINGAPORE 2.5 04/01/30	420,000.000	433,098.120	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	230,000.000	234,491.640	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	350,000.000	365,335.900	
	SINGAPORE 2.75 03/01/35	180,000.000	191,102.090	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	490,000.000	543,828.950	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	430,000.000	470,341.560	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	230,000.000	238,236.590	
	SINGAPORE 2.875 08/01/28	830,000.000	852,322.850	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	700,000.000	733,498.500	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	300,000.000	311,063.550	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	407,000.000	506,304.530	
	SINGAPORE 3.25 06/01/54	240,000.000	297,945.600	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	100,000.000	110,148.460	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	450,000.000	492,622.870	
シンガポール・ドル 小計		7,367,000.000 (920,727,660)	7,802,021.860 (975,096,692)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,200,000.000	3,787,113.700	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,560,000.000	4,448,247.880	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	4,540,000.000	4,329,506.020	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,720,000.000	3,546,242.140	
	SWEDEN 2.25 05/11/35	2,850,000.000	2,784,682.180	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,120,000.000	2,108,243.000	
	SWEDEN 2.5 10/15/36	2,650,000.000	2,617,418.250	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,420,000.000	3,709,302.920	
スウェーデン・クローナ 小計		28,060,000.000 (466,076,600)	27,330,756.090 (453,963,859)	

デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	2,510,000.000	2,209,102.970	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,110,000.000	2,052,444.610	
	DENMARK 0.5 11/15/27	2,850,000.000	2,785,446.070	
	DENMARK 0.5 11/15/29	1,940,000.000	1,827,356.580	
	DENMARK 2.0 11/15/28	1,300,000.000	1,292,211.150	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,400,000.000	2,349,942.000	
	DENMARK 2.25 11/15/35	3,100,000.000	2,972,590.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	4,970,000.000	5,859,726.400	
デンマーク・クローネ 小計		23,180,000.000 (571,155,200)	21,348,819.780 (526,034,919)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,440,000.000	1,360,719.310	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	920,000.000	823,722.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	310,000.000	212,055.610	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	816,177.200	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	570,000.000	487,202.110	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	250,000.000	170,692.210	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	450,000.000	444,079.350	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	960,000.000	926,818.340	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	920,000.000	924,706.150	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	470,000.000	464,783.000	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	540,000.000	555,986.370	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	370,000.000	376,352.270	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	490,000.000	489,800.490	
ニュージーランド・ドル 小計		8,600,000.000 (783,804,000)	8,053,094.410 (733,959,025)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,270,000.000	1,955,411.100	
	NORWAY 1.375 08/19/30	2,910,000.000	2,590,583.850	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,570,000.000	3,293,526.770	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,860,000.000	2,752,492.600	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,850,000.000	2,541,466.950	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,390,000.000	3,149,697.660	
	NORWAY 3.5 10/06/42	1,630,000.000	1,492,249.100	
	NORWAY 3.625 04/13/34	2,890,000.000	2,786,039.470	
	NORWAY 3.625 05/31/39	2,300,000.000	2,166,979.500	
	NORWAY 3.75 06/12/35	1,549,000.000	1,499,700.230	
	NORWAY 4.125 06/03/36	1,300,000.000	1,290,445.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,519,000.000 (447,458,940)	25,518,592.230 (414,932,310)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 01/25/28	2,300,000.000	2,166,878.660	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,970,000.000	2,595,661.600	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,350,000.000	2,844,140.630	

	POLAND 2.5 07/25/27	2,550,000.000	2,517,895.840	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,060,000.000	2,018,449.670	
	POLAND 2.75 10/25/29	3,000,000.000	2,859,773.900	
	POLAND 4.0 07/25/31	3,300,000.000	3,189,887.830	
	POLAND 4.5 01/25/31	1,300,000.000	1,294,925.790	
	POLAND 4.5 07/25/30	2,750,000.000	2,751,439.900	
	POLAND 4.75 07/25/29	4,550,000.000	4,613,744.590	
	POLAND 5.0 01/25/30	3,100,000.000	3,162,418.810	
	POLAND 5.0 10/25/34	2,630,000.000	2,613,354.770	
	POLAND 5.0 10/25/35	3,450,000.000	3,398,796.020	
	POLAND 5.75 04/25/29	500,000.000	519,644.600	
	POLAND 6.0 10/25/33	4,100,000.000	4,352,119.660	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,750,000.000	2,932,352.770	
ポーランド・ズロチ 小計		44,660,000.000 (1,918,361,368)	43,831,485.040 (1,882,772,674)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,932,598.180	
	MALAYSIA 3.336 05/15/30	1,000,000.000	999,485.300	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,200,000.000	1,204,196.760	
	MALAYSIA 3.519 04/20/28	800,000.000	804,452.880	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	900,000.000	902,160.270	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,073,000.000	2,092,491.380	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	700,000.000	693,614.850	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,000,000.000	1,015,396.600	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,051,000.000	1,069,948.150	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,530,000.000	1,558,383.030	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,500,000.000	1,515,561.150	
	MALAYSIA 3.917 07/15/55	400,000.000	387,136.180	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	1,888,000.000	1,936,186.850	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,050,000.000	1,050,343.140	
	MALAYSIA 4.18 05/16/44	1,000,000.000	1,032,635.900	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	800,000.000	830,062.400	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,050,000.000	1,100,638.450	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	2,120,000.000	2,245,239.000	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,100,000.000	1,144,353.650	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	520,000.000	537,287.080	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,520,000.000	1,623,983.960	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	600,000.000	657,127.140	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	1,200,000.000	1,325,220.240	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,400,000.000	1,523,512.760	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,930,000.000	2,133,127.090	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	810,000.000	915,315.220	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	950,000.000	1,069,704.940	
マレーシア・リンギット 小計		32,092,000.000 (1,273,564,602)	33,300,162.550 (1,321,510,291)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 02/21/36	5,000,000.000	4,719,550.000	
	MEXICAN BONDS 02/28/30	35,000,000.000	35,357,872.900	
	MEXICAN BONDS 03/01/29	26,000,000.000	26,421,620.940	
	MEXICAN BONDS 03/02/28	7,000,000.000	7,127,610.000	

