投資信託説明書（請求目論見書）

使用開始日
2026年10月14日

Asset Management One

投資のソムリエ

追加型投信／内外／資産複合

■この目論見書により行う「投資のソムリエ」の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第５条の規定により、有価証券届出書を2026年10月13日に関東財務局長に提出しており、2026年10月14日にその効力が生じております。

■「投資のソムリエ」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

アセットマネジメントOne株式会社

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

■委託会社への照会先

【コールセンター】**0120-104-694**（受付時間：営業日の午前９時～午後５時）
【ホームページアドレス】**https://www.am-one.co.jp/**

発行者名	アセットマネジメントOne株式会社
代表者の役職氏名	取締役社長　　杉原　規之
本店の所在の場所	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

目　　次

第一部【証券情報】・・・

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

投資のソムリエ

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」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1万口当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。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　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。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、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「分配金自動けいぞく投資コース」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。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、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10月14日から2027年4月12日まで

※ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、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、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】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※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、販売会社に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。

当ファンドでは、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「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」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。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時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、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

※受益権の取得申込者は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。

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、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当ファンドの信託金限度額は、2兆円とします。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 投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）にマザーファンド*1を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

●外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ*2を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

*1 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、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、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

*2 一部の外貨建資産の通貨については委託会社がその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

2 基準価額の変動リスク*を年率4%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

*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。

※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、上記数値は当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、当ファンドが年率4%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。

3 年2回決算を行います。

●毎年1月、7月の各11日（休業日の場合は翌営業日。）の決算時に、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。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※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。

運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

- 基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。
- 基本配分戦略は月次で行います。

※基本配分戦略に関して、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。

■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

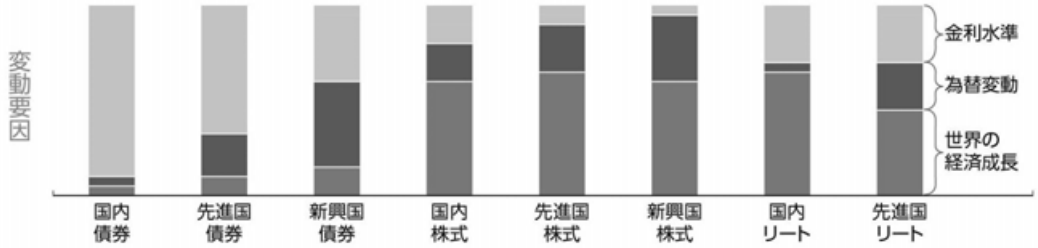
- 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（0%～100%）を変更します。
- 機動的配分戦略は日次で行います。

基本配分戦略
（月次戦略）

当ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、それぞれの変動要因からファンドが受ける影響が均等になるように配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率および通貨配分比率を決定します。

当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

変動要因と値動きへの影響度合い（例）



変動要因からファンドが受ける影響を均等に配分



着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

上記の配分から最適と判断される資産配分比率および通貨配分比率を決定

投資対象資産の基本配分比率



基準価額の変動リスクの目標値 年率4%程度

※当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。
※上記は基本配分比率決定のイメージであり、現金等は考慮していません。
※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。

機動的配分戦略（日次戦略）

市場環境に応じて、安定資産、リスク性資産、現金等*1の比率を調整します。

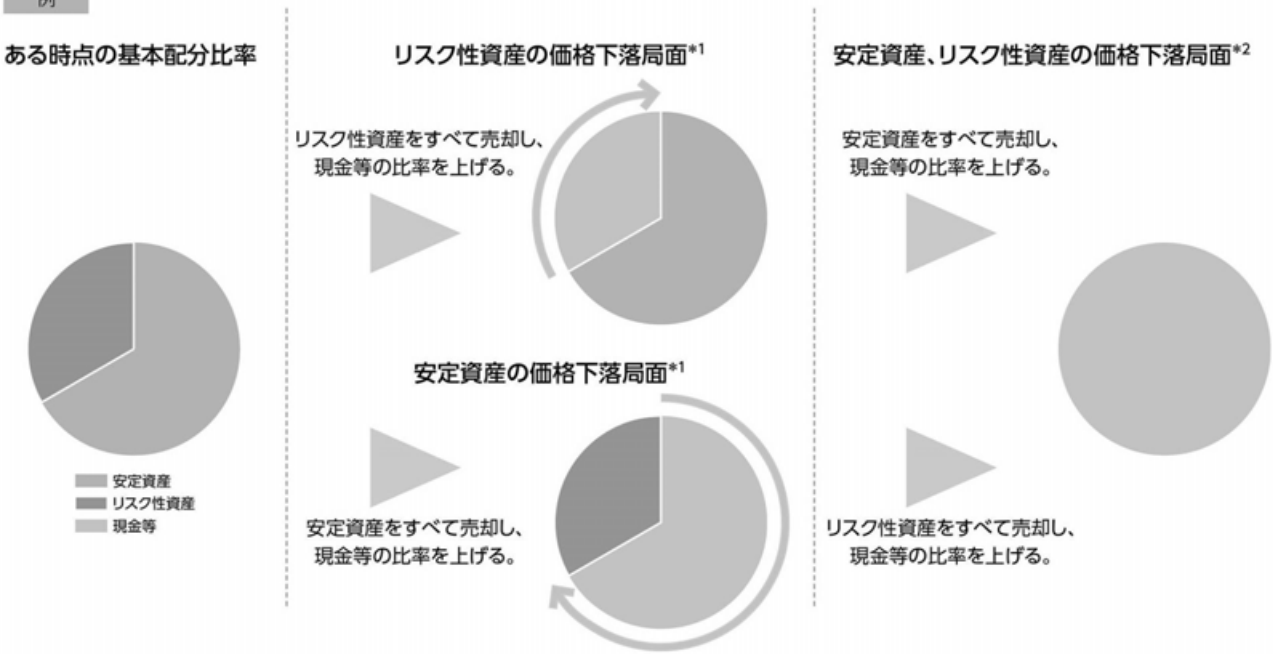
※比率の調整は、「安定局面」、下落の危険性が高まった「警戒局面」、下落の危険性が最も高まった「危機局面」の各判定局面に応じて行います。

リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、安定資産、リスク性資産、現金等の比率を調整*2することで基準価額の下落の抑制をめざします。

*1 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等です。
*2 調整には、有価証券指数等先物取引の売り建てを一時的に活用する場合があります。
※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

価格下落局面における配分比率変更のイメージ

例



*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。
*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産および安定資産をすべて売却し、現金等に入れ替えます。
※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合もあります。
※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。
※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。



○商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （一部ヘッジ） なし

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

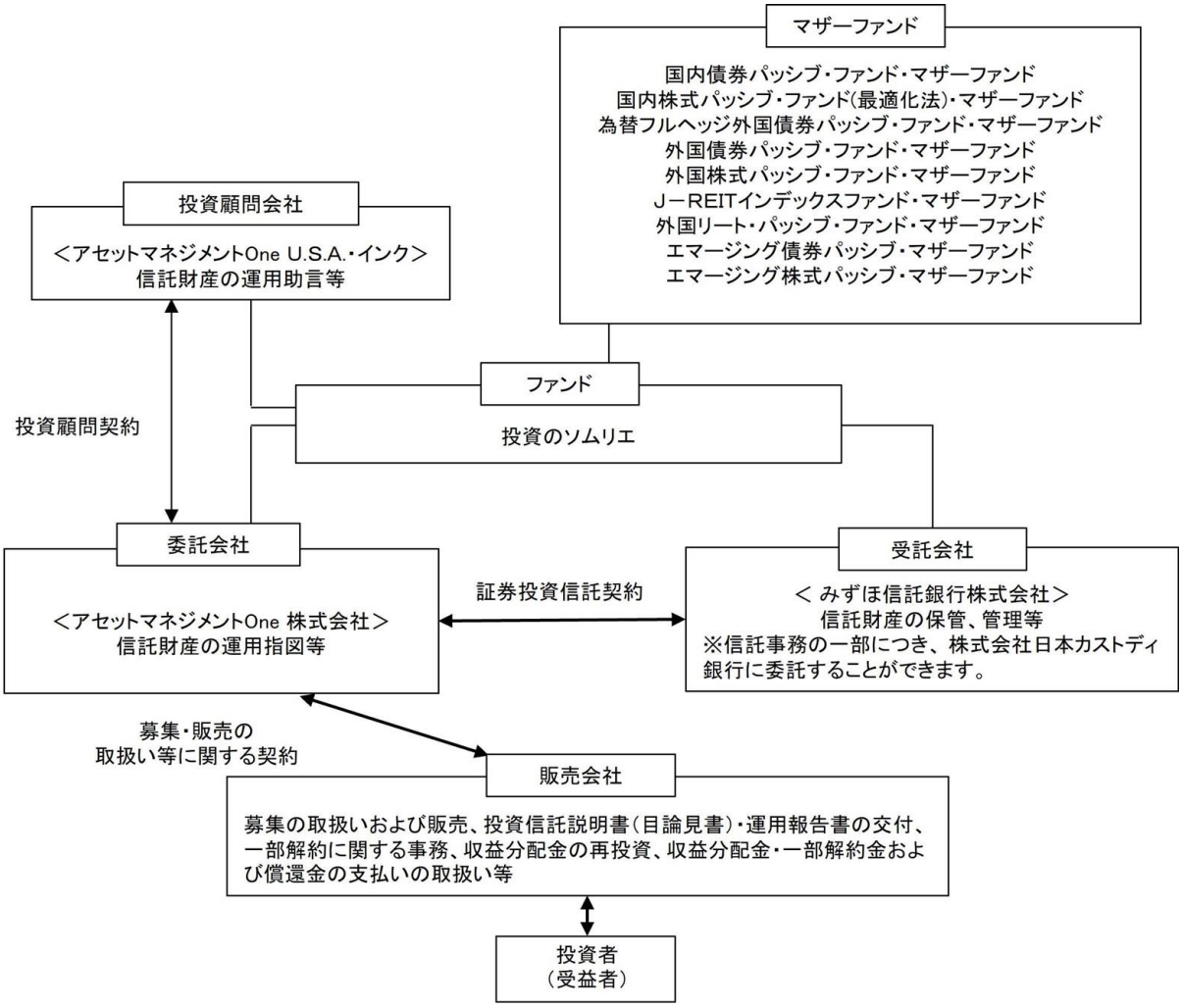
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （債券、株式、 不動産投信） 資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり	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又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います。

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

（２）【ファンドの沿革】

2012年10月26日　信託契約締結、当初設定日、ファンドの運用開始
2013年4月24日　ファンドの名称を「投資のコンシェルジュ」から「投資のソムリエ」に変更
2013年5月17日　投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更
2026年4月14日　ファンドの主要投資対象に「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」を追加

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンド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、当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

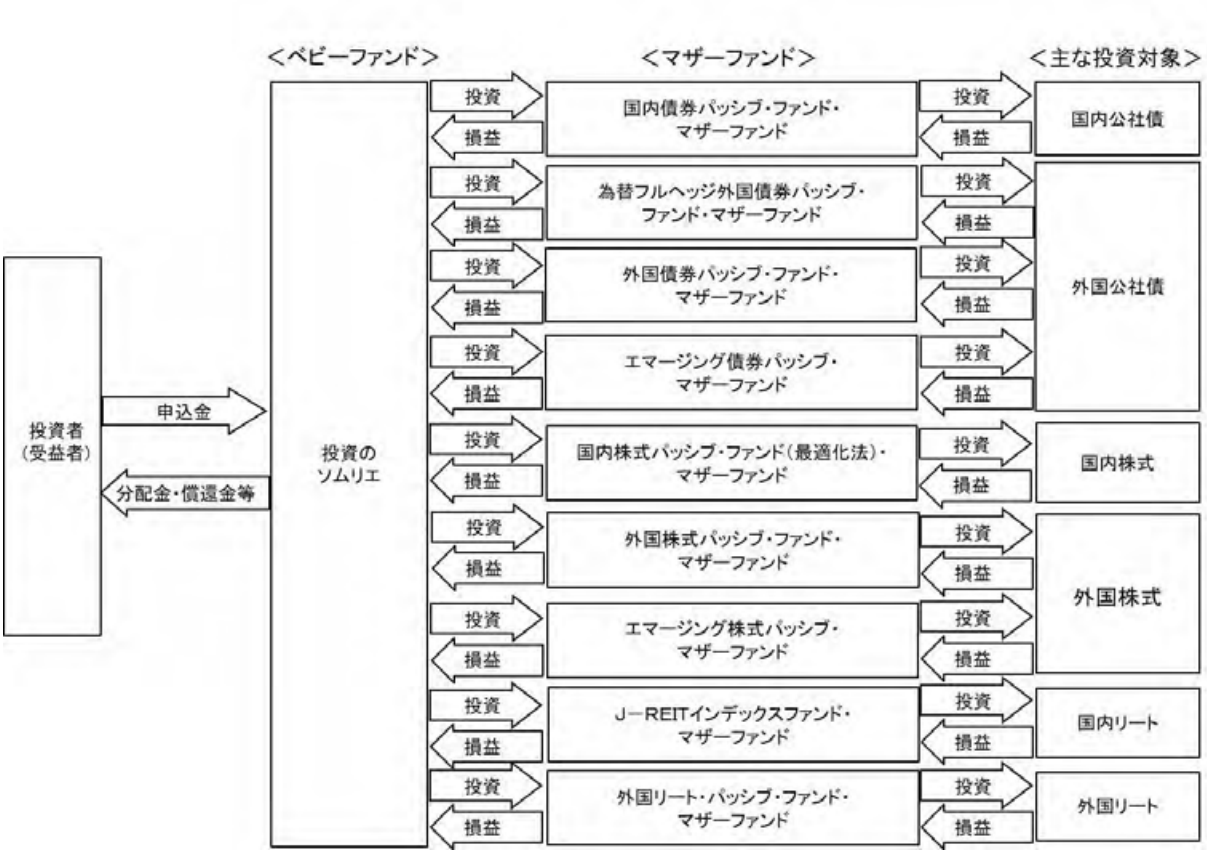
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne Ｕ．Ｓ．Ａ．・インク）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



※当ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産に投資する場合もあります。

○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7月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2026年7月31日現在）

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

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「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、「外国債券パッシブ・ファンド・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、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・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」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産に投資する場合もあります。

＜投資態度＞

①投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

・国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

- 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- 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
- 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
- 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ＊を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

＊一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産へ投資する場合もあります。

②基準価額の変動リスク＊を年率４％程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

※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、上記数値は当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、当ファンドが年率４％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。

＊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基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（０％～１００％）を決定します。

・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。

・基本配分戦略は月次で行います。

④機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（０％～１００％）を変更します。

・機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来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22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
   ハ. 金銭債権
   ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   イ. 為替手形

②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、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、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、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド各受益証券のほか次の有価証券（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（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。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. 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、振替投資法人債を含みます。）
8. 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。）

9. 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。）
10. 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。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 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
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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、振替受益権を含みます。）
15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 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。）
17. 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。）
18. 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。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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。）
21. 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。）
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18.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7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.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）

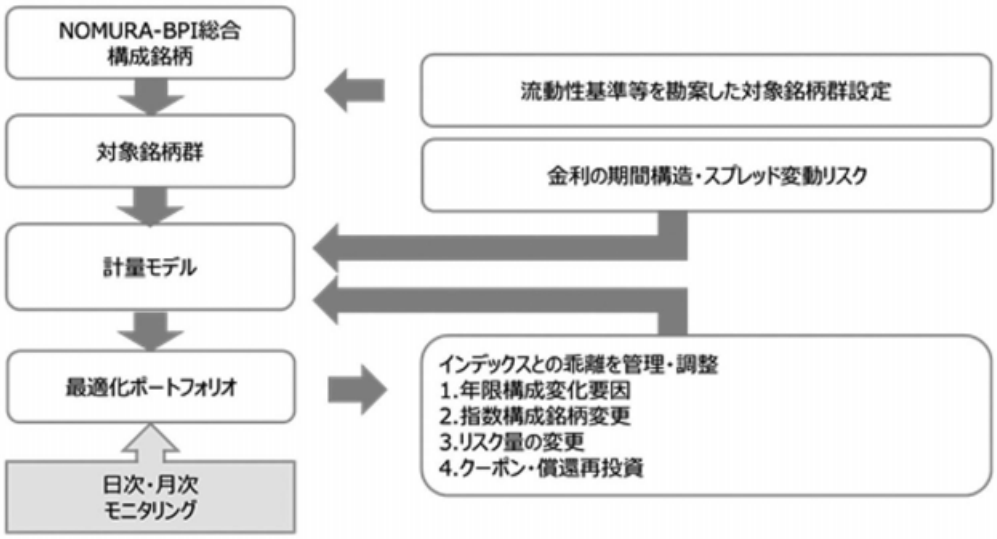
委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図をすることができます。