	MEXICAN BONDS 04/15/32	11,000,000.000	10,731,399.910	
	MEXICAN BONDS 04/29/55	5,400,000.000	4,630,230.370	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	2,000,000.000	1,894,477.940	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	33,140,000.000	31,241,678.810	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	22,690,000.000	19,511,038.420	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	11,700,000.000	12,613,807.660	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,730,000.000	18,804,625.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	25,100,000.000	24,535,283.370	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	27,070,000.000	23,460,954.770	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	15,991,000.000	15,088,824.230	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	12,996,000.000	11,321,917.660	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	5,201,000.000	5,278,982.330	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	9,400,000.000	8,946,586.860	
メキシコ・ペソ 小計		273,418,000.000 (2,526,683,080)	261,686,461.170 (2,418,270,756)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	500,000.000	454,603.000	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,330,000.000	1,174,272.620	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	950,000.000	895,967.320	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	474,859.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	450,000.000	336,060.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	600,000.000	568,232.100	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	670,000.000	650,937.990	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	650,000.000	346,000.420	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	350,000.000	108,188.500	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	840,000.000	757,747.810	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	341,686.800	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	71,460.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	200,000.000	145,972.500	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	233,140.830	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,110,000.000	1,066,327.600	
	AUSTRIA 2.5 10/20/29	500,000.000	497,777.620	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,100,000.000	1,101,252.570	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34	380,000.000	378,632.000	
	AUSTRIA 2.9 05/23/29	300,000.000	302,640.600	
	AUSTRIA 2.95 02/20/35	700,000.000	695,240.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	670,000.000	638,236.120	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	320,000.000	291,466.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/36	350,000.000	352,380.000	
	AUSTRIA 3.2 07/15/39	300,000.000	295,590.000	
	AUSTRIA 3.45 10/20/30	400,000.000	412,120.000	
	AUSTRIA 3.75 03/20/56	400,000.000	402,480.000	

AUSTRIA 3.8 01/26/62	280,000.000	284,805.300	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	700,000.000	761,592.790	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	580,000.000	602,137.260	
BELGIUM 0.0 10/22/27	750,000.000	725,932.870	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,000,000.000	859,651.130	
BELGIUM 0.1 06/22/30	650,000.000	585,650.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,000,000.000	858,200.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	480,000.000	306,365.630	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	264,761.500	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,350,000.000	1,300,050.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	950,000.000	903,146.820	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,000,000.000	915,102.260	
BELGIUM 1.25 04/22/33	1,000,000.000	893,309.310	
BELGIUM 1.4 06/22/53	770,000.000	422,374.550	
BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	408,041.850	
BELGIUM 1.6 06/22/47	420,000.000	274,351.350	
BELGIUM 1.7 06/22/50	580,000.000	364,536.300	
BELGIUM 1.9 06/22/38	1,400,000.000	1,171,402.400	
BELGIUM 2.15 06/22/66	530,000.000	316,569.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	450,000.000	293,826.240	
BELGIUM 2.6 10/22/30	500,000.000	496,112.890	
BELGIUM 2.7 10/22/29	900,000.000	900,778.950	
BELGIUM 2.75 04/22/39	750,000.000	682,167.800	
BELGIUM 2.85 10/22/34	700,000.000	681,396.200	
BELGIUM 3.0 06/22/33	850,000.000	846,698.100	
BELGIUM 3.0 06/22/34	640,000.000	632,666.470	
BELGIUM 3.1 06/22/35	1,600,000.000	1,574,511.630	
BELGIUM 3.3 06/22/54	390,000.000	330,100.200	
BELGIUM 3.45 06/22/43	500,000.000	470,890.450	
BELGIUM 3.5 06/22/55	420,000.000	366,260.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	500,000.000	483,914.920	
BELGIUM 4.0 03/28/32	350,000.000	369,976.670	
BELGIUM 4.25 03/28/41	530,000.000	557,395.380	
BELGIUM 5.0 03/28/35	780,000.000	881,611.530	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,360,000.000	1,426,811.220	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,660,000.000	1,635,432.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	500,000.000	492,710.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,000,000.000	989,290.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,340,000.000	1,332,951.600	
BUNDESOBL 2.2 10/10/30	2,200,000.000	2,168,144.000	
BUNDESOBL 2.4 04/18/30	1,700,000.000	1,691,296.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	1,350,000.000	1,346,962.500	
BUNDESOBL 2.5 10/11/29	1,000,000.000	999,280.000	
BUNDESSCHAT 2.0 12/16/27	800,000.000	794,240.000	
BUNDESSCHAT 2.1 03/15/28	1,300,000.000	1,291,017.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,100,000.000	1,005,202.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	900,000.000	801,117.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,280,000.000	1,107,397.760	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,570,000.000	1,226,028.700	

DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,500,000.000	1,131,930.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,150,000.000	1,037,679.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,620,000.000	1,462,001.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,400,000.000	1,228,682.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	900,000.000	790,167.150	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,807,000.000	804,300.210	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,560,000.000	696,805.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,249,000.000	935,628.980	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,160,460.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,250,000.000	1,179,825.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,400,000.000	2,266,226.400	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	950,000.000	906,917.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,210,000.000	1,172,187.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,770,000.000	1,731,793.800	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,950,000.000	1,805,862.440	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	550,000.000	439,516.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,070,000.000	1,391,444.670	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,250,000.000	1,184,912.500	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,770,000.000	1,270,895.400	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,000,000.000	720,270.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,600,000.000	1,578,176.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	1,300,000.000	1,251,939.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,060,000.000	1,035,598.800	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,900,000.000	1,856,623.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,700,000.000	1,688,440.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,800,000.000	1,759,770.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,600,000.000	1,564,672.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,350,000.000	1,206,792.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,130,000.000	1,873,683.780	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	1,300,000.000	1,089,179.000	
DEUTSCHLAND 2.5 11/15/32	1,200,000.000	1,188,336.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,250,000.000	1,163,525.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,000,000.000	932,170.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,410,000.000	1,399,819.800	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,600,000.000	1,580,528.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/35	1,400,000.000	1,375,332.000	
DEUTSCHLAND 2.9 02/15/36	1,600,000.000	1,606,528.000	
DEUTSCHLAND 2.9 08/15/56	950,000.000	859,588.500	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,350,000.000	1,354,117.500	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	750,000.000	823,465.270	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,040,000.000	2,295,408.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,700,000.000	2,818,908.000	

DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,480,000.000	1,693,075.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,120,000.000	1,324,422.400	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,490,000.000	1,674,342.800	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,300,000.000	1,359,787.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	700,000.000	786,604.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,220,000.000	1,268,726.800	
FINLAND 0.0 09/15/30	280,000.000	250,304.400	
FINLAND 0.125 04/15/36	80,000.000	59,658.740	
FINLAND 0.125 04/15/52	206,000.000	83,356.050	
FINLAND 0.125 09/15/31	400,000.000	348,896.800	
FINLAND 0.25 09/15/40	450,000.000	287,042.850	
FINLAND 0.5 04/15/43	140,000.000	85,608.240	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	488,013.770	
FINLAND 0.5 09/15/28	220,000.000	210,505.960	
FINLAND 0.5 09/15/29	280,000.000	261,955.680	
FINLAND 0.75 04/15/31	300,000.000	273,392.920	
FINLAND 1.125 04/15/34	400,000.000	348,545.200	
FINLAND 1.375 04/15/47	300,000.000	199,397.080	
FINLAND 1.5 09/15/32	550,000.000	507,060.400	
FINLAND 2.5 04/15/30	450,000.000	447,052.500	
FINLAND 2.625 07/04/42	560,000.000	497,205.140	
FINLAND 2.75 04/15/38	600,000.000	566,255.340	
FINLAND 2.875 04/15/29	750,000.000	755,550.000	
FINLAND 2.95 04/15/55	250,000.000	213,575.000	
FINLAND 3.0 09/15/33	370,000.000	371,618.230	
FINLAND 3.0 09/15/34	850,000.000	848,186.100	
FINLAND 3.0 09/15/35	200,000.000	198,080.000	
FINLAND 3.2 04/15/45	210,000.000	197,442.000	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,150,000.000	1,795,895.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,800,000.000	3,461,182.500	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,280,000.000	2,011,303.140	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,600,000.000	3,065,736.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,080,000.000	2,890,646.980	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,010,000.000	1,280,164.330	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	980,000.000	254,344.300	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,520,000.000	832,808.000	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,530,000.000	2,452,898.250	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,000,000.000	3,859,800.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,350,000.000	1,055,187.600	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,350,000.000	587,666.800	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,390,000.000	2,283,088.720	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,650,000.000	1,412,298.100	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,290,000.000	1,042,062.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	800,000.000	607,920.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,270,000.000	3,056,916.220	

FRANCE OAT 1.5 05/25/50	770,000.000	452,370.950	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	450,000.000	229,161.220	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,510,000.000	1,982,168.330	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,600,000.000	1,094,736.000	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,961,000.000	1,831,186.700	
FRANCE OAT 2.4 09/24/28	1,900,000.000	1,888,201.000	
FRANCE OAT 2.4 09/24/29	2,300,000.000	2,272,630.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,130,000.000	3,092,522.940	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,000,000.000	811,078.250	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	3,300,000.000	3,295,446.000	
FRANCE OAT 2.7 02/25/31	1,900,000.000	1,881,005.700	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	1,850,000.000	1,851,209.340	
FRANCE OAT 2.75 02/25/30	2,800,000.000	2,793,473.200	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,090,000.000	3,095,067.600	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,800,000.000	3,747,954.230	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,608,000.000	1,255,309.320	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	1,700,000.000	1,392,886.500	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	2,800,000.000	2,718,506.000	
FRANCE OAT 3.2 05/25/35	2,200,000.000	2,156,667.380	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,500,000.000	1,331,175.750	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	3,200,000.000	3,244,211.840	
FRANCE OAT 3.5 11/25/35	5,800,000.000	5,788,400.000	
FRANCE OAT 3.6 05/25/42	1,900,000.000	1,806,330.000	
FRANCE OAT 3.75 05/25/56	1,470,000.000	1,311,341.780	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,150,000.000	1,080,035.040	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,470,000.000	1,358,731.290	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,900,000.000	2,962,901.000	
FRANCE OAT 4.1 05/25/46	930,000.000	924,606.000	
FRANCE OAT 4.4 05/25/57	1,000,000.000	999,200.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,510,000.000	1,605,534.680	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,280,000.000	2,505,046.260	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,090,000.000	3,320,259.070	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,810,000.000	2,079,292.160	
IRISH 0.0 10/18/31	430,000.000	374,008.610	
IRISH 0.2 10/18/30	480,000.000	433,481.640	
IRISH 0.35 10/18/32	230,000.000	198,191.900	
IRISH 0.4 05/15/35	280,000.000	225,065.660	
IRISH 0.55 04/22/41	260,000.000	176,704.840	
IRISH 0.9 05/15/28	370,000.000	359,492.600	
IRISH 1.1 05/15/29	250,000.000	240,106.820	
IRISH 1.3 05/15/33	550,000.000	499,765.200	
IRISH 1.35 03/18/31	480,000.000	453,279.800	
IRISH 1.5 05/15/50	535,000.000	364,137.310	
IRISH 1.7 05/15/37	450,000.000	392,274.330	
IRISH 2.0 02/18/45	360,000.000	290,696.040	
IRISH 2.4 05/15/30	560,000.000	555,810.480	
IRISH 2.6 10/18/34	450,000.000	440,368.870	
IRISH 3.0 10/18/43	300,000.000	285,129.660	
IRISH 3.1 06/18/36	400,000.000	402,793.400	

IRISH 3.15 10/18/55	190,000.000	174,762.150	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	230,000.000	221,007.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	700,000.000	660,240.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	800,000.000	766,480.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,900,000.000	1,687,246.550	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,650,000.000	1,500,654.780	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,100,000.000	840,070.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	550,000.000	486,640.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,600,000.000	1,481,760.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,600,000.000	1,569,760.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,165,823.100	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,400,000.000	1,327,159.740	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,332,000.000	1,104,627.600	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	440,000.000	289,036.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,200,000.000	1,112,677.800	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,850,000.000	1,753,193.660	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	750,000.000	451,395.750	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,500,000.000	1,142,250.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,150,000.000	1,139,244.620	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,000,000.000	994,935.000	
ITALY BTPS 2.1 08/26/27	900,000.000	895,050.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	400,000.000	265,240.000	
ITALY BTPS 2.2 02/28/28	1,500,000.000	1,488,600.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,000,000.000	887,600.000	
ITALY BTPS 2.35 01/15/29	600,000.000	594,420.000	
ITALY BTPS 2.4 03/15/29	1,700,000.000	1,684,530.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,600,000.000	1,520,257.600	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,190,000.000	862,631.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	500,000.000	481,050.000	
ITALY BTPS 2.65 06/15/28	1,200,000.000	1,199,640.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,200,000.000	1,200,600.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,130,000.000	898,124.000	
ITALY BTPS 2.7 10/01/30	1,100,000.000	1,090,320.000	
ITALY BTPS 2.7 10/15/27	850,000.000	852,890.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	750,000.000	534,450.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	1,001,200.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	900,000.000	902,996.460	
ITALY BTPS 2.85 02/01/31	800,000.000	796,080.000	
ITALY BTPS 2.95 07/01/30	600,000.000	601,320.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,280,000.000	1,175,040.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,300,000.000	1,309,737.000	
ITALY BTPS 3.0 10/01/29	1,500,000.000	1,508,325.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	500,000.000	459,247.500	
ITALY BTPS 3.15 03/15/33	1,000,000.000	995,100.000	
ITALY BTPS 3.15 11/15/31	1,400,000.000	1,406,720.000	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	1,430,000.000	1,364,792.000	
ITALY BTPS 3.25 07/15/32	700,000.000	704,270.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	300,000.000	262,182.270	
ITALY BTPS 3.25 11/15/32	1,000,000.000	1,003,900.000	

ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,700,000.000	1,690,376.300	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	950,000.000	962,160.000	
ITALY BTPS 3.45 02/01/36	1,900,000.000	1,884,800.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,180,000.000	1,053,019.200	
ITALY BTPS 3.45 07/15/27	500,000.000	504,400.000	
ITALY BTPS 3.45 07/15/31	1,800,000.000	1,837,080.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.000	1,022,700.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	740,000.000	757,544.140	
ITALY BTPS 3.6 10/01/35	1,600,000.000	1,610,080.000	
ITALY BTPS 3.65 08/01/35	900,000.000	910,530.000	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,110,000.000	1,143,189.000	
ITALY BTPS 3.8 07/01/36	500,000.000	508,450.000	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	1,000,000.000	1,022,700.000	
ITALY BTPS 3.85 02/01/35	1,200,000.000	1,235,520.000	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	500,000.000	516,300.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	801,447.570	
ITALY BTPS 3.85 10/01/40	1,400,000.000	1,387,400.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,450,000.000	1,498,430.000	
ITALY BTPS 3.95 10/01/41	850,000.000	844,900.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,000,000.000	1,041,800.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,350,000.000	1,414,800.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	700,000.000	730,030.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	650,000.000	671,580.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	1,000,000.000	1,033,800.000	
ITALY BTPS 4.1 04/30/46	600,000.000	594,660.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	1,100,000.000	1,132,670.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,000,000.000	1,057,700.000	
ITALY BTPS 4.3 10/01/54	950,000.000	940,120.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	930,000.000	993,426.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	940,000.000	1,007,116.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	900,000.000	940,680.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	750,000.000	767,625.000	
ITALY BTPS 4.65 10/01/55	450,000.000	468,360.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,400,000.000	1,460,974.900	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	750,000.000	813,452.020	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	430,000.000	479,192.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	860,000.000	963,372.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,710,000.000	1,915,542.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,890,000.000	2,037,042.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	820,000.000	943,574.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,101,629.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,470,000.000	1,544,529.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,100,000.000	1,033,453.300	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,250,000.000	875,895.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,300,000.000	547,174.860	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,000,000.000	901,399.500	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	380,000.000	333,047.310	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	700,000.000	653,583.000	

NETHERLANDS 0.5 01/15/40	447,000.000	315,067.420	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	500,000.000	438,900.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	400,000.000	393,038.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,360,000.000	1,313,341.800	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	890,000.000	665,737.290	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	550,000.000	548,444.870	
NETHERLANDS 2.5 01/15/31	800,000.000	798,720.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,520,000.000	1,497,969.880	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	1,000,000.000	981,769.000	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	500,000.000	487,700.000	
NETHERLANDS 2.5 07/15/35	700,000.000	677,600.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,030,000.000	935,052.540	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	470,000.000	465,003.660	
NETHERLANDS 3.5 01/15/56	450,000.000	456,840.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,030,000.000	1,087,893.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,300,000.000	1,416,740.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	520,000.000	544,128.000	
PORTUGUESE 0.3 10/17/31	100,000.000	88,068.450	
PORTUGUESE 0.475 10/18/30	350,000.000	319,246.150	
PORTUGUESE 0.7 10/15/27	200,000.000	195,633.010	
PORTUGUESE 0.9 10/12/35	300,000.000	246,124.950	
PORTUGUESE 1.0 04/12/52	280,000.000	151,373.170	
PORTUGUESE 1.15 04/11/42	300,000.000	212,313.810	
PORTUGUESE 1.65 07/16/32	850,000.000	795,187.520	
PORTUGUESE 1.95 06/15/29	1,000,000.000	981,800.000	
PORTUGUESE 2.125 10/17/28	950,000.000	942,372.980	
PORTUGUESE 2.25 04/18/34	50,000.000	47,376.710	
PORTUGUESE 2.875 10/14/33	500,000.000	496,450.000	
PORTUGUESE 2.875 10/20/34	200,000.000	197,337.500	
PORTUGUESE 3.0 06/15/35	380,000.000	376,475.950	
PORTUGUESE 3.25 06/13/36	300,000.000	300,417.300	
PORTUGUESE 3.5 06/18/38	370,000.000	373,688.900	
PORTUGUESE 3.625 06/12/54	480,000.000	457,392.000	
PORTUGUESE 3.875 02/15/30	550,000.000	573,512.500	
PORTUGUESE 4.1 02/15/45	450,000.000	472,275.000	
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	630,000.000	676,386.900	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.0 10/09/30	500,000.000	461,100.000	

SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.0 10/13/51	250,000.000	127,731.610	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625 01/16/29	300,000.000	306,507.000	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/23/35	800,000.000	822,319.120	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/27/40	510,000.000	503,523.000	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 4.0 10/19/32	500,000.000	526,986.700	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,850,000.000	1,777,036.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,490,000.000	1,311,051.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,600,000.000	2,396,617.640	
SPAIN 0.5 10/31/31	2,100,000.000	1,862,359.800	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,280,000.000	1,197,438.720	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,371,764.370	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,650,000.000	1,618,089.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	944,400.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,160,000.000	887,338.340	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,150,000.000	774,065.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	930,000.000	506,568.210	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,000,000.000	731,291.200	
SPAIN 1.25 10/31/30	769,000.000	722,667.750	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,200,000.000	1,175,998.080	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,700,000.000	1,659,200.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	730,000.000	707,478.870	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,000,000.000	985,976.300	
SPAIN 1.45 10/31/71	674,000.000	320,238.310	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,800,000.000	1,610,536.730	
SPAIN 1.9 10/31/52	730,000.000	485,654.640	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,418,908.820	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,610,000.000	1,541,575.000	
SPAIN 2.4 05/31/28	1,100,000.000	1,096,216.000	
SPAIN 2.5 05/31/27	1,450,000.000	1,448,796.500	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,200,000.000	1,174,333.230	
SPAIN 2.6 05/31/31	700,000.000	690,830.000	
SPAIN 2.7 01/31/30	1,200,000.000	1,200,060.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,300,000.000	1,072,900.830	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,220,000.000	1,059,742.330	
SPAIN 3.0 01/31/33	800,000.000	801,040.000	
SPAIN 3.1 07/30/31	1,200,000.000	1,217,431.800	
SPAIN 3.15 04/30/33	1,000,000.000	1,009,687.600	
SPAIN 3.15 04/30/35	1,000,000.000	996,391.850	
SPAIN 3.2 10/31/35	1,200,000.000	1,195,800.000	
SPAIN 3.25 04/30/34	1,450,000.000	1,464,200.280	
SPAIN 3.3 04/30/36	600,000.000	600,829.920	
SPAIN 3.45 07/30/43	800,000.000	768,070.460	
SPAIN 3.45 07/30/66	890,000.000	785,553.690	
SPAIN 3.45 10/31/34	1,300,000.000	1,328,148.250	