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5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

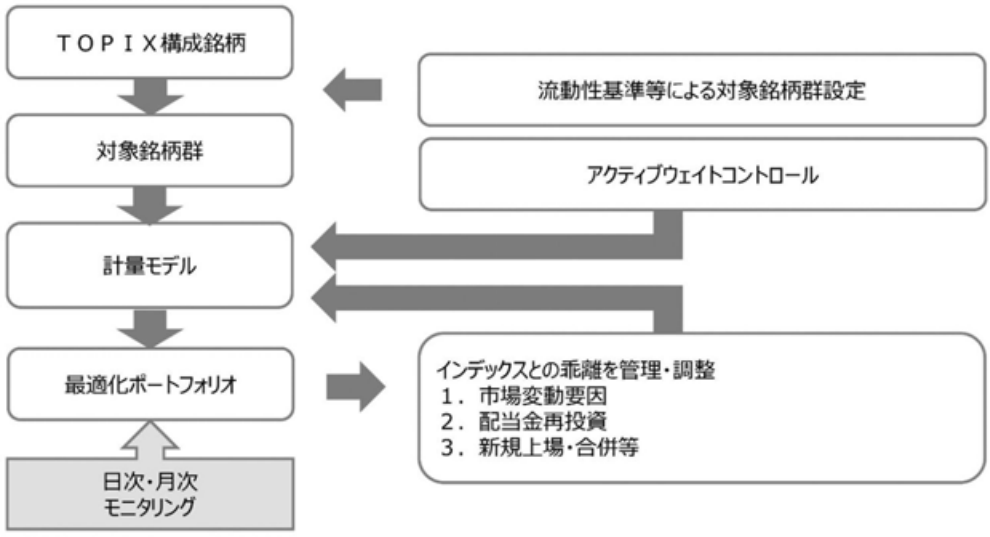
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合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

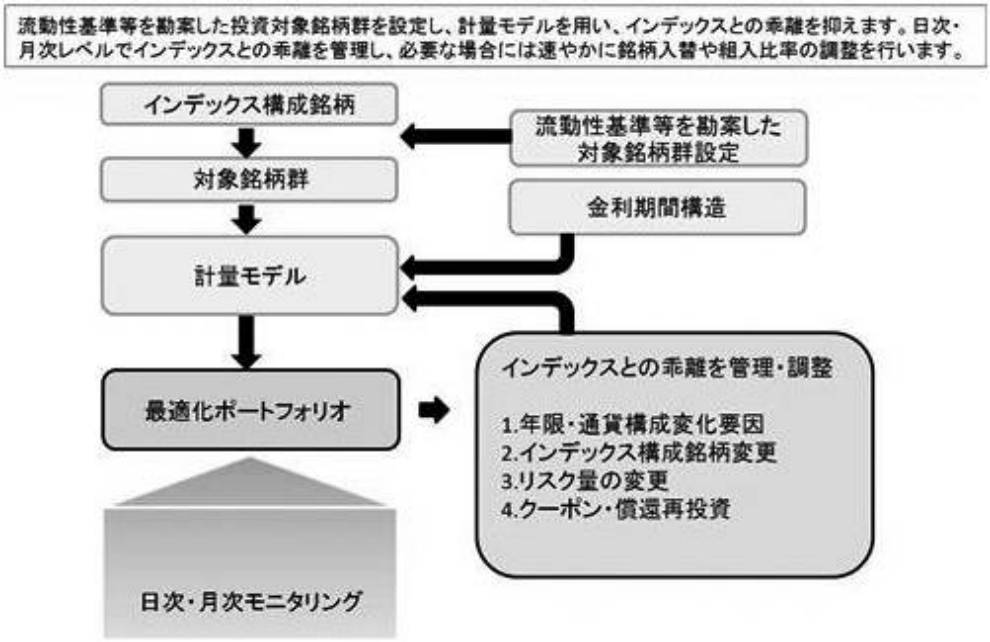
	
主な投資制限	1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. 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	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。

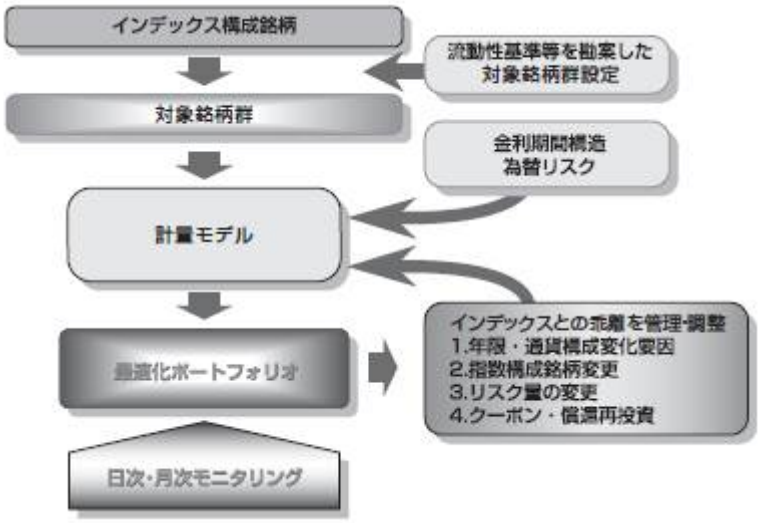
	⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。
運用プロセス	1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、ＴＯＰＩＸ採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2. 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘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	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	
主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等

	により取得するものに限ります。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、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。

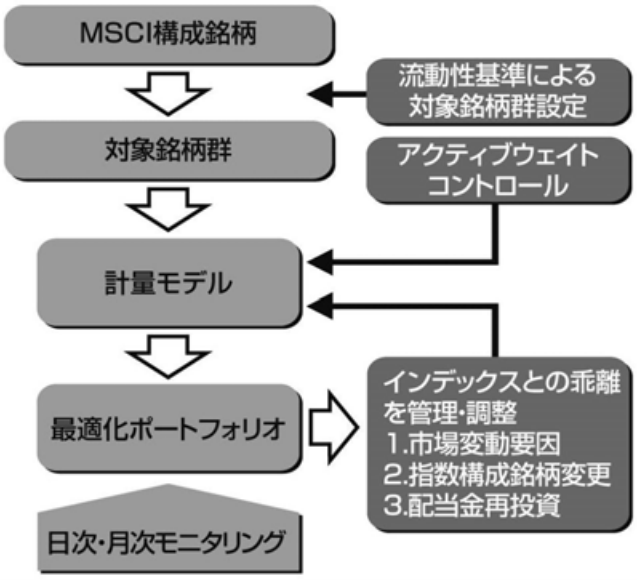
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 ※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 
主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

	7. 一般社団法人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。

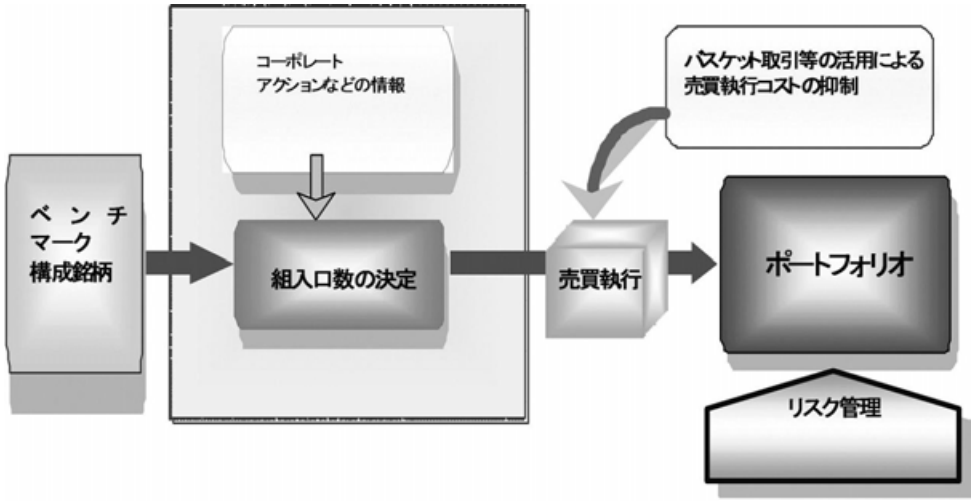
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 ※本ファンドは、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 
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。

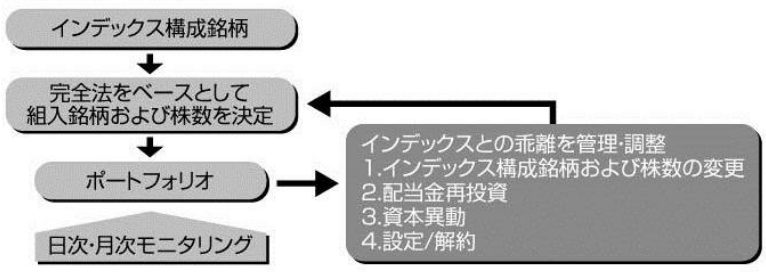
ファンド名	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人資産運用業協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	1. 東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

	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。 
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。

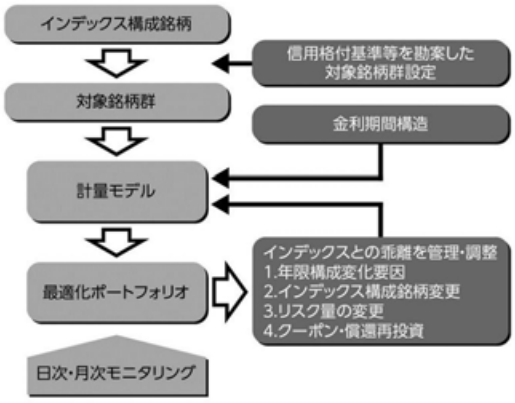
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。

	※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 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。 ※Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社（以下「アセットマネジメントOne」）に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、アセットマネジメントOneにより一定の目的でサブライセンスされています。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）がスポンサーとなっておらず、推奨、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、証券全般または具体的に本商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに関する、S&P Dow Jones IndicesとアセットマネジメントOneとの間における唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesおよび／またはそのライセンサーの一定の商標、サービスマーク、および／または商号をライセンス供与していることです。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、アセットマネジメントOneまたは本商品を考慮することなく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの決定、構成または計算に際して、アセットマネジメントOneまたは本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資リターンを提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indicesは、（改

	正米国1940年投資会社法に定義する）投資顧問、商品取引顧問、コモディティ・プール・オペレーター、ブローカー・ディーラー、受認者、プロモーターでも、合衆国法典第15巻第77条k項(a)に列記する「専門家」でも、税務顧問でもありません。S&P Dow Jones Indicesが、証券、商品、暗号通貨又はその他資産を指数に採用した場合にも、それは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券、商品、暗号通貨またはその他の資産を購入、売却または保有するよう推奨したことにはならず、また投資助言もしくは商品取引の助言とはみなされません。 S&P DOW JONES INDICESまたは第三者ライセンサーは、Ｓ＆Ｐ 先進国ＲＥＩＴインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、アセットマネジメントOne、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られるべき結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、ライセンシーの商品の有価証券届出書、目論見書またはその他の募集資料を審査しておらず、いかなる部分も作成および／または証明しておらず、またS&P DOW JONES 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。 
主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

	2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人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。

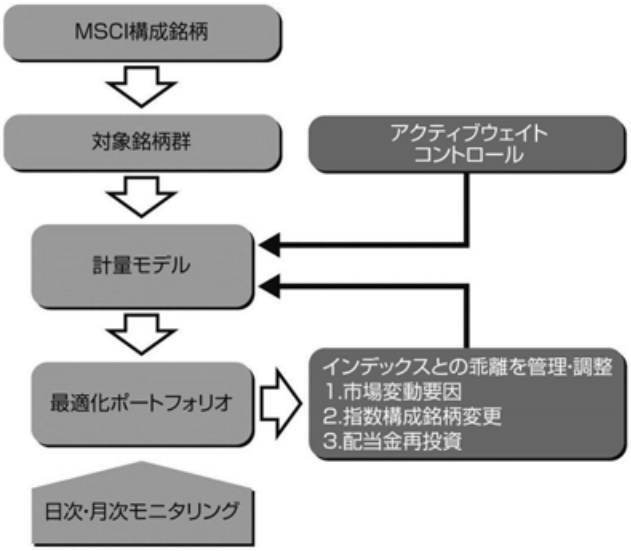
ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、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ＢＢ－格もしくはＢａ３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。 ※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。 
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	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、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。 （＊）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。

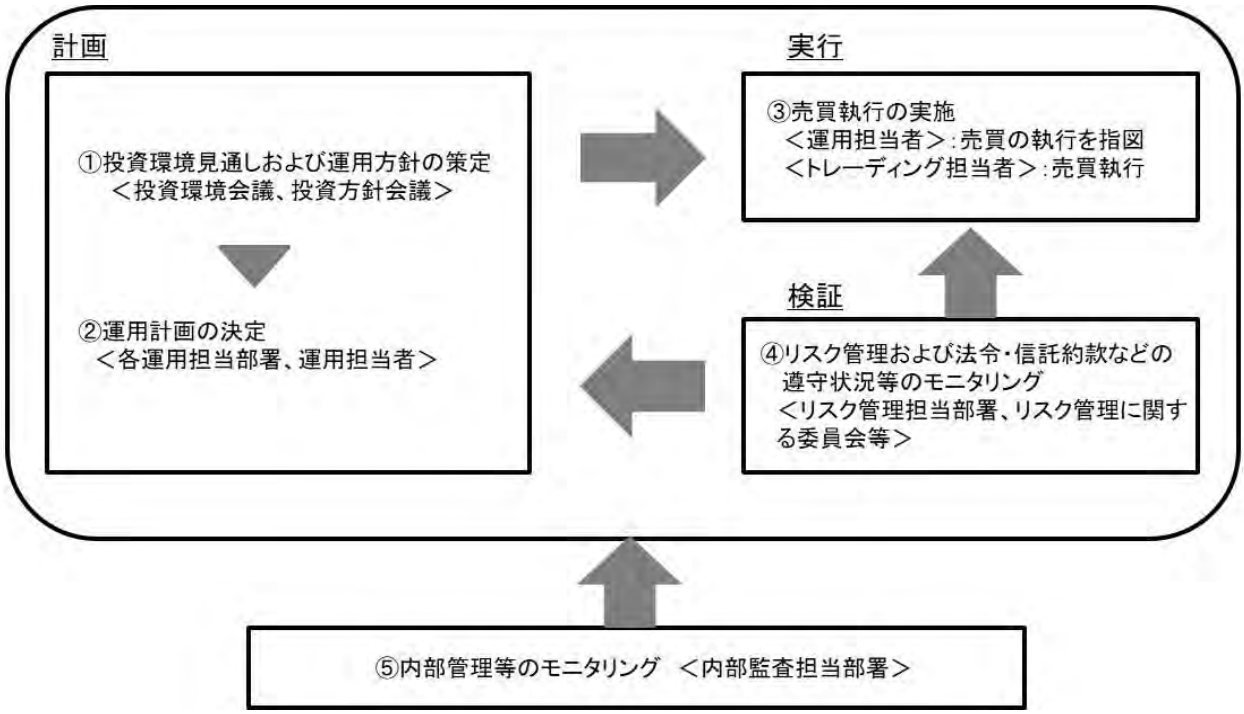
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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。 
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。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は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7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1)分配対象額の範囲

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。）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

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。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)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

(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、監査費用および当該監査費用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、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、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、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、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2)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販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」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各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委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。（約款第17条第3項）

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

⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）について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）

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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑧一般社団法人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）

⑨投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑩信用取引の指図および範囲（約款第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、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引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書の権利行使により取得する株券
2.株式分割により取得する株券
3.有償増資により取得する株券
4.売出しにより取得する株券
5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑪先物取引等の運用指図（約款第22条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、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。

⑫スワップ取引の運用指図（約款第23条）

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

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

3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

4)委託会社は、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。

⑬金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として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。

⑭デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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。

⑮有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

2)上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

⑯特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26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。

⑰外国為替予約取引の指図（約款第27条）

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

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

⑱資金の借入れ（約款第33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。

⑲同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

○資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。

当ファンドは短期金融債等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行いますが、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

○リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

○為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない場合、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、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があり、その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されま

すので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受ける可能性があります。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。

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

○流動性リスク

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

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

○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。

当ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

○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。

○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

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

○当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利と認められる場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、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。

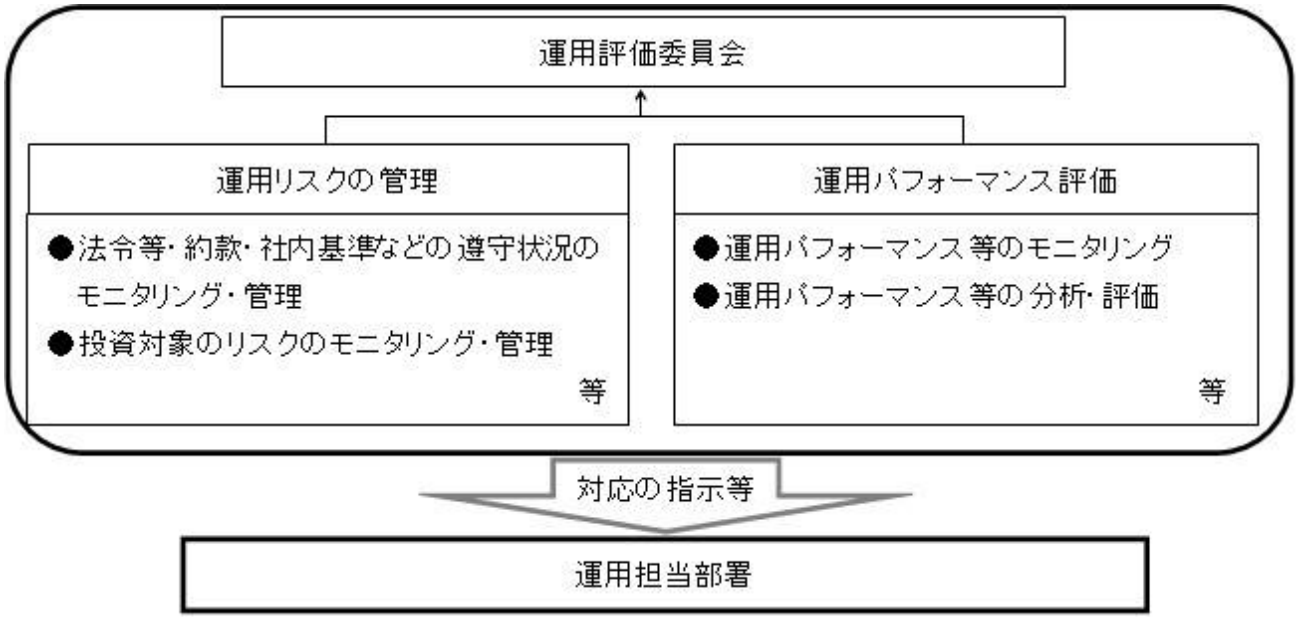
○注意事項

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

＜リスク管理体制＞

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

・運用リスクの管理：運用担当部署から独立した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7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

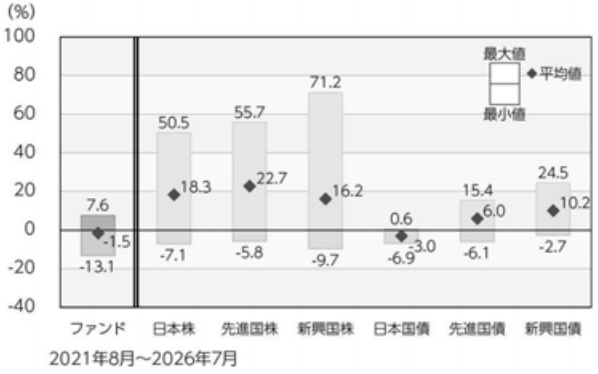
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2021年8月～2026年7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章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、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】

以下により計算される①と②の合計額とします。

①ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%（税抜1.4%）の率を乗じて得た額

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.65%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	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、当ファンドの投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）に対する投資顧問報酬（当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.2925%）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10月13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。

◆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

ありません。

・その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315％（所得税15.315％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ます。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

○法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315％（所得税15.315％）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7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「分配金自動けいぞく投資コース」の両

コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（参考情報）ファンドの総経費率

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.56%	1.54%	0.02%

（表示桁数未満を四捨五入）

※対象期間:2026年1月14日～2026年7月13日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		192,486,235,093	95.78
	内　日本	192,486,235,093	95.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,471,159,306	4.22
純資産総額		200,957,394,399	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		392,492,293,550	87.85
	内　日本	392,492,293,550	87.85
地方債証券		21,927,679,777	4.91
	内　日本	21,927,679,777	4.91
特殊債券		16,465,148,798	3.69
	内　日本	16,465,148,798	3.69
社債券		13,710,645,000	3.07
	内　日本	13,415,274,000	3.00
	内　フランス	295,371,000	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,168,656,295	0.49
純資産総額		446,764,423,420	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		882,409,965,940	98.25
	内　日本	882,409,965,940	98.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		15,717,801,440	1.75
純資産総額		898,127,767,380	100.00

その他資産の投資状況

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		16,025,730,000	1.78
	内　日本	16,025,730,000	1.78

（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。

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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券		261,121,960,968	98.21
	内　アメリカ	117,133,851,616	44.05
	内　中国	33,403,017,725	12.56
	内　フランス	18,283,254,307	6.88
	内　イタリア	16,887,285,171	6.35
	内　イギリス	15,046,391,227	5.66
	内　ドイツ	14,612,976,566	5.50
	内　スペイン	10,731,912,758	4.04
	内　カナダ	5,466,878,787	2.06
	内　ベルギー	3,713,623,564	1.40
	内　オーストラリア	3,390,099,486	1.28
	内　オランダ	3,095,215,133	1.16
	内　オーストリア	2,686,121,068	1.01
	内　韓国	2,545,994,039	0.96
	内　メキシコ	2,246,341,887	0.84
	内　ポーランド	1,925,344,167	0.72
	内　ポルトガル	1,473,909,163	0.55
	内　フィンランド	1,374,431,820	0.52
	内　マレーシア	1,260,500,790	0.47
	内　イスラエル	1,115,873,861	0.42
	内　アイルランド	1,063,503,835	0.40
	内　シンガポール	945,334,417	0.36
	内　ニュージーランド	744,685,422	0.28
	内　スロバキア	553,740,732	0.21
	内　デンマーク	517,408,443	0.19
	内　スウェーデン	477,608,993	0.18
	内　ノルウェー	426,655,991	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,763,032,364	1.79
純資産総額		265,884,993,332	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7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		331,591,699,872	98.45
	内　アメリカ	148,601,764,945	44.12
	内　中国	42,283,716,524	12.55
	内　フランス	23,227,392,616	6.90
	内　イタリア	21,413,234,736	6.36
	内　イギリス	19,111,351,049	5.67
	内　ドイツ	18,601,355,141	5.52
	内　スペイン	13,679,340,722	4.06
	内　カナダ	6,964,695,647	2.07
	内　ベルギー	4,774,185,651	1.42
	内　オーストラリア	4,322,609,776	1.28
	内　オランダ	4,014,414,188	1.19
	内　オーストリア	3,428,786,288	1.02
	内　韓国	3,255,608,786	0.97
	内　メキシコ	2,870,360,369	0.85

	内　ポーランド	2,431,358,379	0.72
	内　ポルトガル	1,889,783,024	0.56
	内　フィンランド	1,736,386,566	0.52
	内　マレーシア	1,587,018,036	0.47
	内　イスラエル	1,409,297,510	0.42
	内　アイルランド	1,341,677,333	0.40
	内　シンガポール	1,200,777,379	0.36
	内　ニュージーランド	944,150,349	0.28
	内　スロバキア	679,126,560	0.20
	内　デンマーク	652,962,489	0.19
	内　スウェーデン	614,987,047	0.18
	内　ノルウェー	555,358,762	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,215,757,577	1.55
純資産総額		336,807,457,449	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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		2,802,729,112,801	96.94
	内　アメリカ	2,061,623,968,236	71.31
	内　イギリス	106,451,430,628	3.68
	内　カナダ	105,767,856,956	3.66
	内　スイス	78,823,295,754	2.73
	内　ドイツ	65,708,762,736	2.27
	内　フランス	65,343,321,374	2.26
	内　オランダ	55,086,995,364	1.91
	内　オーストラリア	47,509,779,171	1.64
	内　アイルランド	46,677,216,175	1.61
	内　スペイン	29,107,829,499	1.01
	内　スウェーデン	23,077,738,331	0.80
	内　イタリア	22,423,770,716	0.78
	内　デンマーク	12,879,653,387	0.45
	内　シンガポール	12,726,772,659	0.44
	内　香港	10,198,988,778	0.35
	内　フィンランド	8,410,084,479	0.29
	内　イスラエル	8,229,404,636	0.28
	内　ケイマン諸島	6,846,972,535	0.24
	内　ベルギー	6,378,912,513	0.22
	内　ジャージィー	5,004,644,429	0.17
	内　ノルウェー	4,700,372,649	0.16
	内　ルクセンブルグ	4,674,564,621	0.16
	内　バミューダ	4,120,576,925	0.14
	内　リベリア	2,787,403,883	0.10
	内　オーストリア	2,715,226,290	0.09
	内　オランダ領キュラソー	2,494,189,498	0.09
	内　ニュージーランド	1,611,976,165	0.06
	内　ポルトガル	1,347,404,414	0.05
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		3,062,351,661	0.11
	内　オーストラリア	2,403,199,176	0.08
	内　シンガポール	659,152,485	0.02
投資証券		40,930,068,416	1.42
	内　アメリカ	38,654,203,820	1.34
	内　フランス	1,003,832,821	0.03
	内　イギリス	798,303,344	0.03
	内　香港	473,728,431	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		44,372,798,588	1.53
純資産総額		2,891,094,331,466	100.00

その他資産の投資状況

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		44,030,998,684	1.52
	内　アメリカ	34,047,788,670	1.18
	内　ドイツ	5,774,490,737	0.20
	内　カナダ	1,782,396,079	0.06
	内　イギリス	1,671,182,781	0.06
	内　オーストラリア	755,140,417	0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		191,433,195,150	97.00
	内　日本	191,433,195,150	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,912,514,734	3.00
純資産総額		197,345,709,884	100.00

その他資産の投資状況

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		5,256,880,000	2.66
	内　日本	5,256,880,000	2.66

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		13,435,081,325	9.52
	内　オーストラリア	8,997,520,467	6.37
	内　シンガポール	4,358,556,541	3.09

	内　香港	79,004,317	0.06
投資証券		125,530,074,483	88.93
	内　アメリカ	110,785,722,744	78.48
	内　イギリス	5,738,931,831	4.07
	内　フランス	2,903,674,872	2.06
	内　カナダ	1,596,734,258	1.13
	内　ベルギー	1,396,204,818	0.99
	内　香港	1,131,924,609	0.80
	内　スペイン	761,442,530	0.54
	内　ガーンジィ	325,392,983	0.23
	内　韓国	227,752,955	0.16
	内　イスラエル	207,658,395	0.15
	内　オランダ	199,984,593	0.14
	内　ニュージーランド	154,254,662	0.11
	内　アイルランド	53,613,562	0.04
	内　ドイツ	26,906,303	0.02
	内　イタリア	19,875,368	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,194,179,528	1.55
純資産総額		141,159,335,336	100.00

その他資産の投資状況

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		1,891,280,636	1.34
	内　アメリカ	1,891,280,636	1.34

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		102,951,991,014	97.41
	内　メキシコ	12,549,752,894	11.87
	内　トルコ	11,924,706,785	11.28
	内　サウジアラビア	10,335,764,884	9.78
	内　ブラジル	9,825,400,228	9.30
	内　ポーランド	9,553,593,532	9.04
	内　ハンガリー	8,011,571,590	7.58
	内　南アフリカ	7,822,079,143	7.40
	内　ルーマニア	7,151,658,349	6.77
	内　チリ	5,391,770,272	5.10
	内　コロンビア	5,130,222,580	4.85
	内　ドミニカ共和国	4,068,498,223	3.85
	内　ペルー	2,573,922,764	2.44
	内　フィリピン	2,031,180,892	1.92
	内　ウルグアイ	1,993,120,864	1.89
	内　パナマ	1,668,813,619	1.58
	内　インドネシア	1,600,263,046	1.51

	内　中国	1,319,671,349	1.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,737,792,042	2.59
純資産総額		105,689,783,056	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7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		190,678,522,115	94.44
	内　台湾	49,061,701,098	24.30
	内　韓国	34,068,787,649	16.87
	内　インド	23,773,190,346	11.77
	内　ケイマン諸島	23,331,040,978	11.56
	内　中国	19,080,798,463	9.45
	内　ブラジル	6,982,728,939	3.46
	内　南アフリカ	5,364,297,338	2.66
	内　サウジアラビア	5,024,820,477	2.49
	内　メキシコ	2,631,526,997	1.30
	内　アラブ首長国連邦	2,415,883,356	1.20
	内　ポーランド	2,079,885,390	1.03
	内　タイ	1,998,934,456	0.99
	内　マレーシア	1,970,474,239	0.98
	内　香港	1,712,152,701	0.85
	内　クエート	1,119,770,181	0.55
	内　ギリシャ	1,106,429,773	0.55
	内　インドネシア	1,005,230,254	0.50
	内　カタール	975,279,400	0.48
	内　チリ	942,855,755	0.47
	内　トルコ	745,154,416	0.37
	内　ハンガリー	729,703,437	0.36
	内　バミューダ	719,604,129	0.36
	内　イギリス	696,738,359	0.35
	内　フィリピン	630,296,536	0.31
	内　アメリカ	562,612,150	0.28
	内　スイス	390,306,437	0.19
	内　コロンビア	354,491,826	0.18
	内　ルクセンブルグ	273,365,221	0.14
	内　チェコ	241,205,437	0.12
	内　オランダ	159,427,464	0.08
	内　ロシア	156,006,914	0.08
	内　エジプト	129,528,537	0.06
	内　カナダ	88,001,476	0.04
	内　ペルー	83,864,191	0.04
	内　シンガポール	41,133,675	0.02
	内　イギリス領バージン諸島	31,294,120	0.02
	内　キプロス	0	0.00
投資信託受益証券		1,098,522,065	0.54
	内　メキシコ	784,736,603	0.39
	内　ブラジル	313,785,462	0.16

投資証券		160,504,258	0.08
	内　メキシコ	160,504,258	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,961,840,616	4.93
純資産総額		201,899,389,054	100.00

その他資産の投資状況

2026年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		9,810,309,423	4.86
	内　アメリカ	9,810,309,423	4.86

（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】

2026年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率（%）
1	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	69,854,351,680	1.1411 79,717,786,137	1.1354 79,312,630,897	－ －	39.47
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	2,181,877,447	13.9410 30,417,771,676	13.7114 29,916,594,426	－ －	14.89
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	26,778,224,537	1.0966 29,365,001,028	1.0957 29,340,900,625	－ －	14.60
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,920,318,143	2.8849 14,194,625,811	2.8314 13,931,388,790	－ －	6.93
5	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	1,638,147,245	7.4208 12,156,526,890	7.4130 12,143,585,527	－ －	6.04
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,265,468,877	2.7296 8,913,424,205	2.7744 9,059,716,852	－ －	4.51
7	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	3,307,794,521	2.6611 8,802,702,779	2.7147 8,979,669,786	－ －	4.47
8	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	2,000,918,741	3.0947 6,192,443,319	2.8456 5,693,814,369	－ －	2.83
9	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	1,497,551,610	2.7639 4,139,232,650	2.7431 4,107,933,821	－ －	2.04