	SPAIN 3.5 01/31/41	700,000.000	686,964.280	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,350,000.000	1,382,880.460	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,720,000.000	1,775,556.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	1,200,000.000	1,242,062.160	
	SPAIN 3.95 10/31/56	700,000.000	687,383.760	
	SPAIN 4.0 10/31/54	500,000.000	499,606.870	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,180,000.000	1,267,365.660	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,000,000.000	1,119,139.200	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,080,000.000	1,231,092.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,008,395.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,200,000.000	1,414,827.840	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,100,000.000	1,274,451.200	
	SPAIN 6.0 01/31/29	800,000.000	867,674.160	
ユーロ 小計		440,808,000.000 (81,196,833,600)	410,566,836.940 (75,626,411,364)	
韓国・ウォン	KOREA TREASURY BOND (TAX) 3.75 12/10/33	800,000,000.000	782,753,480.000	
	KOREA TREASURY BOND (TAX) 4.0 12/10/31	500,000,000.000	499,421,650.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.125 09/10/39	1,000,000,000.000	692,335,610.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.375 06/10/30	800,000,000.000	726,088,656.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	1,100,000,000.000	1,012,206,063.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/50	2,030,000,000.000	1,181,410,488.300	
	KOREA TREASURY BOND 2.0 06/10/31	500,000,000.000	455,752,005.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.25 06/10/28	700,000,000.000	682,508,813.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.375 12/10/28	1,800,000,000.000	1,746,383,814.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.625 03/10/48	500,000,000.000	381,587,930.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.625 09/10/55	2,350,000,000.000	1,696,123,850.500	
	KOREA TREASURY BOND 2.75 09/10/45	500,000,000.000	399,809,875.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.875 09/10/44	500,000,000.000	409,935,030.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.0 12/10/34	700,000,000.000	646,529,100.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/29	1,700,000,000.000	1,679,424,373.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/54	630,000,000.000	518,456,093.400	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 09/10/42	500,000,000.000	440,228,285.000	

		KOREA TREASURY BOND 3.25 12/10/35	700,000,000.000	653,070,628.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.375 03/10/31	1,000,000,000.000	975,574,860.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.5 03/10/56	1,780,000,000.000	1,534,326,998.800	
		KOREA TREASURY BOND 4.25 12/10/32	500,000,000.000	505,905,900.000	
	韓国・ウォン 小計		20,590,000,000.000 (2,163,926,640)	17,619,833,503.000 (1,851,774,022)	
国債証券 合計			279,170,442,054.400 (279,170,442,054)	263,141,661,094 (263,141,661,094)	
合計				263,141,661,094 (263,141,661,094)	

(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 283銘柄	44.65	45.01
イギリス・ポンド	国債証券 64銘柄	5.61	5.65
イスラエル・シュケル	国債証券 13銘柄	0.44	0.44
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.29	1.30
オフショア・人民元	国債証券 74銘柄	12.65	12.75
カナダ・ドル	国債証券 40銘柄	2.07	2.08
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.37	0.37
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.17	0.17
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.20	0.20
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.28	0.28
ノルウェー・クローネ	国債証券 11銘柄	0.16	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	0.71	0.72
マレーシア・リンギット	国債証券 27銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券 17銘柄	0.91	0.92
ユーロ	国債証券 402銘柄	28.51	28.74
韓国・ウォン	国債証券 21銘柄	0.70	0.70

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

J－REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2026年6月29日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,529,024,439
投資証券	192,514,695,800
派生商品評価勘定	158,534,930
未収配当金	1,969,315,867
差入委託証拠金	229,454,524
流動資産合計	200,401,025,560
資産合計	200,401,025,560
負債の部	
流動負債	
前受金	175,991,200
未払金	2,179,935,858
未払解約金	96,728,000
流動負債合計	2,452,655,058
負債合計	2,452,655,058
純資産の部	
元本等	
元本	74,814,154,804
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	123,134,215,698
元本等合計	197,948,370,502
純資産合計	197,948,370,502
負債純資産合計	200,401,025,560

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年7月1日 至 2026年6月29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	2026年6月29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	73,171,726,112円
同期中追加設定元本額	26,518,318,730円
同期中一部解約元本額	24,875,890,038円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 国内リート	7,376,929,118円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	6,443,995,374円
たわらノーロード バランス（堅実型）	55,510,556円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,572,840,518円
たわらノーロード バランス（積極型）	2,441,514,500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）	417,389,845円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,258,099,066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）	984,008,366円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	1,152,607,743円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	6,532,495円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	99,141,874円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	32,864,660円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	47,776,272円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	12,974,847円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	5,347,711円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,182,951円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	463,252,458円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,539,059円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	149,418,663円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	267,854,432円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国30）	664,643,363円
投資のソムリエ	4,402,448,737円
投資のソムリエ＜DC年金＞	983,160,270円
D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	218,643,216円

投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	941,905,481円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,554,454,128円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	103,530,820円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	53,492,628円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	10,485,186円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	330,912,441円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	584,036,320円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	132,165,561円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	145,429,566円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	65,502,641円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	36,476,862円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	15,601,911円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	42,701,660円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	616,441円
Jリートインデックスファンド（DC）	90,248,157円
One J-REITインデックスファンド（隔月決算型）	54,451,253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）	158,352,262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）	14,745,108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）	48,263,124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）	73,939,792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）	216,463,274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）	54,595,328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）	125,640,063円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021-07（適格機関投資家限定）	141,659,298円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021-08（適格機関投資家限定）	99,013,009円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	73,860,192円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	54,149,147円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021-09（適格機関投資家限定）	98,651,802円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）2021-12（適格機関投資家限定）	142,381,711円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	526,551,142円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	146,668,030円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）24-04（適格機関投資家限定）	116,916,932円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2024-05（適格機関投資家限定）	420,758,076円
DIAM J-REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,745,047,965円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	20,637,338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）	13,827,852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）	79,100,995円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,249,509円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	425,840,816円
MHAM J-REITインデックスファンド〈DC年金〉	6,075,446,176円
One J-REITインデックスファンド（毎月決算型）	21,834,503,111円
One J-REITインデックスファンド（年1回決算型）	2,268,215,617円
たわらノーロード 国内リート〈ラップ専用〉	6,600,953,824円
計	74,814,154,804円
2. 受益権の総数	74,814,154,804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 2025年7月1日 至 2026年6月29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リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの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。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月29日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	4,789,385,937
合計	4,789,385,937

（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（2026年6月9日から2026年6月29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	2026年6月29日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,968,037,300	—	5,126,886,500	158,849,200
合計	4,968,037,300	—	5,126,886,500	158,849,200

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月29日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6459円 (26,459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

2026年6月29日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	7,590	1,062,600,000	
	GLP投資法人	59,365	8,216,116,000	
	KDX不動産投資法人	52,609	8,196,482,200	
	MIRARTH不動産投資法人	13,134	1,084,868,400	
	NTT都市開発リート投資法人	18,167	2,425,294,500	
	Oneリート投資法人	10,755	805,549,500	
	SOSILA物流リート投資法人	9,002	1,018,126,200	
	いちごオフィスリート投資法人	12,934	1,219,676,200	
	いちごホテルリート投資法人	2,986	345,181,600	
	アクティビア・プロパティーズ 投資法人	27,856	3,821,843,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	37,150	5,583,645,000	
	イオンリート投資法人	21,908	2,705,638,000	
	インヴィンシブル投資法人	99,593	5,925,783,500	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,993	457,597,800	
	オリックス不動産投資法人	71,897	7,031,526,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人	14,180	1,559,800,000	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	27,334	2,804,468,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,998	479,308,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,780	665,278,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	76,898	6,105,701,200	
	ジャパンエクセレント投資法人	15,127	2,064,835,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	94,762	11,144,011,200	
	スターアジア不動産投資法人	33,248	1,821,990,400	
	スターツプロシード投資法人	3,016	570,627,200	
	セントラル・リート投資法人	2,926	305,181,800	
	トーセイ・リート投資法人	3,923	523,720,500	
	ヒューリックリート投資法人	15,942	2,491,734,600	
	フロンティア不動産投資法人	31,709	2,549,403,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	4,682	518,297,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	3,300	349,140,000	

ユナイテッド・アーバン投資法人	41,596	6,755,190,400	
ラサールロジポート投資法人	22,621	3,318,500,700	
霞ヶ関ホテルリート投資法人	2,245	224,724,500	
阪急阪神リート投資法人	8,602	1,195,678,000	
三井不動産アコモデーションファンド投資法人	31,149	3,778,373,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	39,839	4,322,531,500	
三菱地所物流リート投資法人	18,375	2,212,350,000	
産業ファンド投資法人	32,933	4,709,419,000	
森トラストリート投資法人	34,776	2,580,379,200	
森ヒルズリート投資法人	20,883	2,704,348,500	
星野リゾート・リート投資法人	7,249	1,727,436,700	
積水ハウス・リート投資法人	53,255	4,100,635,000	
大和ハウスリート投資法人	56,174	6,847,610,600	
大和証券オフィス投資法人	7,305	2,414,302,500	
大和証券リビング投資法人	26,416	2,638,958,400	
投資法人みらい	24,844	1,043,448,000	
東海道リート投資法人	4,524	464,614,800	
東急リアル・エステート投資法人	11,896	2,190,053,600	
日本ビルファンド投資法人	108,981	13,775,198,400	
日本プライムリアルティ投資法人	50,028	4,702,632,000	
日本プロロジスリート投資法人	92,876	8,108,074,800	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	5,278	338,847,600	
日本リート投資法人	23,801	1,982,623,300	
日本ロジスティクスファンド投資法人	35,768	3,408,690,400	
日本都市ファンド投資法人	93,684	10,576,923,600	
福岡リート投資法人	10,185	1,757,931,000	
平和不動産リート投資法人	14,827	1,991,266,100	
野村不動産マスターファンド投資法人	57,492	8,790,526,800	
投資証券 合計	1,724,366	192,514,695,800	
合計		192,514,695,800	

（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。

２【ファンドの現況】**【純資産額計算書】**

マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）

2026年6月30日現在

I 資産総額	1,163,751,765円
II 負債総額	31,608円
III 純資産総額（I－II）	1,163,720,157円
IV 発行済数量	1,095,451,133口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0623円

マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）

2026年6月30日現在

I 資産総額	4,060,632,357円
II 負債総額	186,017,205円
III 純資産総額（I－II）	3,874,615,152円
IV 発行済数量	3,217,662,989口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2042円

マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）

2026年6月30日現在

I 資産総額	1,512,186,933円
II 負債総額	117,073,624円
III 純資産総額（I－II）	1,395,113,309円
IV 発行済数量	1,074,027,537口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2990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

2026年6月30日現在

I 資産総額	892,936,378,505円
II 負債総額	1,531,020,251円
III 純資産総額（I－II）	891,405,358,254円
IV 発行済数量	120,504,133,742口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	7.3973円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	2,864,329,679,714円
II 負債総額	70,663,672円
III 純資産総額（I－II）	2,864,259,016,042円
IV 発行済数量	208,504,286,055口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	13.7372円

NASDAQ100インデックス・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	1,476,473,820円
II 負債総額	61,615,700円
III 純資産総額（I－II）	1,414,858,120円
IV 発行済数量	704,433,633口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.0085円

グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	5,269,185,674円
II 負債総額	36,973,603円
III 純資産総額（I－II）	5,232,212,071円
IV 発行済数量	1,617,981,281口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.2338円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	217,566,847,980円
II 負債総額	189,858,738円
III 純資産総額（I－II）	217,376,989,242円
IV 発行済数量	69,596,479,367口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.1234円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	452,045,383,043円
II 負債総額	4,240,284,000円
III 純資産総額（I－II）	447,805,099,043円
IV 発行済数量	406,289,340,124口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1022円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	342,107,099,991円
II 負債総額	1,891,978,174円
III 純資産総額（I－II）	340,215,121,817円
IV 発行済数量	122,018,825,729口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.7882円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	268,475,874,937円
II 負債総額	3,205,395,192円
III 純資産総額（I－II）	265,270,479,745円
IV 発行済数量	230,418,886,761口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1513円

J－REITインデックスファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	198,071,246,577円
II 負債総額	985,166,023円
III 純資産総額（I－II）	197,086,080,554円
IV 発行済数量	74,774,369,856口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.6357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（2026年6月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2026年6月30日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見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原則として月次で開催する「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、運用担当部署の部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。

2026年6月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,749,064,658,387
追加型株式投資信託	760	22,501,881,200,185
単位型公社債投資信託	15	23,109,789,974
単位型株式投資信託	151	799,204,255,615
合計	952	25,073,259,904,161

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第41期事業年度（自2025年4月1日至2026年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	40,201	44,626
有価証券	0	—
金銭の信託	31,340	31,701
未収委託者報酬	19,595	21,109
未収運用受託報酬	4,015	8,039
未収投資助言報酬	359	381
未収収益	11	18
前払費用	1,758	1,764
その他	2,106	2,130
流動資産計	99,390	109,772
固定資産		
有形固定資産	1,361	1,099
建物	※1 841	※1 735
器具備品	※1 352	※1 341
リース資産	※1 3	※1 1
建設仮勘定	163	20
無形固定資産	3,771	3,871
ソフトウェア	2,740	2,936
ソフトウェア仮勘定	1,030	934
電話加入権	0	0
投資その他の資産	9,039	8,550
投資有価証券	183	106
関係会社株式	4,037	3,364
長期差入保証金	760	774
繰延税金資産	3,842	4,054
その他	215	250
固定資産計	14,172	13,521
資産合計	113,562	123,293