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	95.78
合計	95.78

（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）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,660,000,000	97.72 5,531,073,800	97.89 5,540,687,200	0.1 2028/3/20	1.24
2	３６９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,920,000,000	90.69 5,368,848,000	89.66 5,307,872,000	0.5 2032/12/20	1.19
3	３７０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,930,000,000	90.47 5,365,130,000	89.11 5,284,223,000	0.5 2033/3/20	1.18
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	97.07 4,756,773,000	2.4 2036/3/20	1.06
5	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	98.68 4,312,709,300	0.1 2027/9/20	0.97
6	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	97.46 4,288,548,000	0.1 2028/6/20	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	96.10 4,286,416,800	0.1 2029/3/20	0.96
8	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	88.52 4,204,890,000	0.2 2032/9/20	0.94
9	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	99.94 4,097,663,000	1.4 2028/4/1	0.92
10	３７１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,650,000,000	89.38 4,156,608,000	87.82 4,083,955,500	0.4 2033/6/20	0.91
11	３７４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,590,000,000	90.69 4,162,840,000	88.51 4,062,792,600	0.8 2034/3/20	0.91
12	３７２回　利付国庫債券	国債証	4,500,000,000	92.16	89.73	0.8	0.90

	（１０年） 日本	券		4,147,302,000	4,038,210,000	2033/9/20	
13	３７９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,420,000,000	93.52 4,133,974,200	91.01 4,022,818,800	1.5 2035/6/20	0.90
14	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	94.94 3,987,480,000	2.1 2035/12/20	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	89.80 3,933,459,000	0.2 2032/3/20	0.88
16	１８３回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	3,900,000,000	99.44 3,878,536,000	98.54 3,843,333,000	1.6 2030/12/20	0.86
17	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	100.04 3,801,596,000	2 2031/3/20	0.85
18	３７６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,220,000,000	90.47 3,818,091,000	88.02 3,714,739,400	0.9 2034/9/20	0.83
19	３７８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,070,000,000	93.95 3,823,995,000	90.71 3,691,978,400	1.4 2035/3/20	0.83
20	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	89.91 3,677,605,300	0.1 2031/12/20	0.82
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	89.68 3,677,167,000	1.2 2034/12/20	0.82
22	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	92.30 3,600,051,000	0.1 2030/12/20	0.81
23	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	93.47 3,598,941,500	0.1 2030/6/20	0.81
24	３８０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,900,000,000	95.31 3,717,284,000	92.13 3,593,226,000	1.7 2035/9/20	0.80
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	87.77 3,563,786,800	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	96.57 3,563,433,000	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	90.52 3,539,527,500	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	92.90 3,530,504,000	0.1 2030/9/20	0.79
29	１５８回　利付国庫債券	国債証	3,600,000,000	97.64	97.89	0.1	0.79

	（５年） 日本	券		3,515,148,000	3,524,112,000	2028/3/20	
30	３６７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,950,000,000	90.26 3,565,561,000	89.17 3,522,215,000	0.2 2032/6/20	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7月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	87.85
地方債証券	4.91
特殊債券	3.69
社債券	3.07
合計	99.51

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2026年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,822,900	2,968.70 29,161,261,808	3,571.00 35,077,575,900	－ －	3.91
2	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,763,100	3,702.74 28,744,753,954	3,067.00 23,809,427,700	－ －	2.65
3	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,394,100	5,993.96 20,344,116,639	6,814.00 23,127,397,400	－ －	2.58
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	4,021,000	5,774.60 23,219,678,741	5,267.00 21,178,607,000	－ －	2.36
5	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,287,800	3,452.17 18,254,408,017	3,787.00 20,024,898,600	－ －	2.23
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	332,000	41,248.28 13,694,428,967	55,500.00 18,426,000,000	－ －	2.05
7	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,165,600	7,554.67 16,360,410,452	8,167.00 17,686,455,200	－ －	1.97
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	3,039,400	4,277.36 13,000,626,677	5,260.00 15,987,244,000	－ －	1.78
9	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	476,000	27,367.13 13,026,754,221	32,500.00 15,470,000,000	－ －	1.72
10	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,070,200	4,927.64 15,128,870,254	4,776.00 14,663,275,200	－ －	1.63
11	リクルートホールディング	株式	1,131,400	7,259.69	12,550.00	－	1.58

	ス 日本	サービス業		8,213,622,704	14,199,070,000	－	
12	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,600,600	6,187.67 9,904,000,357	8,114.00 12,987,268,400	－ －	1.45
13	キーエンス 日本	株式 電気機器	158,200	55,885.71 8,841,120,812	81,150.00 12,837,930,000	－ －	1.43
14	三井物産 日本	株式 卸売業	2,370,400	5,375.98 12,743,234,738	4,937.00 11,702,664,800	－ －	1.30
15	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	5,622,400	2,064.43 11,607,076,419	2,014.00 11,323,513,600	－ －	1.26
16	三菱重工業 日本	株式 機械	2,991,900	4,940.45 14,781,338,118	3,764.00 11,261,511,600	－ －	1.25
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,508,900	3,399.24 5,129,121,712	7,416.00 11,190,002,400	－ －	1.25
18	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,749,200	5,751.95 10,061,311,680	5,912.00 10,341,270,400	－ －	1.15
19	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	112,700	68,130.24 7,678,278,886	78,190.00 8,812,013,000	－ －	0.98
20	信越化学工業 日本	株式 化学	1,408,200	5,352.30 7,537,118,603	5,800.00 8,167,560,000	－ －	0.91
21	パナソニック　ホールディングス 日本	株式 電気機器	1,886,700	2,516.99 4,748,814,376	4,284.00 8,082,622,800	－ －	0.90
22	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,411,100	5,509.04 7,773,819,522	5,513.00 7,779,394,300	－ －	0.87
23	任天堂 日本	株式 その他製品	989,100	8,626.28 8,532,258,348	7,679.00 7,595,298,900	－ －	0.85
24	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	296,800	27,404.22 8,133,572,996	24,675.00 7,323,540,000	－ －	0.82
25	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	946,100	6,131.07 5,800,606,651	7,135.00 6,750,423,500	－ －	0.75
26	丸紅 日本	株式 卸売業	1,276,600	5,944.04 7,588,164,882	5,201.00 6,639,596,600	－ －	0.74
27	ＮＴＴ 日本	株式 情報・通信業	43,539,200	152.52 6,640,910,861	152.40 6,635,374,080	－ －	0.74
28	住友商事 日本	株式 卸売業	3,954,500	1,582.08 6,256,355,682	1,670.00 6,604,015,000	－ －	0.74
29	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	2,131,400	2,551.29 5,437,824,664	2,921.00 6,225,819,400	－ －	0.69
30	オリックス 日本	株式 その他金融業	930,100	5,057.62 4,704,097,580	6,410.00 5,961,941,000	－ －	0.66

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）

株式	98.25
合計	98.25

（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7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	20.56
銀行業		12.14
卸売業		7.35
情報・通信業		6.12
機械		5.86
輸送用機器		5.04
化学		4.43
小売業		3.93
サービス業		3.73
保険業		3.63
医薬品		3.18
食料品		2.76
非鉄金属		2.15
建設業		2.01
その他製品		1.95
陸運業		1.89
精密機器		1.75
不動産業		1.63
その他金融業		1.25
電気・ガス業		1.18
証券、商品先物取引業		0.96
ガラス・土石製品		0.75
鉄鋼		0.69
ゴム製品		0.58
海運業		0.54
石油・石炭製品		0.47
金属製品		0.46
鉱業		0.35
繊維製品		0.30
空運業		0.27
倉庫・運輸関連業		0.13
パルプ・紙		0.13
水産・農林業		0.07
合計		98.25

（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。

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7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	国債証券	1,510,182,400	100.50	100.45	1.62	0.57

	中国			1,517,838,118	1,517,055,240	2027/8/15	
2	US T N/B 4.875 10/31/28 アメリカ	国債証券	1,494,696,000	101.49 1,517,028,863	101.29 1,514,021,954	4.875 2028/10/31	0.57
3	US T N/B 4.125 02/15/36 アメリカ	国債証券	1,414,336,000	97.48 1,378,756,610	95.92 1,356,768,111	4.125 2036/2/15	0.51
4	US T N/B 4.25 11/15/34 アメリカ	国債証券	1,333,976,000	98.91 1,319,489,846	97.61 1,302,189,859	4.25 2034/11/15	0.49
5	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28 中国	国債証券	1,260,467,200	100.28 1,264,010,121	100.33 1,264,709,806	1.42 2028/8/15	0.48
6	US T N/B 4.625 02/15/35 アメリカ	国債証券	1,221,472,000	101.50 1,239,889,501	100.10 1,222,784,129	4.625 2035/2/15	0.46
7	US T N/B 1.0 07/31/28 アメリカ	国債証券	1,248,794,400	93.62 1,169,183,757	93.83 1,171,744,759	1 2028/7/31	0.44
8	US T N/B 2.625 07/31/29 アメリカ	国債証券	1,221,472,000	95.46 1,166,052,482	95.35 1,164,692,631	2.625 2029/7/31	0.44
9	US T N/B 3.625 10/31/30 アメリカ	国債証券	1,157,184,000	97.62 1,129,746,079	97.17 1,124,547,799	3.625 2030/10/31	0.42
10	US T N/B 3.375 02/29/28 アメリカ	国債証券	1,125,040,000	98.70 1,110,427,665	98.73 1,110,845,156	3.375 2028/2/29	0.42
11	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32 中国	国債証券	1,079,720,960	101.48 1,095,730,394	101.70 1,098,081,614	1.78 2032/9/15	0.41
12	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30 中国	国債証券	1,093,990,400	100.23 1,096,576,854	100.31 1,097,451,676	1.43 2030/1/25	0.41
13	FRANCE OAT 3.5 11/25/35 フランス	国債証券	1,073,696,000	98.95 1,062,529,561	97.21 1,043,847,251	3.5 2035/11/25	0.39
14	CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32 中国	国債証券	1,022,643,200	101.61 1,039,173,409	101.86 1,041,742,288	1.79 2032/3/25	0.39
15	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28 中国	国債証券	998,860,800	103.99 1,038,800,948	103.96 1,038,451,347	2.91 2028/10/14	0.39
16	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 中国	国債証券	998,860,800	100.45 1,003,437,380	100.44 1,003,280,359	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	980,392,000	100.89 989,142,762	99.78 978,323,980	4.5 2033/11/15	0.37
18	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証券	927,513,600	104.88 972,846,661	104.87 972,750,386	2.68 2030/5/21	0.37
19	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,125,040,000	86.40 972,099,850	85.90 966,501,647	1.25 2031/8/15	0.36
20	CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31 中国	国債証券	927,513,600	103.23 957,473,587	103.41 959,174,183	2.12 2031/6/25	0.36
21	US T N/B 4.125 11/30/29 アメリカ	国債証券	964,320,000	99.74 961,815,024	99.41 958,707,358	4.125 2029/11/30	0.36
22	US T N/B 3.5 01/31/28 アメリカ	国債証券	948,248,000	98.94 938,209,902	98.96 938,395,115	3.5 2028/1/31	0.35

23	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35 中国	国債証券	903,731,200	99.41 898,437,630	99.84 902,335,613	1.61 2035/2/15	0.34
24	US T N/B 4.625 05/31/31 アメリカ	国債証券	883,960,000	101.69 898,928,327	101.04 893,179,427	4.625 2031/5/31	0.34
25	US T N/B 3.375 09/15/28 アメリカ	国債証券	900,032,000	98.26 884,457,224	98.22 884,035,334	3.375 2028/9/15	0.33
26	US T N/B 3.75 06/30/27 アメリカ	国債証券	883,960,000	99.63 880,773,271	99.67 881,117,298	3.75 2027/6/30	0.33
27	US T N/B 4.25 05/31/33 アメリカ	国債証券	883,960,000	99.64 880,786,583	98.50 870,700,600	4.25 2033/5/31	0.33
28	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30 中国	国債証券	856,166,400	100.79 862,981,912	100.95 864,311,624	1.63 2030/10/25	0.33
29	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	891,996,000	97.04 865,671,074	96.12 857,413,731	3.875 2033/8/15	0.32
30	US T N/B 3.875 09/30/32 アメリカ	国債証券	883,960,000	97.66 863,293,977	96.83 855,956,420	3.875 2032/9/30	0.32

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.21
合計	98.21

（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7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率（%）
1	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28 中国	国債証券	1,878,809,600	100.25 1,883,564,115	100.36 1,885,651,097	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	1,885,245,600	96.47 1,818,879,848	93.42 1,761,305,420	3.375 2033/5/15	0.52
3	FRANCE OAT 3.5 11/25/33 フランス	国債証券	1,684,592,000	101.47 1,709,470,965	99.24 1,671,848,061	3.5 2033/11/25	0.50
4	US T N/B 3.5 04/30/30 アメリカ	国債証券	1,623,272,000	98.37 1,596,915,313	97.13 1,576,761,457	3.5 2030/4/30	0.47
5	US T N/B 4.25 02/15/54 アメリカ	国債証券	1,816,136,000	90.01 1,634,786,766	85.53 1,553,363,822	4.25 2054/2/15	0.46
6	US T N/B 4.125 06/15/29 アメリカ	国債証券	1,542,912,000	99.91 1,541,631,383	99.56 1,536,222,025	4.125 2029/6/15	0.46
7	US T N/B 4.25 08/15/35 アメリカ	国債証券	1,526,840,000	101.95 1,556,661,092	97.16 1,483,599,417	4.25 2035/8/15	0.44
8	US T N/B 3.875 07/15/28	国債証	1,478,624,000	100.47	99.31	3.875	0.44

	アメリカ	券		1,485,692,137	1,468,458,460	2028/7/15	
9	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,478,624,000	99.86 1,476,694,262	96.12 1,421,298,440	3.875 2033/8/15	0.42
10	US T N/B 4.0 11/15/35 アメリカ	国債証券	1,448,890,800	98.60 1,428,647,989	95.14 1,378,483,762	4 2035/11/15	0.41
11	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 中国	国債証券	1,355,596,800	100.30 1,359,770,953	100.44 1,361,594,773	1.46 2028/5/25	0.40
12	US T N/B 4.125 02/15/36 アメリカ	国債証券	1,414,336,000	100.13 1,416,187,494	95.92 1,356,768,111	4.125 2036/2/15	0.40
13	US T N/B 4.125 07/31/31 アメリカ	国債証券	1,366,120,000	102.38 1,398,752,125	98.83 1,350,217,516	4.125 2031/7/31	0.40
14	US T N/B 4.625 02/15/35 アメリカ	国債証券	1,317,904,000	104.98 1,383,567,538	100.10 1,319,319,718	4.625 2035/2/15	0.39
15	US T N/B 4.125 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,285,760,000	101.10 1,300,023,900	99.91 1,284,629,932	4.125 2027/11/15	0.38
16	US T N/B 4.25 05/15/35 アメリカ	国債証券	1,285,760,000	102.04 1,312,077,898	97.32 1,251,406,098	4.25 2035/5/15	0.37
17	US T N/B 3.5 11/15/28 アメリカ	国債証券	1,205,400,000	100.14 1,207,185,962	98.33 1,185,341,395	3.5 2028/11/15	0.35
18	US T N/B 4.375 05/15/36 アメリカ	国債証券	1,205,400,000	99.50 1,199,445,324	97.74 1,178,184,334	4.375 2036/5/15	0.35
19	US T N/B 3.75 08/15/27 アメリカ	国債証券	1,157,184,000	100.39 1,161,794,659	99.59 1,152,506,083	3.75 2027/8/15	0.34
20	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,141,112,000	102.02 1,164,199,678	99.78 1,138,704,960	4.5 2033/11/15	0.34
21	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27 中国	国債証券	1,128,237,056	100.42 1,133,057,110	100.45 1,133,371,662	1.62 2027/8/15	0.34
22	FRANCE OAT 4.75 04/25/35 フランス	国債証券	1,049,260,160	110.69 1,161,435,291	107.16 1,124,398,937	4.75 2035/4/25	0.33
23	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27 中国	国債証券	1,117,772,800	100.18 1,119,792,168	100.28 1,120,991,873	1.42 2027/11/15	0.33
24	US T N/B 3.875 05/15/29 アメリカ	国債証券	1,125,040,000	99.53 1,119,808,564	98.93 1,113,042,505	3.875 2029/5/15	0.33
25	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証券	1,125,040,000	103.32 1,162,394,838	98.74 1,110,933,055	4.375 2034/5/15	0.33
26	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30 中国	国債証券	1,093,990,400	99.85 1,092,378,919	100.31 1,097,451,676	1.43 2030/1/25	0.33
27	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,250,401,600	90.26 1,128,731,590	87.55 1,094,736,364	1.875 2032/2/15	0.33
28	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証券	1,125,040,000	99.65 1,121,150,699	95.28 1,072,040,061	3.875 2034/8/15	0.32
29	CHINA GOVERNMENT BOND 1.56 06/15/33 中国	国債証券	1,070,208,000	99.97 1,069,955,430	100.04 1,070,650,959	1.56 2033/6/15	0.32
30	US T N/B 4.125 11/30/31 アメリカ	国債証券	1,079,074,080	101.32 1,093,344,555	98.66 1,064,679,403	4.125 2031/11/30	0.32