（単位：百万円）

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
（負債の部）		
流動負債		
預り金	227	520
リース債務	1	1
未払金	8,823	9,766
未払収益分配金	1	1
未払償還金	0	1
未払手数料	8,596	9,373
その他未払金	225	390
未払費用	9,265	11,969
未払法人税等	4,277	4,023
未払消費税等	1,606	1,883
賞与引当金	2,198	2,225
役員賞与引当金	60	60
流動負債計	26,462	30,451
固定負債		
リース債務	2	0
退職給付引当金	2,715	2,721
時効後支払損引当金	64	53
固定負債計	2,781	2,775
負債合計	29,244	33,227
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	62,765	68,513
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	62,642	68,390
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	30,962	36,710
株主資本計	84,318	90,066
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	84,318	90,066
負債・純資産合計	113,562	123,293

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）		第41期 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	112,281		117,297	
運用受託報酬	17,981		23,568	
投資助言報酬	2,374		1,997	
その他営業収益	30		24	
営業収益計		132,668		142,888
営業費用				
支払手数料	49,384		51,925	
広告宣伝費	401		297	
公告費	0		—	
調査費	39,013		43,316	
調査費	14,703		18,298	
委託調査費	24,309		25,017	
委託計算費	522		308	
営業雑経費	774		711	
通信費	38		36	
印刷費	538		473	
協会費	67		66	
諸会費	47		47	
支払販売手数料	81		88	
営業費用計		90,097		96,558
一般管理費				
給料	11,477		11,766	
役員報酬	181		183	
給料・手当	10,148		10,445	
賞与	1,147		1,137	
交際費	59		82	
寄付金	12		17	
旅費交通費	246		307	
租税公課	668		1,028	
不動産賃借料	1,085		1,107	
退職給付費用	421		431	
固定資産減価償却費	1,457		1,460	
福利厚生費	57		58	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	2,198		2,225	
役員賞与引当金繰入額	60		60	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,261		3,472	
事務用消耗品費	43		53	
器具備品費	2		1	
諸経費	313		210	
一般管理費計		21,366		22,286
営業利益		21,204		24,043

（単位：百万円）

	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）		第41期 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	12		50	
受取配当金	※1 450		※1 328	
時効成立分配金・償還金	0		0	
金銭の信託運用益	—		631	
雑収入	11		10	
時効後支払損引当金戻入額	7		8	
営業外収益計		482		1,030
営業外費用				
投資信託償還損	—		0	
為替差損	39		51	
金銭の信託運用損	329		—	
早期割増退職金	6		27	
営業外費用計		374		78
経常利益		21,312		24,994
特別利益				
固定資産売却益	※2 6		※2 0	
特別利益計		6		0
特別損失				
固定資産除却損	13		0	
投資有価証券売却損	—		22	
関係会社株式評価損	31		523	
関係会社清算損	25		4	
特別損失計		70		550
税引前当期純利益		21,247		24,444
法人税、住民税及び事業税		7,356		7,469
法人税等調整額		△435		△212
法人税等合計		6,920		7,256
当期純利益		14,326		17,187

（３）【株主資本等変動計算書】

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846
当期変動額									
剰余金の配当							△ 10,855	△ 10,855	△ 10,855
当期純利益							14,326	14,326	14,326
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,471	3,471	3,471
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	30,962	62,765	84,318

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	80,846
当期変動額			
剰余金の配当			△ 10,855
当期純利益			14,326
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	3,471
当期末残高	△0	△0	84,318

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	30,962	62,765	84,318
当期変動額									
剰余金の配当							△ 11,440	△ 11,440	△ 11,440
当期純利益							17,187	17,187	17,187
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,747	5,747	5,747
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	36,710	68,513	90,066

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	84,318
当期変動額			
剰余金の配当			△ 11,440
当期純利益			17,187
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	5,747
当期末残高	△0	△0	90,066

重要な会計方針

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

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

（未適用の会計基準等）

- ・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）
- ・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

(1) 概要

企業会計基準委員会において、日本基準を国際的に整合性のあるものとする取組みの一環として、借手の全てのリースについて資産及び負債を認識するリースに関する会計基準の開発に向けて、国際的な会計基準を踏まえた検討が行われ、基本的な方針として、IFRS第16号の単一の会計処理モデルを基礎とするものの、IFRS第16号の全ての定めを採り入れるのではなく、主要な定めのみを採り入れることにより、簡素で利便性が高く、かつ、IFRS第16号の定めを個別財務諸表に用いても、基本的に修正が不要となることを目指したリース会計基準等が公表されました。

借手の会計処理として、借手のリースの費用配分の方法については、IFRS第16号と同様に、リースがファイナンス・リースであるかオペレーティング・リースであるかにかかわらず、全てのリースについて使用权資産に係る減価償却費及びリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

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

（百万円）

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
建物	740	849
器具備品	662	705
リース資産	5	7

（損益計算書関係）

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

（百万円）

	第40期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日)
受取配当金	438	314

※2. 固定資産売却益

固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。

	第40期 (自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日)
ソフトウェア	6	0

（株主資本等変動計算書関係）

第40期（自 2024年4月1日 至 2025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（財 産）の総額 （百万円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2024年3月15日 みなし株主総会	普通 株式	575	14,390	2024年4月1日	2024年4月1日
	A種種類 株式				
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式				

会社法第319条第1項に基づき、2024年3月15日に決議があったものとみなされた株主総会での配当決議は当社の子会社であったAsset Management One USA Inc.（以下「AM-One USA」という）の全株式の現物配当であります。

本現物配当は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）の子会社である米州みずほLLC（以下「米州みずほ」という）が、2024年10月1日に米国外国銀行規制上の中間持株会社へ移行することに伴う規制上の対応として実施したものです。

当社が100%保有していたAM-One USAの議決権は、本現物配当後、米州みずほが議決権の51%を、第一生命ホールディングス株式会社（以下「DL」という）が議決権の49%をそれぞれ保有します。当社を通じてMHFGとDLが間接的に保有していたAM-One USA株式の議決権比率と同等となります。

- (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
2025年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生（予定）日
2025年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,440	286,000	2025年3月31日	2025年6月17日
	A種種類株式					

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2025年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,440	286,000	2025年3月31日	2025年6月17日
	A種種類株式				

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2026年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生（予定）日
2026年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	22,000	550,000	2026年3月31日	2026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。

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第40期（2025年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 有価証券	0	0	—
(2) 金銭の信託	31,340	31,340	—
(3) 投資有価証券 その他有価証券	0	0	—
資産計	31,342	31,342	—

第41期（2026年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	31,701	31,701	—
(2) 投資有価証券 其他有価証券	0	0	—
資産計	31,702	31,702	—

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

（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第40期（2025年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	40,201	—	—	—
(2) 有価証券	0	—	—	—
(3) 金銭の信託	31,340	—	—	—
(4) 未収委託者報酬	19,595	—	—	—
(5) 未収運用受託報酬	4,015	—	—	—
(6) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	0	—	—
合計	95,154	0	—	—

第41期（2026年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	44,626	—	—	—
(2) 金銭の信託	31,701	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	21,109	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	8,039	—	—	—
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	0	—	—
合計	105,477	0	—	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第40期（2025年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 有価証券	—	0	—	0
(2) 金銭の信託	—	31,340	—	31,340
(3) 投資有価証券 其他有価証券	—	0	—	0
資産計	—	31,342	—	31,342

第41期（2026年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	31,701	—	31,701
(2) 投資有価証券 其他有価証券	—	0	—	0
資産計	—	31,702	—	31,702

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券

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

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	182	106
関係会社株式		
非上場株式	4,037	3,364

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第40期の貸借対照表計上額4,037百万円、第41期の貸借対照表計上額3,364百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第40期（2025年3月31日現在）

（百万円）

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

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

第41期（2026年3月31日現在）

（百万円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額106百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

該当はありません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

区分	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
株式	51	—	22

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について31百万円（関係会社株式31百万円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について523百万円（関係会社株式523百万円）減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,760	2,759
勤務費用	299	311
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	18	△439
退職給付の支払額	△321	△320
退職給付債務の期末残高	2,759	2,313

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(百万円)

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,759	2,313
未積立退職給付債務	2,759	2,313
未認識数理計算上の差異	△44	408
未認識過去勤務費用	0	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,715	2,721
退職給付引当金	2,715	2,721
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,715	2,721

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
勤務費用	299	311
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	14	12
過去勤務費用の費用処理額	△0	△0
その他	△4	△3
確定給付制度に係る退職給付費用	312	323

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において6百万円、当事業年度において27百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
割引率	0.09%	2.14%
予想昇給率	1.00%～3.56%	1.00%～3.56%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度108百万円、当事業年度105百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	259	225
未払事業所税	10	10
賞与引当金	673	701
未払法定福利費	106	110
運用受託報酬	555	1,534
資産除去債務	20	23
減価償却超過額（一括償却資産）	5	3
減価償却超過額	66	71
繰延資産償却超過額（税法上）	407	407
退職給付引当金	855	857
時効後支払損引当金	20	16
ゴルフ会員権評価損	2	2
関係会社株式評価損	774	—
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	73	73
その他	6	11
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,842	4,054
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	—	—
繰延税金資産の純額	3,842	4,054

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	— %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△0.64 %	— %
税制非適格現物配当益金算入項目	3.56	— %
税率変更による影響	△0.18	— %
その他	△0.79 %	— %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.57 %	— %

(注) 当事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との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）

（取得による企業結合）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれん金額 76,224百万円

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

c.のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a.資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b.負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a.無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b.主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c.全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	53,066百万円	46,634百万円
資産合計	53,066百万円	46,634百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	561百万円	－百万円
負債合計	561百万円	－百万円
純資産	52,505百万円	46,634百万円

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

のれん 43,829百万円 40,018百万円

顧客関連資産 13,661百万円 10,603百万円

(2) 損益計算書項目

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△7,259百万円	△6,868百万円
経常利益	△7,259百万円	△6,868百万円
税引前当期純利益	△7,259百万円	△6,868百万円
当期純利益	△6,298百万円	△5,870百万円
1株当たり当期純利益	△157,468円47銭	△146,764円94銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	3,447百万円	3,057百万円

(共通支配下の取引等)

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当社は、2024年4月1日に株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という。親会社）及び第一生命ホールディングス株式会社（その他の関係会社）へ以下の現物配当を行いました。

1. 取引の概要

(1) 取引内容

Asset Management One USA Inc.(当社の子会社)株式の現物配当

(2) 効力発生日

2024年4月1日

(3) 取引の総額

575百万円

(4) その他取引の概要に関する事項

本現物配当は、MHFGの子会社である米州みずほLLCが、2024年10月1日に米国外国銀行規制上の中間持株会社へ移行することに伴う規制上の対応として実施したものです。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成31年1月16日）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31年1月16日）に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(資産除去債務関係)

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
委託者報酬	111,988百万円	115,972百万円
運用受託報酬	16,520百万円	18,429百万円
投資助言報酬	2,374百万円	1,997百万円
成功報酬（注）	1,754百万円	6,463百万円
その他営業収益	30百万円	24百万円
合計	132,668百万円	142,888百万円

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）及び第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は 出資金	事業 の 内容 又は 職業	議決権 等の 所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	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	22,567億円	持株会社	(被所有) 直接51%	—	持株会社	現物配当	402	-	-
その他の関係会社	第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区	3,443億円	持株会社	(被所有) 直接49%	—	持株会社	現物配当	172	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 現物配当の詳細については、（株主資本等変動計算書関係）2. 配当に関する事項及び（企業結合等関係）（共通支配下の取引等）に記載しております。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

該当はありません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は 出資金	事業 の 内容 又は 職業	議決権 等の 所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社の	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	9,048	未払 手数料	1,976
子会社	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	20,086	未払 手数料	3,306

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は 出資金	事業 の 内容 又は 職 業	議決権 等の 所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の 関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行 業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,462	未払 手数料	2,204
	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	21,894	未払 手数料	3,421

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40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
1株当たり純資産額	2,107,956円73銭	2,251,656円50銭
1株当たり当期純利益金額	358,173円51銭	429,699円67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40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
当期純利益金額	14,326百万円	17,187百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,326百万円	17,187百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は2025年5月14日付で100%子会社であるAsset Management One Singapore Pte. Ltd. を清算しました。

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社は2025年12月26日付で清算終了しました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2026年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
楽天証券株式会社	19,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2025年12月31日現在

(3) 投資顧問会社

名称	Asset Management One USA Inc.
資本金の額	400万米ドル（2025年12月末日現在）
事業の内容	米国において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

投資顧問会社は、委託会社との投資顧問契約に基づき、グローバル中小型株式クオリティグロースマザーファンドの信託財産の運用助言等を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

- ・ 金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・ 詳細情報の入手方法
 - ①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
 - ②請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・ 目論見書の使用開始日
- ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - ①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - ②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ 約款の内容の重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・ 投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2026年5月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 稲 葉 宏 和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2025年4月1日から2026年3月31日までの第41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2026年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2026年8月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）の2025年7月1日から2026年6月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）の2026年6月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2026年8月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）の2025年7月1日から2026年6月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）の2026年6月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2026年8月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）の2025年7月1日から2026年6月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）の2026年6月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。