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.45
合計	98.45

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	3,094,054	41,579.52 128,649,281,870	53,588.86 165,806,856,341	－ －	5.74
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	4,865,143	29,531.69 143,675,941,804	31,346.82 152,506,804,708	－ －	5.28
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	1,486,643	64,562.91 95,982,005,972	72,500.79 107,782,794,921	－ －	3.73
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小売り	2,039,831	32,629.81 66,559,302,757	37,849.55 77,206,705,824	－ －	2.67
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	1,227,035	49,761.19 61,058,731,995	53,625.83 65,800,776,694	－ －	2.28
6	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	947,970	53,158.20 50,392,383,795	62,333.64 59,090,425,261	－ －	2.04
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	974,059	49,532.36 48,247,444,274	53,629.04 52,237,858,424	－ －	1.81
8	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラクティ	462,867	102,543.07 47,463,807,151	86,632.90 40,099,511,264	－ －	1.39

		ブ・メディアおよびサービス					
9	MICRON TECH INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	237,736	70,982.40 16,875,072,145	140,575.35 33,419,822,643	－ －	1.16
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	565,134	48,756.20 27,553,786,978	56,388.61 31,867,121,854	－ －	1.10
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	169,279	167,381.45 28,334,164,629	185,626.77 31,422,715,420	－ －	1.09
12	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	593,268	66,813.30 39,638,198,627	49,638.37 29,448,857,679	－ －	1.02
13	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	343,684	36,030.37 12,383,064,574	78,011.88 26,811,435,240	－ －	0.93
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	292,964	79,766.07 23,368,588,102	81,915.76 23,998,371,525	－ －	0.83
15	EXXONMOBIL HOLDINGS CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	875,468	23,850.72 20,880,546,297	25,228.21 22,086,497,906	－ －	0.76
16	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	81,790	223,221.31 18,257,271,479	266,572.80 21,802,989,312	－ －	0.75
17	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	507,621	39,024.37 19,809,592,407	41,115.39 20,871,035,590	－ －	0.72
18	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	354,201	50,606.47 17,924,864,287	58,866.91 20,850,719,947	－ －	0.72
19	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	924,304	21,363.63 19,746,490,414	17,855.99 16,504,364,829	－ －	0.57
20	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	172,504	83,231.18 14,357,711,794	92,791.69 16,006,938,036	－ －	0.55
21	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	372,974	37,080.71 13,830,140,964	41,370.93 15,430,283,185	－ －	0.53
22	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	832,673	12,679.41 10,557,806,695	18,251.36 15,197,417,349	－ －	0.53
23	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・	93,538	163,216.60 15,266,954,534	153,354.20 14,344,445,384	－ －	0.50

		小売り					
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,430,331	8,463.02 12,104,927,843	9,921.24 14,190,665,140	－ －	0.49
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	926,454	7,940.92 7,356,903,745	14,646.41 13,569,228,465	－ －	0.47
26	APPLIED MATERIALS INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	167,304	58,360.67 9,763,973,902	80,644.47 13,492,143,145	－ －	0.47
27	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	191,459	48,025.33 9,194,881,723	67,738.65 12,969,175,798	－ －	0.45
28	CATERPILLAR INC アメリカ	株式 機械	98,149	125,481.01 12,315,836,314	130,044.98 12,763,784,820	－ －	0.44
29	LAM RESEARCH CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	263,305	38,614.70 10,167,444,667	47,849.55 12,599,027,974	－ －	0.44
30	GE AEROSPACE アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	220,325	50,795.97 11,191,622,643	57,062.02 12,572,191,495	－ －	0.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年7月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	96.94
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.11
投資証券	1.42
合計	98.47

（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7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
半導体・半導体製造装置	外国	13.40
銀行		7.29
ソフトウェア		6.62
コンピュータ・周辺機器		6.53
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.52
医薬品		4.36
石油・ガス・消耗燃料		3.90
資本市場		3.26
大規模小売り		3.11

保険	2.82
航空宇宙・防衛	2.75
金融サービス	2.69
機械	1.84
生活必需品流通・小売り	1.65
電力	1.60
バイオテクノロジー	1.60
金属・鉱業	1.59
電気設備	1.56
ホテル・レストラン・レジャー	1.50
自動車	1.38
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	1.32
ヘルスケア機器・用品	1.31
専門小売り	1.27
化学	1.20
通信機器	1.05
飲料	1.05
各種電気通信サービス	0.98
情報技術サービス	0.97
娯楽	0.95
陸上運輸	0.86
電子装置・機器・部品	0.80
食品	0.77
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.72
総合公益事業	0.69
タバコ	0.66
家庭用品	0.66
繊維・アパレル・贅沢品	0.59
コングロマリット	0.57
専門サービス	0.54
建設関連製品	0.49
建設・土木	0.48
商業サービス・用品	0.45
商社・流通業	0.41
消費者金融	0.41
パーソナルケア用品	0.37
航空貨物・物流サービス	0.35
建設資材	0.27
エネルギー設備・サービス	0.23
不動産管理・開発	0.19
家庭用耐久財	0.19
無線通信サービス	0.18
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.16
容器・包装	0.15
メディア	0.14
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	0.08
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		96.94

（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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	106,372	122,045.31 12,982,204,694	134,700.00 14,328,308,400	－ －	7.26
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	92,518	112,525.90 10,410,671,625	122,100.00 11,296,447,800	－ －	5.72
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	91,365	109,568.36 10,010,714,099	117,900.00 10,771,933,500	－ －	5.46
4	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	60,942	133,605.52 8,142,187,753	145,000.00 8,836,590,000	－ －	4.48
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	56,069	149,134.40 8,361,817,035	152,700.00 8,561,736,300	－ －	4.34
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	90,577	83,257.53 7,541,217,328	90,600.00 8,206,276,200	－ －	4.16
7	ＫＤＸ不動産投資法人 日本	投資証券	51,307	154,948.32 7,949,933,598	156,100.00 8,009,022,700	－ －	4.06
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	70,117	94,063.59 6,595,457,233	103,100.00 7,229,062,700	－ －	3.66
9	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	54,783	118,334.59 6,482,724,172	123,500.00 6,765,700,500	－ －	3.43
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	38,615	158,307.23 6,113,033,698	162,900.00 6,290,383,500	－ －	3.19
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	74,994	75,135.26 5,634,694,336	81,400.00 6,104,511,600	－ －	3.09
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	92,271	60,017.79 5,537,902,193	61,200.00 5,646,985,200	－ －	2.86
13	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	36,231	149,725.40 5,424,701,120	147,900.00 5,358,564,900	－ －	2.72
14	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	48,851	92,715.95 4,529,266,907	98,100.00 4,792,283,100	－ －	2.43
15	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	32,117	140,309.68 4,506,326,088	141,300.00 4,538,132,100	－ －	2.30
16	三井不動産ロジスティクス	投資証	38,853	104,831.11	108,100.00	－	2.13

	パーク投資法人 日本	券		4,073,003,269	4,200,009,300	－	
17	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	51,937	78,843.82 4,094,911,540	75,800.00 3,936,824,600	－ －	1.99
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	27,166	132,314.56 3,594,457,589	142,900.00 3,882,021,400	－ －	1.97
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	30,377	121,157.44 3,680,399,693	122,800.00 3,730,295,600	－ －	1.89
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	34,883	91,658.72 3,197,331,217	98,900.00 3,449,928,700	－ －	1.75
21	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	22,061	144,048.33 3,177,850,359	152,600.00 3,366,508,600	－ －	1.71
22	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	26,657	102,158.12 2,723,229,120	102,100.00 2,721,679,700	－ －	1.38
23	三井不動産商業ファンド投資法人 日本	投資証券	32,642	80,946.61 2,642,259,435	82,000.00 2,676,644,000	－ －	1.36
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	20,366	126,215.63 2,570,507,657	130,100.00 2,649,616,600	－ －	1.34
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	21,366	121,178.61 2,589,102,227	121,900.00 2,604,515,400	－ －	1.32
26	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	33,915	72,196.69 2,448,550,789	76,300.00 2,587,714,500	－ －	1.31
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	25,762	98,727.09 2,543,407,407	97,100.00 2,501,490,200	－ －	1.27
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	15,548	152,342.80 2,368,625,966	157,500.00 2,448,810,000	－ －	1.24
29	ＮＴＴ都市開発リート投資法人 日本	投資証券	17,717	129,272.28 2,290,317,081	137,300.00 2,432,544,100	－ －	1.23
30	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	7,124	316,017.71 2,251,310,223	341,000.00 2,429,284,000	－ －	1.23

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.00
合計	97.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	348,068	33,247.22 11,572,294,000	37,870.45 13,181,493,043	－ －	9.34
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	459,745	22,597.23 10,388,964,075	23,495.65 10,802,010,735	－ －	7.65
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	48,639	175,449.81 8,533,703,526	168,359.02 8,188,814,451	－ －	5.80
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	159,960	33,984.08 5,436,094,371	37,036.31 5,924,329,235	－ －	4.20
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	171,571	30,128.37 5,169,156,181	31,049.49 5,327,193,215	－ －	3.77
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	460,046	9,688.20 4,457,020,553	10,355.18 4,763,863,554	－ －	3.37
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	82,873	51,129.88 4,237,286,660	51,020.56 4,228,227,200	－ －	3.00
8	VENTAS INC アメリカ	投資証券	239,918	13,131.69 3,150,531,169	14,773.38 3,544,400,358	－ －	2.51
9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	1,009,156	3,557.06 3,589,637,425	3,308.34 3,338,638,426	－ －	2.37
10	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	146,862	20,536.66 3,016,055,746	20,032.14 2,941,960,262	－ －	2.08
11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	104,310	23,364.53 2,437,155,077	23,820.31 2,484,696,661	－ －	1.76
12	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	539,650	4,224.98 2,280,013,632	4,228.54 2,281,933,337	－ －	1.62
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	68,611	28,526.26 1,957,215,358	30,180.00 2,070,680,089	－ －	1.47
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	168,434	10,309.97 1,736,550,665	10,787.52 1,816,986,221	－ －	1.29
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	31,763	44,032.31 1,398,598,472	45,300.53 1,438,881,026	－ －	1.02
16	SEGRO PLC イギリス	投資証券	669,476	1,604.28 1,074,030,437	2,091.04 1,399,904,963	－ －	0.99
17	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	333,434	3,921.40 1,307,529,244	4,099.96 1,367,068,463	－ －	0.97
18	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	110,145	11,453.90 1,261,590,177	11,906.13 1,311,401,525	－ －	0.93
19	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	270,243	4,569.84 1,234,969,288	4,768.56 1,288,670,608	－ －	0.91
20	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	315,028	4,016.99 1,265,466,113	4,032.46 1,270,339,321	－ －	0.90
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	57,561	21,299.95 1,226,046,669	21,427.19 1,233,370,506	－ －	0.87
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	340,999	3,149.17 1,073,867,089	3,545.48 1,209,006,225	－ －	0.86
23	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	投資証	147,323	7,167.75	8,100.28	－	0.85

	アメリカ	券		1,055,974,814	1,193,358,729	－	
24	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD フランス	投資証券	60,279	18,283.68 1,102,122,318	19,345.03 1,166,099,666	－ －	0.83
25	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,583,865	430.62 1,112,676,456	440.66 1,138,608,534	－ －	0.81
26	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,574	19,038.89 1,077,106,230	19,998.38 1,131,388,893	－ －	0.80
27	LAMAR ADVERTISING CO アメリカ	投資証券	42,843	24,067.56 1,031,126,504	25,819.66 1,106,192,036	－ －	0.78
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	80,466	12,356.15 994,250,255	12,915.45 1,039,255,339	－ －	0.74
29	LINK REIT 香港	投資証券	1,274,120	732.31 933,054,129	809.35 1,031,215,392	－ －	0.73
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	94,675	9,995.17 946,293,363	10,531.98 997,115,357	－ －	0.71

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	9.52
投資証券	88.93
合計	98.45

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2026年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	SOUTH AFRICA 7.1 11/19/36 南アフリカ	国債証券	2,973,320,000	107.18 3,186,888,821	104.67 3,112,403,227	7.1 2036/11/19	2.94
2	SOUTH AFRICA 6.125 12/11/37 南アフリカ	国債証券	2,394,728,000	97.78 2,341,650,983	95.84 2,295,194,984	6.125 2037/12/11	2.17
3	REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29 ポーランド	国債証券	1,703,632,000	101.42 1,727,857,161	100.21 1,707,333,804	4.625 2029/3/18	1.62
4	TURKEY 9.375 03/14/29 トルコ	国債証券	1,526,840,000	110.34 1,684,860,794	107.75 1,645,231,631	9.375 2029/3/14	1.56
5	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33 メキシコ	国債証券	1,719,704,000	96.55 1,660,374,212	93.95 1,615,661,908	4.875 2033/5/19	1.53
6	HUNGARY 6.75 09/23/55 ハンガリー	国債証券	1,446,480,000	108.40 1,568,080,959	103.64 1,499,146,683	6.75 2055/9/23	1.42
7	UNITED MEXICAN STATES	国債証	1,446,480,000	106.70	102.66	6.875	1.41

	6.875 05/13/37 メキシコ	券		1,543,394,160	1,484,956,368	2037/5/13	
8	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	1,446,480,000	104.74 1,515,067,843	101.47 1,467,832,301	5.5 2032/10/25	1.39
9	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.375 01/13/31 サウジアラビア	国債証券	1,446,480,000	103.65 1,499,393,352	101.10 1,462,517,398	5.375 2031/1/13	1.38
10	ROMANIA 5.875 01/30/29 ルーマニア	国債証券	1,446,480,000	102.41 1,481,431,614	100.85 1,458,789,284	5.875 2029/1/30	1.38
11	REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29 チリ	国債証券	1,446,480,000	101.52 1,468,537,060	100.10 1,447,926,480	4.85 2029/1/22	1.37
12	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30 サウジアラビア	国債証券	1,446,480,000	101.12 1,462,784,092	99.32 1,436,698,164	4.75 2030/1/16	1.36
13	PANAMA 6.4 02/14/35 パナマ	国債証券	1,382,192,000	106.91 1,477,706,629	103.60 1,432,089,131	6.4 2035/2/14	1.35
14	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	1,607,200,000	89.53 1,439,006,520	88.15 1,416,746,800	2.659 2031/5/24	1.34
15	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証券	1,366,120,000	106.62 1,456,648,034	103.50 1,413,934,977	5.75 2032/11/16	1.34
16	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,446,480,000	96.38 1,394,189,748	95.12 1,375,964,100	3.875 2030/6/12	1.30
17	REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33 チリ	国債証券	1,607,200,000	86.67 1,392,960,240	84.50 1,358,084,000	2.55 2033/7/27	1.28
18	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,285,760,000	107.11 1,377,286,168	105.11 1,351,539,558	7.125 2033/1/17	1.28
19	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,575,056,000	86.92 1,369,129,425	85.15 1,341,160,184	3 2034/1/15	1.27
20	REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53 ポーランド	国債証券	1,446,480,000	95.27 1,378,137,841	90.28 1,305,903,927	5.5 2053/4/4	1.24
21	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54 ポーランド	国債証券	1,446,480,000	95.21 1,377,205,671	89.96 1,301,322,057	5.5 2054/3/18	1.23
22	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,285,760,000	104.37 1,342,037,715	100.75 1,295,403,200	6.35 2035/2/9	1.23
23	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,253,616,000	100.65 1,261,764,504	99.46 1,246,971,835	6 2033/2/22	1.18
24	UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/13/30 メキシコ	国債証券	1,205,400,000	104.07 1,254,520,050	102.37 1,234,028,250	6 2030/5/13	1.17
25	COLOMBIA 8.0 04/20/33 コロンビア	国債証券	1,125,040,000	110.05 1,238,106,520	108.40 1,219,543,360	8 2033/4/20	1.15
26	COLOMBIA 7.5 02/02/34	国債証	1,125,040,000	107.47	105.70	7.5	1.13

	コロンビア	券		1,209,136,740	1,189,167,280	2034/2/2	
27	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53 サウジアラビア	国債証券	1,446,480,000	87.61 1,267,333,326	81.87 1,184,294,101	5 2053/1/18	1.12
28	REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34 チリ	国債証券	1,317,904,000	92.02 1,212,801,156	89.30 1,176,888,272	3.5 2034/1/31	1.11
29	BRAZIL 6.25 03/18/31 ブラジル	国債証券	1,125,040,000	104.69 1,177,860,628	103.10 1,159,916,240	6.25 2031/3/18	1.10
30	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34 ウルグアイ	国債証券	1,125,040,000	105.80 1,190,294,926	102.80 1,156,541,120	5.75 2034/10/28	1.09

（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7月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.41
合計	97.41

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,619,396	10,123.28 26,516,901,654	10,900.41 28,552,509,997	－ －	14.14
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	497,330	24,742.32 12,305,101,571	23,201.59 11,538,849,241	－ －	5.72
3	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	58,729	135,169.77 7,938,385,883	148,176.36 8,702,250,033	－ －	4.31
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	10,439.34 6,838,812,776	9,667.18 6,332,970,928	－ －	3.14
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	1,781,168	2,780.82	2,290.78	－	2.02

	ケイマン諸島	大規模小売り		4,953,120,205	4,080,267,593	－	
6	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	153,521	9,754.01 1,497,445,412	15,992.22 2,455,141,990	－ －	1.22
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,943,530	177.93 1,591,372,879	191.78 1,715,247,421	－ －	0.85
8	DELTA ELECTRONICS INC 台湾	株式 電子装置・機器・部品	207,178	9,253.13 1,917,045,678	7,563.55 1,567,002,197	－ －	0.78
9	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	1,208,896	1,348.73 1,630,478,824	1,274.17 1,540,345,665	－ －	0.76
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,299,889	1,027.08 1,335,095,637	1,134.53 1,474,767,291	－ －	0.73
11	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	85,260	16,700.67 1,423,899,443	16,924.83 1,443,011,432	－ －	0.71
12	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	646,308	2,304.38 1,489,341,193	2,185.00 1,412,183,626	－ －	0.70
13	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	563,486	2,271.98 1,280,232,211	2,423.29 1,365,490,552	－ －	0.68
14	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	1,827,800	650.99 1,189,894,430	636.00 1,162,498,346	－ －	0.58
15	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,956,235	143.75 999,985,945	156.54 1,088,954,069	－ －	0.54
16	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・レストラン・レジャー	538,110	1,756.85 945,383,436	1,898.39 1,021,547,216	－ －	0.51
17	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信サービス	291,286	3,119.00 908,523,555	3,306.99 963,280,471	－ －	0.48
18	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	379,089	2,838.44 1,076,024,466	2,414.33 915,248,106	－ －	0.45
19	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS ケイマン諸島	株式 銀行	388,046	2,419.77 938,982,914	2,328.83 903,694,252	－ －	0.45

20	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	355,086	2,234.61 793,479,810	2,496.46 886,460,658	－ －	0.44
21	SK SQUARE CO LTD 韓国	株式 コングロマリット	9,825	79,804.19 784,076,185	89,555.91 879,886,864	－ －	0.44
22	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小売り	60,344	16,772.50 1,012,119,830	14,053.35 848,035,762	－ －	0.42
23	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	697,500	1,239.86 864,803,316	1,202.76 838,927,192	－ －	0.42
24	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	312,490	3,082.65 963,300,330	2,682.76 838,338,641	－ －	0.42
25	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,189,200	104.70 752,737,277	113.51 816,079,162	－ －	0.40
26	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	187,000	3,751.74 701,577,001	4,233.23 791,614,758	－ －	0.39
27	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	583,423	1,469.37 857,267,970	1,356.14 791,203,383	－ －	0.39
28	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	393,500	2,254.47 887,137,185	1,942.45 764,354,862	－ －	0.38
29	SAUDI ARABIAN OIL CO サウジアラビア	株式 石油・ガス・消耗燃料	637,116	1,165.53 742,578,943	1,135.72 723,589,970	－ －	0.36
30	KB FINANCIAL GROUP INC 韓国	株式 銀行	37,811	18,218.17 688,847,457	18,763.02 709,448,889	－ －	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7月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	94.44
投資信託受益証券	0.54
投資証券	0.08
合計	95.07

（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7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
半導体・半導体製造装置	外国	21.94
銀行		15.11
コンピュータ・周辺機器		8.38
金属・鉱業		4.03
電子装置・機器・部品		3.93
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.81
石油・ガス・消耗燃料		3.43

大規模小売り	3.31
保険	2.60
自動車	2.14
電気設備	1.50
無線通信サービス	1.37
ホテル・レストラン・レジャー	1.20
化学	1.18
コングロマリット	1.09
情報技術サービス	0.96
不動産管理・開発	0.96
金融サービス	0.93
資本市場	0.87
機械	0.87
電力	0.87
医薬品	0.83
食品	0.82
各種電気通信サービス	0.82
バイオテクノロジー	0.80
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.70
生活必需品流通・小売り	0.69
航空宇宙・防衛	0.65
娯楽	0.65
飲料	0.62
運送インフラ	0.55
消費者金融	0.52
専門小売り	0.50
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.49
自動車用部品	0.46
繊維・アパレル・贅沢品	0.45
通信機器	0.45
建設・土木	0.45
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.44
建設資材	0.36
パーソナルケア用品	0.31
旅客航空輸送	0.30
家庭用耐久財	0.28
海上運輸	0.22
航空貨物・物流サービス	0.21
タバコ	0.19
ソフトウェア	0.18
ガス	0.18
陸上運輸	0.16
水道	0.13
各種消費者サービス	0.10
商社・流通業	0.08
総合公益事業	0.08
エネルギー設備・サービス	0.07
専門サービス	0.05
紙製品・林産品	0.05
ヘルスケア機器・用品	0.05

建設関連製品		0.04
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		94.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

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。

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。

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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・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。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

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7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ	買建	402	16,190,200,260	16,025,730,000	1.78

取引		先物　０８０９月					

（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。

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。

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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep26	買建	567	34,143,439,169	34,047,788,670	1.18
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep26	買建	491	5,727,535,049	5,774,490,737	0.20
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep26	買建	37	1,764,941,011	1,782,396,079	0.06
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep26	買建	71	1,633,211,457	1,671,182,781	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep26	買建	30	746,815,879	755,140,417	0.03

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０８０９月	買建	2,857	4,968,351,570	5,256,880,000	2.66

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	シカゴ商品取引所	DJ US REAL ESTATE Sep26	買建	295	1,876,774,048	1,891,280,636	1.34

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

2026年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Sep26	買建	749	10,441,186,854	9,810,309,423	4.86

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2026年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第10計算期間末（2017年1月11日）	38,014	38,115	1.1200	1.1230
第11計算期間末（2017年7月11日）	59,334	59,493	1.1175	1.1205
第12計算期間末（2018年1月11日）	86,417	86,642	1.1513	1.1543
第13計算期間末（2018年7月11日）	103,558	103,832	1.1324	1.1354
第14計算期間末（2019年1月11日）	113,879	114,185	1.1159	1.1189
第15計算期間末（2019年7月11日）	128,732	129,059	1.1819	1.1849
第16計算期間末（2020年1月14日）	177,243	177,685	1.2017	1.2047
第17計算期間末（2020年7月13日）	227,606	229,097	1.2217	1.2297
第18計算期間末（2021年1月12日）	397,433	400,009	1.2341	1.2421
第19計算期間末（2021年7月12日）	570,151	573,835	1.2382	1.2462
第20計算期間末（2022年1月11日）	642,046	646,294	1.2091	1.2171
第21計算期間末（2022年7月11日）	575,829	580,041	1.0938	1.1018
第22計算期間末（2023年1月11日）	520,634	524,602	1.0496	1.0576
第23計算期間末（2023年7月11日）	477,985	481,658	1.0411	1.0491
第24計算期間末（2024年1月11日）	418,036	421,273	1.0333	1.0413
第25計算期間末（2024年7月11日）	371,417	374,233	1.0550	1.0630

第26計算期間末 (2025年1月14日)	312,581	315,031	1.0209	1.0289
第27計算期間末 (2025年7月11日)	269,348	271,491	1.0052	1.0132
第28計算期間末 (2026年1月13日)	235,122	236,898	1.0591	1.0671
第29計算期間末 (2026年7月13日)	204,200	205,751	1.0531	1.0611
2025年7月末日	268,778	－	1.0165	－
8月末日	263,906	－	1.0259	－
9月末日	259,520	－	1.0386	－
10月末日	255,865	－	1.0608	－
11月末日	246,745	－	1.0613	－
12月末日	237,183	－	1.0577	－
2026年1月末日	230,091	－	1.0523	－
2月末日	230,761	－	1.0771	－
3月末日	216,476	－	1.0314	－
4月末日	215,587	－	1.0455	－
5月末日	214,131	－	1.0593	－
6月末日	209,207	－	1.0655	－
7月末日	200,957	－	1.0453	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第10計算期間	0.0030
第11計算期間	0.0030
第12計算期間	0.0030
第13計算期間	0.0030
第14計算期間	0.0030
第15計算期間	0.0030
第16計算期間	0.0030
第17計算期間	0.0080
第18計算期間	0.0080
第19計算期間	0.0080
第20計算期間	0.0080
第21計算期間	0.0080
第22計算期間	0.0080
第23計算期間	0.0080
第24計算期間	0.0080
第25計算期間	0.0080
第26計算期間	0.0080
第27計算期間	0.0080
第28計算期間	0.0080
第29計算期間	0.0080

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第10計算期間	0.1
第11計算期間	0.0

第12計算期間	3.3
第13計算期間	△1.4
第14計算期間	△1.2
第15計算期間	6.2
第16計算期間	1.9
第17計算期間	2.3
第18計算期間	1.7
第19計算期間	1.0
第20計算期間	△1.7
第21計算期間	△8.9
第22計算期間	△3.3
第23計算期間	△0.0
第24計算期間	0.0
第25計算期間	2.9
第26計算期間	△2.5
第27計算期間	△0.8
第28計算期間	6.2
第29計算期間	0.2

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

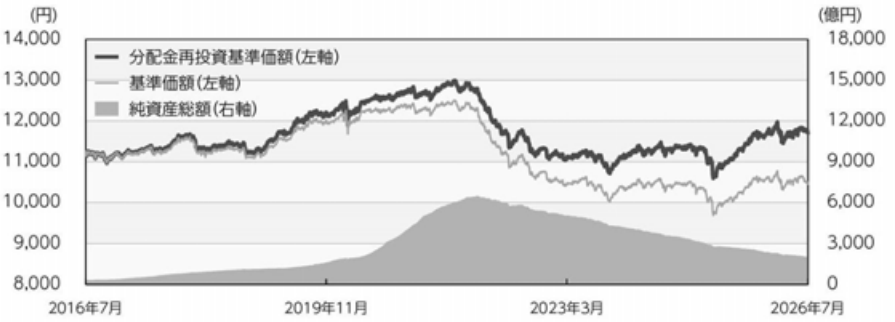
	設定口数	解約口数
第10計算期間	8,018,264,356	2,525,414,015
第11計算期間	23,156,860,002	4,001,221,708
第12計算期間	31,107,752,180	9,142,866,802
第13計算期間	22,536,763,057	6,150,567,476
第14計算期間	17,417,751,561	6,817,081,474
第15計算期間	23,826,278,649	16,952,417,502
第16計算期間	54,251,614,296	15,683,190,372
第17計算期間	56,117,429,412	17,311,597,198
第18計算期間	156,506,231,236	20,752,801,348
第19計算期間	164,685,957,575	26,269,603,361
第20計算期間	111,351,298,896	40,826,174,048
第21計算期間	37,500,036,301	42,046,118,341
第22計算期間	13,968,203,556	44,394,579,761
第23計算期間	9,449,358,598	46,356,965,903
第24計算期間	7,517,347,833	62,070,936,679
第25計算期間	5,717,390,979	58,227,780,662
第26計算期間	4,301,389,373	50,167,744,506
第27計算期間	3,694,045,845	41,918,257,130
第28計算期間	3,068,254,668	49,012,973,196
第29計算期間	2,936,789,800	31,053,719,566

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2026年7月31日

基準価額・純資産の推移 《2016年7月29日～2026年7月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2012年10月26日)

分配の推移(税引前)

2024年 7月	80円
2025年 1月	80円
2025年 7月	80円
2026年 1月	80円
2026年 7月	80円
設定来累計	1,370円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	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	39.47
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.89
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.60
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.93
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.04
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.51
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.47
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.83
9	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.04

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.24
2	369回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2032/12/20	1.19
3	370回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2033/3/20	1.18
4	382回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	2.4	2036/3/20	1.06
5	348回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/9/20	0.97

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	3.91
2	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	2.65
3	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.58
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.36
5	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.23

○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7月31日

■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

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	国債証券	中国	1.62	2027/8/15	0.57
2	US T N/B 4.875 10/31/28	国債証券	アメリカ	4.875	2028/10/31	0.57
3	US T N/B 4.125 02/15/36	国債証券	アメリカ	4.125	2036/2/15	0.51
4	US T N/B 4.25 11/15/34	国債証券	アメリカ	4.25	2034/11/15	0.49
5	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28	国債証券	中国	1.42	2028/8/15	0.48

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	国債証券	中国	1.45	2028/2/25	0.56
2	US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	アメリカ	3.375	2033/5/15	0.52
3	FRANCE OAT 3.5 11/25/33	国債証券	フランス	3.5	2033/11/25	0.50
4	US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	アメリカ	3.5	2030/4/30	0.47
5	US T N/B 4.25 02/15/54	国債証券	アメリカ	4.25	2054/2/15	0.46

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.74
2	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	5.28
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.73
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.67
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	2.28

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	7.26
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.72
3	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	5.46
4	GLP投資法人	投資証券	日本	4.48
5	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.34

○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7月31日

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	9.34
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	7.65
3	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.80
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	4.20
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.77

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	SOUTH AFRICA 7.1 11/19/36	国債証券	南アフリカ	7.1	2036/11/19	2.94
2	SOUTH AFRICA 6.125 12/11/37	国債証券	南アフリカ	6.125	2037/12/11	2.17
3	REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	国債証券	ポーランド	4.625	2029/3/18	1.62
4	TURKEY 9.375 03/14/29	国債証券	トルコ	9.375	2029/3/14	1.56
5	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	国債証券	メキシコ	4.875	2033/5/19	1.53

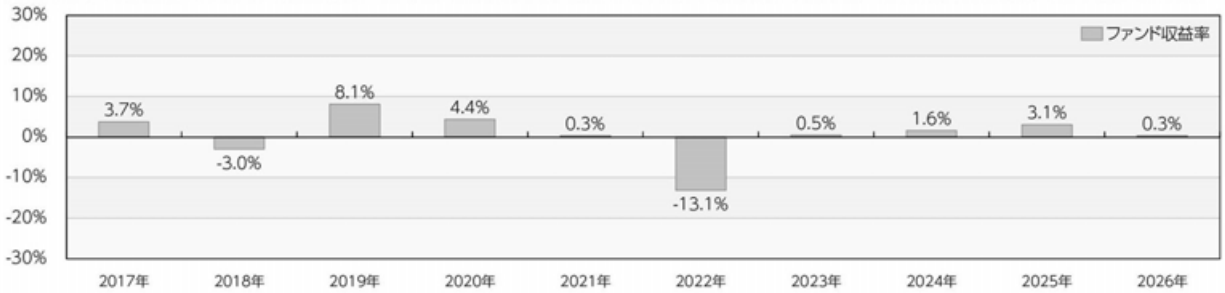
■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	14.14
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	5.72
3	SK HYNIX INC	株式	韓国	半導体・半導体製造装置	4.31
4	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.14
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.02

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。
※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。

当ファンドでは、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「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」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。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時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、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、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、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

※受益権の取得申込者は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。

「分配金自動けいぞく投資コース」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1万口当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。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　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。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合には、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「分配金自動けいぞく投資コース」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。

※「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、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、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の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とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

・解約単位

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5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
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
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
不動産投資信託証券	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・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、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11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、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、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も同様とします。

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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申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、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出ます。なお、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、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。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、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、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も、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、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、当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1月11日、7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL　https://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

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

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

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

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

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期計算期間（2026年1月14日から2026年7月13日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

２０２６年9月１１日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　稲 葉　　宏 和

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエの２０２６年1月１４日から２０２６年7月１３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、投資のソムリエの２０２６年7月１３日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

１【財務諸表】

【投資のソムリエ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 2026年1月13日現在	第29期 2026年7月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,197,912,998	11,424,267,785
親投資信託受益証券	225,965,921,481	195,600,994,636
派生商品評価勘定	90,863,358	109,883,808
未収入金	1,430,000,000	2,230,000,000
差入委託証拠金	374,918,608	291,495,182
流動資産合計	242,059,616,445	209,656,641,411
資産合計	242,059,616,445	209,656,641,411
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,592,733,308	1,368,150,899
未払収益分配金	1,776,092,776	1,551,157,338
未払解約金	558,865,619	856,236,177
未払受託者報酬	71,672,213	59,961,221
未払委託者報酬	1,935,151,017	1,618,885,974
その他未払費用	2,194,986	2,135,981
流動負債合計	6,936,709,919	5,456,527,590
負債合計	6,936,709,919	5,456,527,590
純資産の部		
元本等		
元本	222,011,597,082	193,894,667,316
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,111,309,444	10,305,446,505
（分配準備積立金）	690,924,687	－
元本等合計	235,122,906,526	204,200,113,821
純資産合計	235,122,906,526	204,200,113,821
負債純資産合計	242,059,616,445	209,656,641,411

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期 自　2025年7月12日 至　2026年1月13日	第29期 自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
営業収益		
受取利息	36,722,001	55,926,623
有価証券売買等損益	22,392,776,737	3,604,983,155
派生商品取引等損益	－	△195,835,611
為替差損益	△4,985,517,538	△1,478,190,848
その他収益	6,660,348	5,368,524
営業収益合計	17,450,641,548	1,992,251,843
営業費用		
受託者報酬	71,672,213	59,961,221
委託者報酬	1,935,151,017	1,618,885,974
その他費用	3,292,046	3,019,756
営業費用合計	2,010,115,276	1,681,866,951
営業利益又は営業損失（△）	15,440,526,272	310,384,892
経常利益又は経常損失（△）	15,440,526,272	310,384,892
当期純利益又は当期純損失（△）	15,440,526,272	310,384,892
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（△）	1,751,627,400	△97,980,972
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,391,835,669	13,111,309,444
剰余金増加額又は欠損金減少額	64,798,002	170,725,959
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	64,798,002	170,725,959
剰余金減少額又は欠損金増加額	258,130,323	1,833,797,424
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	258,130,323	1,833,797,424
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	1,776,092,776	1,551,157,338
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,111,309,444	10,305,446,505

（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29期 自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　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。 計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11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2026年1月13日、当計算期間末日を2026年7月13日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第28期 2026年1月13日現在	第29期 2026年7月13日現在
１．　期首元本額	267,956,315,610円	222,011,597,082円
期中追加設定元本額	3,068,254,668円	2,936,789,800円
期中一部解約元本額	49,012,973,196円	31,053,719,566円
２．　受益権の総数	222,011,597,082口	193,894,667,316口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第28期 自　2025年7月12日 至　2026年1月13日	第29期 自　2026年1月14日 至　2026年7月13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（2,467,017,463円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（38,969,167,992円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は41,436,185,455円（1万口当たり1,866.39円）であり、うち1,776,092,776円（1万口当たり80円）を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（860,613,951円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（34,044,852,456円）及び分配準備積立金（595,218,919円）より分配対象収益は35,500,685,326円（1万口当たり1,830.92円）であり、うち1,551,157,338円（1万口当たり80円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第28期 自　2025年7月12日	第29期 自　2026年1月14日

	至　2026年1月13日	至　2026年7月13日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。	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。	同左

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	第28期 2026年1月13日現在	第29期 2026年7月13日現在
1．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

２．　時価の算定方法	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 「（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。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第28期 2026年1月13日現在	第29期 2026年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	15,575,837,949	4,627,141,480
合計	15,575,837,949	4,627,141,480

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第28期 2026年1月13日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	53,818,569,092	－	56,411,302,400	△2,592,733,308
アメリカ・ドル	22,186,311,258	－	23,000,895,200	△814,583,942
イギリス・ポンド	13,416,266,660	－	14,267,473,000	△851,206,340
オーストラリア・ドル	4,965,907,400	－	5,348,455,000	△382,547,600
カナダ・ドル	1,241,451,450	－	1,309,620,000	△68,168,550
ユーロ	12,008,632,324	－	12,484,859,200	△476,226,876
買建	3,669,697,242	－	3,760,560,600	90,863,358

アメリカ・ドル	1,193,419,889	－	1,220,257,800	26,837,911
イギリス・ポンド	1,171,190,873	－	1,209,864,700	38,673,827
オーストラリア・ドル	595,395,676	－	608,982,500	13,586,824
カナダ・ドル	122,265,528	－	124,129,200	1,863,672
ユーロ	587,425,276	－	597,326,400	9,901,124
合計	57,488,266,334	－	60,171,863,000	△2,501,869,950

種類	第29期 2026年7月13日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	55,484,848,305	－	56,822,258,458	△1,337,410,153
アメリカ・ドル	21,565,484,931	－	22,471,533,624	△906,048,693
イギリス・ポンド	13,084,730,400	－	13,426,215,550	△341,485,150
オーストラリア・ドル	4,355,195,640	－	4,355,393,826	△198,186
カナダ・ドル	4,209,698,412	－	4,203,067,602	6,630,810
ユーロ	12,269,738,922	－	12,366,047,856	△96,308,934
買建	13,391,972,655	－	13,471,115,717	79,143,062
アメリカ・ドル	7,843,811,399	－	7,898,253,396	54,441,997
イギリス・ポンド	3,196,882,067	－	3,229,993,525	33,111,458
オーストラリア・ドル	176,187,452	－	174,843,396	△1,344,056
ユーロ	2,175,091,737	－	2,168,025,400	△7,066,337
合計	68,876,820,960	－	70,293,374,175	△1,258,267,091

（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）

	第28期 2026年1月13日現在	第29期 2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	1.0591円	1.0531円
（1万口当たり純資産額）	（10,591円）	（10,531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7月13日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,638,147,245	12,156,526,890	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	27,060,017,102	29,674,014,754	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	3,438,684,574	9,151,027,388	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,209,293,486	30,799,981,417	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,497,551,610	4,139,232,650	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,398,201,262	9,275,730,164	
	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	69,854,351,680	79,717,786,137	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2,000,918,741	6,192,443,319	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5,024,178,279	14,494,251,917	
親投資信託受益証券　合計		116,121,343,979	195,600,994,636	
合計			195,600,994,636	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（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。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2026年7月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,647,503,464
国債証券	389,958,733,100
地方債証券	22,346,600,138
特殊債券	16,502,015,666
社債券	13,722,466,000
未収入金	1,085,969,000
未収利息	994,137,555
前払費用	134,655,521
流動資産合計	446,392,080,444
資産合計	446,392,080,444
負債の部	
流動負債	
未払解約金	739,581,000
流動負債合計	739,581,000
負債合計	739,581,000
純資産の部	
元本等	
元本	406,384,592,596
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	39,267,906,848
元本等合計	445,652,499,444
純資産合計	445,652,499,444
負債純資産合計	446,392,080,444

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年7月13日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	410,860,464,115円
同期中追加設定元本額	107,499,740,149円
同期中一部解約元本額	111,975,611,668円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	40,600,887,649円
たわらノーロード　国内債券	20,652,138,427円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	14,913,098,112円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	2,333,416,877円
たわらノーロード　バランス（標準型）	6,162,688,076円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,122,671,942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）	222,213,036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）	3,395,241,801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）	4,939,241,448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）	1,559,212,084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）	78,876,180円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	39,381,772円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	331,214,697円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	39,937,470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
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	11,680,208,250円
Ｏｎｅグローバルバランス	533,237,379円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～１９７２年生まれ向け）	17,339,714円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７３～１９７７年生まれ向け）	6,058,787円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７８～１９８２年生まれ向け）	2,831,706円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８３～１９８７年生まれ向け）	1,598,880円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	510,194円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	143,513円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９８～２００２年生まれ向け）	123,872円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／２００３～２００７年生まれ向	174,266円

け）	
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	14,892,030,531円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	23,409,478,382円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	12,187,714,851円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	3,079,876,908円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	3,419,519,477円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	803,190,960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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	6,871,213,155円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	3,677,068,301円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	864,736,278円
投資のソムリエ	27,060,017,102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＞	6,099,794,711円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	9,920,527,160円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	5,705,544,514円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	12,251,830,633円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	19,856,588,705円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	462,549,487円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	244,223,270円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	137,114,044円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	3,386,271,341円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	11,149,548,164円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,696,751,391円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	8,262,533,028円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	651,190,396円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	288,611,466円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	161,625,991円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	7,795,213,332円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	72,708,042円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	139,800,638円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	2,841,609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）	442,192,619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）	771,414,725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）	1,028,750,372円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	2,003,108,239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）	1,046,356,319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）	863,414,752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）	882,157,580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）	1,402,819,071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	454,215,117円

限定）	
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）	6,958,154,431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）	129,889,084円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	246,054,834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）	1,239,524,004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）	19,234,044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）	91,464,291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）	110,459,650円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,042,241円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	63,882,003円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,000,117円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	539,995円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,818,743,705円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,207,241,148円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,840,585,058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）	40,485,976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）	897,333,907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）	69,216,944円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	729,749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）	1,009,575,247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）	30,500,703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）	149,902,795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）	224,962,438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）	369,131,241円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	179,247,643円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,617,747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＞	319,640,173円
コア資産形成ファンド	102,895,809円
たわらノーロード　国内債券＜ラップ専用＞	12,437,037,933円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	29,610,478,702円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	30,587,392,934円
計	406,384,592,596円
２．　受益権の総数	406,384,592,596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　2026年1月14日 至　2026年7月13日

1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
1．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△11,048,355,300
地方債証券	△316,839,622
特殊債券	△648,168,253
社債券	△208,789,000
合計	△12,222,152,175

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0966円 （10,966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7月13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）	1,000,000,000	996,190,000	
	４７７回　利付国庫債券（２年）	2,000,000,000	1,993,760,000	
	４７８回　利付国庫債券（２年）	2,400,000,000	2,391,384,000	
	４８１回　利付国庫債券（２年）	2,680,000,000	2,677,748,800	
	４８２回　利付国庫債券（２年）	1,700,000,000	1,697,960,000	
	４８３回　利付国庫債券（２年）	4,100,000,000	4,100,328,000	
	４８４回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,499,595,000	
	４８５回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,499,175,000	
	１５４回　利付国庫債券（５年）	3,570,000,000	3,522,590,400	
	１５５回　利付国庫債券（５年）	1,500,000,000	1,478,430,000	
	１５６回　利付国庫債券（５年）	3,100,000,000	3,051,082,000	
	１５７回　利付国庫債券（５年）	1,700,000,000	1,666,867,000	
	１５８回　利付国庫債券（５年）	3,600,000,000	3,523,932,000	
	１５９回　利付国庫債券（５年）	1,900,000,000	1,851,550,000	
	１６０回　利付国庫債券（５年）	600,000,000	585,828,000	
	１６１回　利付国庫債券（５年）	870,000,000	851,094,900	
	１６２回　利付国庫債券（５	2,100,000,000	2,046,639,000	

年)			
１６３回　利付国庫債券（５年)	3,150,000,000	3,076,636,500	
１６４回　利付国庫債券（５年)	1,100,000,000	1,065,262,000	
１６５回　利付国庫債券（５年)	1,200,000,000	1,164,924,000	
１６６回　利付国庫債券（５年)	1,350,000,000	1,313,712,000	
１６７回　利付国庫債券（５年)	1,800,000,000	1,745,334,000	
１６８回　利付国庫債券（５年)	1,260,000,000	1,228,374,000	
１６９回　利付国庫債券（５年)	1,240,000,000	1,205,689,200	
１７０回　利付国庫債券（５年)	1,400,000,000	1,360,940,000	
１７１回　利付国庫債券（５年)	1,700,000,000	1,643,050,000	
１７２回　利付国庫債券（５年)	2,850,000,000	2,762,505,000	
１７３回　利付国庫債券（５年)	1,100,000,000	1,064,712,000	
１７４回　利付国庫債券（５年)	2,200,000,000	2,136,068,000	
１７５回　利付国庫債券（５年)	1,600,000,000	1,557,184,000	
１７６回　利付国庫債券（５年)	1,000,000,000	976,640,000	
１７７回　利付国庫債券（５年)	1,400,000,000	1,371,832,000	
１７８回　利付国庫債券（５年)	3,600,000,000	3,502,332,000	
１７９回　利付国庫債券（５年)	2,790,000,000	2,704,012,200	
１８０回　利付国庫債券（５年)	1,020,000,000	992,490,600	
１８１回　利付国庫債券（５年)	2,240,000,000	2,189,577,600	
１８２回　利付国庫債券（５年)	2,040,000,000	2,002,382,400	
１８３回　利付国庫債券（５年)	3,900,000,000	3,848,949,000	
１８４回　利付国庫債券（５年)	1,300,000,000	1,291,069,000	
１８５回　利付国庫債券（５年)	3,800,000,000	3,807,334,000	
１回　利付国庫債券（４０年)	110,000,000	87,579,800	
２回　利付国庫債券（４０年)	330,000,000	248,853,000	

３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	400,825,800	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	524,505,600	
５回　利付国庫債券（４０年）	710,000,000	485,235,300	
６回　利付国庫債券（４０年）	940,000,000	619,272,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,030,000,000	637,920,200	
８回　利付国庫債券（４０年）	890,000,000	499,788,400	
９回　利付国庫債券（４０年）	1,800,000,000	695,880,000	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,430,000,000	666,451,500	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,180,000,000	520,958,200	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,420,000,000	539,486,400	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,820,000,000	684,083,400	
１４回　利付国庫債券（４０年）	1,720,000,000	694,587,600	
１５回　利付国庫債券（４０年）	1,870,000,000	839,256,000	
１６回　利付国庫債券（４０年）	2,270,000,000	1,129,529,300	
１７回　利付国庫債券（４０年）	1,900,000,000	1,261,790,000	
１８回　利付国庫債券（４０年）	1,400,000,000	1,175,622,000	
１回　ＣＴ利付国庫債券（１０年）	500,000,000	442,180,000	
２回　ＣＴ利付国庫債券（１０年）	500,000,000	449,345,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,370,000,000	4,311,966,400	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	3,050,000,000	2,997,570,500	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	5,660,000,000	5,540,404,200	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	4,400,000,000	4,287,800,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	3,370,000,000	3,270,450,200	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	3,690,000,000	3,565,241,100	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	4,460,000,000	4,290,698,400	
３５５回　利付国庫債券（１	3,340,000,000	3,199,553,000	

０年)			
３５６回　利付国庫債券（１０年)	3,400,000,000	3,238,976,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年)	3,300,000,000	3,125,034,000	
３５８回　利付国庫債券（１０年)	3,150,000,000	2,964,559,500	
３５９回　利付国庫債券（１０年)	3,850,000,000	3,601,559,500	
３６０回　利付国庫債券（１０年)	3,800,000,000	3,532,670,000	
３６１回　利付国庫債券（１０年)	3,900,000,000	3,602,469,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年)	3,770,000,000	3,459,615,900	
３６３回　利付国庫債券（１０年)	3,770,000,000	3,435,940,300	
３６４回　利付国庫債券（１０年)	3,910,000,000	3,540,935,100	
３６５回　利付国庫債券（１０年)	4,090,000,000	3,678,341,500	
３６６回　利付国庫債券（１０年)	4,380,000,000	3,934,554,000	
３６７回　利付国庫債券（１０年)	4,150,000,000	3,701,675,500	
３６８回　利付国庫債券（１０年)	4,750,000,000	4,206,362,500	
３６９回　利付国庫債券（１０年)	6,220,000,000	5,579,837,600	
３７０回　利付国庫債券（１０年)	5,430,000,000	4,841,442,300	
３７１回　利付国庫債券（１０年)	4,950,000,000	4,348,525,500	
３７２回　利付国庫債券（１０年)	4,500,000,000	4,040,100,000	
３７３回　利付国庫債券（１０年)	4,060,000,000	3,565,126,600	
３７４回　利付国庫債券（１０年)	4,590,000,000	4,063,527,000	
３７５回　利付国庫債券（１０年)	3,890,000,000	3,502,750,500	
３７６回　利付国庫債券（１０年)	4,020,000,000	3,538,404,000	
３７７回　利付国庫債券（１０年)	4,100,000,000	3,677,413,000	
３７８回　利付国庫債券（１０年)	4,370,000,000	3,963,458,900	
３７９回　利付国庫債券（１０年)	4,120,000,000	3,747,922,800	
３８０回　利付国庫債券（１０年)	3,900,000,000	3,591,783,000	

３８１回　利付国庫債券（１０年）	4,200,000,000	3,987,984,000	
３８２回　利付国庫債券（１０年）	4,900,000,000	4,757,949,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	113,949,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	102,291,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	208,418,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	203,524,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	240,310,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	226,186,600	
１３回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	632,391,500	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	338,898,400	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	260,171,600	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	239,510,400	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	266,630,400	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	390,668,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	272,426,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	325,261,200	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	299,546,800	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	284,020,200	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	341,705,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	314,011,500	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	593,265,600	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	594,034,400	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	732,254,600	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	802,491,800	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	804,196,800	
３１回　利付国庫債券（３０	720,000,000	644,263,200	

年)			
３２回　利付国庫債券（３０年)	970,000,000	871,166,700	
３３回　利付国庫債券（３０年)	1,180,000,000	1,009,808,600	
３４回　利付国庫債券（３０年)	1,200,000,000	1,044,144,000	
３５回　利付国庫債券（３０年)	1,060,000,000	888,237,600	
３６回　利付国庫債券（３０年)	1,370,000,000	1,138,305,600	
３７回　利付国庫債券（３０年)	1,360,000,000	1,100,471,200	
３８回　利付国庫債券（３０年)	850,000,000	670,267,500	
３９回　利付国庫債券（３０年)	1,110,000,000	884,481,300	
４０回　利付国庫債券（３０年)	530,000,000	413,347,000	
４１回　利付国庫債券（３０年)	1,060,000,000	808,324,200	
４２回　利付国庫債券（３０年)	1,000,000,000	757,860,000	
４３回　利付国庫債券（３０年)	810,000,000	611,298,900	
４４回　利付国庫債券（３０年)	1,130,000,000	847,014,100	
４５回　利付国庫債券（３０年)	1,250,000,000	897,925,000	
４６回　利付国庫債券（３０年)	540,000,000	385,354,800	
４７回　利付国庫債券（３０年)	1,340,000,000	968,458,200	
４８回　利付国庫債券（３０年)	1,470,000,000	1,015,946,400	
４９回　利付国庫債券（３０年)	1,300,000,000	892,814,000	
５０回　利付国庫債券（３０年)	1,250,000,000	748,887,500	
５１回　利付国庫債券（３０年)	1,620,000,000	848,831,400	
５２回　利付国庫債券（３０年)	1,350,000,000	737,829,000	
５３回　利付国庫債券（３０年)	1,120,000,000	622,204,800	
５４回　利付国庫債券（３０年)	1,300,000,000	752,882,000	
５５回　利付国庫債券（３０年)	1,280,000,000	735,014,400	
５６回　利付国庫債券（３０年)	1,540,000,000	876,814,400	

５７回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	637,964,100	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,210,000,000	677,406,400	
５９回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	486,243,000	
６０回　利付国庫債券（３０年）	730,000,000	413,012,100	
６１回　利付国庫債券（３０年）	960,000,000	510,019,200	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	630,732,800	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,050,000,000	500,808,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	425,097,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	374,032,000	
６６回　利付国庫債券（３０年）	890,000,000	412,532,800	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	665,584,000	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,440,000,000	697,492,800	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	623,964,600	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	686,728,000	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,230,000,000	597,583,200	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,190,000,000	572,937,400	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,290,000,000	616,155,600	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,170,000,000	611,137,800	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	760,811,800	
７６回　利付国庫債券（３０年）	1,420,000,000	825,801,000	
７７回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	691,367,900	
７８回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	928,841,200	
７９回　利付国庫債券（３０年）	1,440,000,000	780,163,200	
８０回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	753,571,600	
８１回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	784,628,000	
８２回　利付国庫債券（３０	1,550,000,000	983,785,000	

年)			
８３回　利付国庫債券（３０年)	1,500,000,000	1,049,625,000	
８４回　利付国庫債券（３０年)	1,330,000,000	906,887,100	
８５回　利付国庫債券（３０年)	1,400,000,000	1,000,818,000	
８６回　利付国庫債券（３０年)	1,420,000,000	1,038,801,000	
８７回　利付国庫債券（３０年)	1,000,000,000	799,900,000	
８８回　利付国庫債券（３０年)	1,330,000,000	1,155,597,100	
８９回　利付国庫債券（３０年)	920,000,000	831,882,400	
９０回　利付国庫債券（３０年)	900,000,000	862,182,000	
９７回　利付国庫債券（２０年)	660,000,000	667,524,000	
９８回　利付国庫債券（２０年)	160,000,000	161,636,800	
９９回　利付国庫債券（２０年)	750,000,000	758,347,500	
１００回　利付国庫債券（２０年)	830,000,000	841,321,200	
１０１回　利付国庫債券（２０年)	230,000,000	233,912,300	
１０２回　利付国庫債券（２０年)	500,000,000	509,080,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年)	160,000,000	162,603,200	
１０４回　利付国庫債券（２０年)	110,000,000	111,376,100	
１０５回　利付国庫債券（２０年)	640,000,000	648,403,200	
１０６回　利付国庫債券（２０年)	500,000,000	507,620,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年)	600,000,000	608,172,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年)	690,000,000	696,154,800	
１０９回　利付国庫債券（２０年)	350,000,000	353,108,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年)	440,000,000	446,230,400	
１１１回　利付国庫債券（２０年)	460,000,000	468,128,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年)	740,000,000	750,996,400	
１１３回　利付国庫債券（２０年)	2,270,000,000	2,302,642,600	

１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	538,342,200	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,870,000,000	1,892,627,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	955,000,000	961,837,800	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	469,826,100	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	496,050,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	1,040,000,000	1,041,809,600	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	870,000,000	867,964,200	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,450,000,000	1,462,151,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	910,035,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	912,147,600	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	840,000,000	838,194,000	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	199,100,000	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	1,110,000,000	1,098,012,000	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,082,708,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	520,163,200	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	128,221,600	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	885,393,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	127,166,000	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	560,000,000	544,812,800	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	468,014,400	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,021,850,600	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	680,000,000	659,273,600	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	923,381,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,560,000,000	1,511,328,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	730,000,000	711,531,000	
１４３回　利付国庫債券（２	2,130,000,000	2,043,628,500	

０年)			
１４４回　利付国庫債券（２０年)	1,050,000,000	1,001,049,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年)	1,950,000,000	1,874,418,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年)	2,040,000,000	1,952,463,600	
１４７回　利付国庫債券（２０年)	2,290,000,000	2,166,202,600	
１４８回　利付国庫債券（２０年)	1,730,000,000	1,615,906,500	
１４９回　利付国庫債券（２０年)	1,490,000,000	1,384,463,300	
１５０回　利付国庫債券（２０年)	2,230,000,000	2,045,222,200	
１５１回　利付国庫債券（２０年)	660,000,000	591,973,800	
１５２回　利付国庫債券（２０年)	1,640,000,000	1,462,338,800	
１５３回　利付国庫債券（２０年)	2,660,000,000	2,377,401,600	
１５４回　利付国庫債券（２０年)	2,420,000,000	2,130,834,200	
１５５回　利付国庫債券（２０年)	2,480,000,000	2,129,328,000	
１５６回　利付国庫債券（２０年)	1,680,000,000	1,347,208,800	
１５７回　利付国庫債券（２０年)	1,680,000,000	1,306,485,600	
１５８回　利付国庫債券（２０年)	1,990,000,000	1,585,751,400	
１５９回　利付国庫債券（２０年)	1,740,000,000	1,389,877,200	
１６０回　利付国庫債券（２０年)	1,820,000,000	1,458,347,800	
１６１回　利付国庫債券（２０年)	1,860,000,000	1,460,583,600	
１６２回　利付国庫債券（２０年)	2,030,000,000	1,579,603,900	
１６３回　利付国庫債券（２０年)	2,330,000,000	1,797,245,500	
１６４回　利付国庫債券（２０年)	2,470,000,000	1,864,059,600	
１６５回　利付国庫債券（２０年)	1,870,000,000	1,397,731,500	
１６６回　利付国庫債券（２０年)	1,860,000,000	1,414,492,800	
１６７回　利付国庫債券（２０年)	1,950,000,000	1,430,110,500	
１６８回　利付国庫債券（２０年)	2,120,000,000	1,518,068,400	

１６９回　利付国庫債券（２０年）	2,020,000,000	1,411,172,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	1,244,376,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,820,000,000	1,245,662,600	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,810,000,000	1,246,474,600	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,060,000,000	1,404,631,600	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	2,640,000,000	1,782,237,600	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,270,000,000	1,542,919,000	
１７６回　利付国庫債券（２０年）	1,780,000,000	1,198,741,000	
１７７回　利付国庫債券（２０年）	2,560,000,000	1,677,952,000	
１７８回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,123,020,000	
１７９回　利付国庫債券（２０年）	1,890,000,000	1,236,853,800	
１８０回　利付国庫債券（２０年）	1,910,000,000	1,308,369,100	
１８１回　利付国庫債券（２０年）	2,230,000,000	1,542,223,400	
１８２回　利付国庫債券（２０年）	2,050,000,000	1,456,586,500	
１８３回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,411,529,000	
１８４回　利付国庫債券（２０年）	1,780,000,000	1,246,658,600	
１８５回　利付国庫債券（２０年）	1,750,000,000	1,216,757,500	
１８６回　利付国庫債券（２０年）	2,120,000,000	1,571,386,400	
１８７回　利付国庫債券（２０年）	1,740,000,000	1,236,461,400	
１８８回　利付国庫債券（２０年）	1,550,000,000	1,154,548,500	
１８９回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,169,820,000	
１９０回　利付国庫債券（２０年）	1,630,000,000	1,243,298,800	
１９１回　利付国庫債券（２０年）	1,350,000,000	1,060,128,000	
１９２回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,336,272,000	
１９３回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	929,731,000	
１９４回　利付国庫債券（２	1,170,000,000	1,017,034,200	

	０年)			
	１９５回　利付国庫債券（２０年)	1,460,000,000	1,365,873,800	
	１９６回　利付国庫債券（２０年)	1,000,000,000	960,900,000	
国債証券　合計		460,205,000,000	389,958,733,100	
地方債証券	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	107,187,300	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	189,380,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	375,312,000	
	８０６回　東京都公募公債	100,000,000	93,135,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	276,654,000	
	８１６回　東京都公募公債	100,000,000	91,149,000	
	８６６回　東京都公募公債	300,000,000	274,155,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	196,700,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	79,351,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	101,398,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	101,196,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	178,588,000	
	３３回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	76,231,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	388,720,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	386,004,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	91,603,000	
	３６回２号　宮城県公募公債１０年	250,000,000	230,970,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	192,804,000	
	２４３回　神奈川県公募公債１０年	100,000,000	94,183,000	
	２５１回　神奈川県公募公債１０年	200,000,000	183,350,000	
	２５８回　神奈川県公募公債１０年	300,000,000	266,790,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	96,006,000	
	１１回　神奈川県公募公債２０年	100,000,000	101,047,000	
	１６回　神奈川県公募公債２０年	300,000,000	300,627,000	
	１９回　神奈川県公募公債２０年	100,000,000	97,868,000	
	４６４回　大阪府公募公債１０年	200,000,000	182,978,000	
	４６７回　大阪府公募公債	200,000,000	182,542,000	

１０年			
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	181,314,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	179,678,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	268,482,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	192,710,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	86,679,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	78,642,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	106,990,338	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	374,772,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	183,588,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	189,000,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	91,333,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	88,268,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	298,725,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	97,974,000	
１５年度１１回　兵庫県公募公債	200,000,000	191,298,000	
１０回　兵庫県公募公債　２０年	100,000,000	101,270,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	189,440,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	92,647,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	182,848,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	99,561,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	191,866,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	304,572,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	300,882,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	81,408,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	184,480,000	

２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	104,623,500	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	191,720,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	134,049,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	97,083,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	183,526,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	56,612,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	66,362,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	188,192,000	
令和３年度第４回　埼玉県公募公債	100,000,000	90,842,000	
令和３年度第８回　埼玉県公募公債	100,000,000	89,760,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	116,208,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	136,014,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	100,901,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	94,669,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	276,846,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	87,850,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	193,102,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	190,452,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	92,429,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	99,884,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	91,246,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	100,960,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	101,237,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	288,108,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	179,762,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	91,976,000	

１６回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	92,482,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	87,269,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	77,303,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	182,916,000	
令和３年１回　茨城県公募公債	100,000,000	90,697,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	91,964,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	395,040,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,558,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,136,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	490,060,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,548,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	286,752,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	475,520,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	93,787,000	
２２１回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	89,931,000	
２２２回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	269,784,000	
２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	447,360,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	445,260,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	96,546,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	184,398,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	197,158,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	280,269,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	202,672,000	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	187,174,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	91,922,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	87,522,000	

９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	201,044,000	
２４年度３回　神戸市公募公債	100,000,000	96,067,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	192,000,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	291,303,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	92,290,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	378,184,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	97,804,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	101,007,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	92,065,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	82,840,000	
２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	228,690,000	
第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	193,910,000	
６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	202,860,000	
５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	82,016,000	
６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	100,913,000	
１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	298,293,000	
１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	91,925,000	
２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	86,554,000	
３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	148,190,000	
２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	67,635,000	
２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	153,332,000	
２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	293,988,000	
３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	74,365,000	
令和３年　４回　千葉市公募公債	100,000,000	89,383,000	
１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	188,518,000	
１９回　さいたま市公募公債	100,000,000	89,335,000	
令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	184,398,000	

	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	191,894,000	
地方債証券　合計		24,619,330,000	22,346,600,138	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	197,478,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	194,988,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	331,470,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	46,935,000	
	１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	356,604,000	
	６４回　政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	93,093,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	263,535,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	122,655,000	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	190,976,000	
	３６回　高速道路機構債	300,000,000	245,238,000	
	５０回　高速道路機構債	300,000,000	212,019,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	98,700,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	92,394,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	87,920,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	69,715,000	
	１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	59,526,000	
	１６９回　高速道路機構債	100,000,000	63,362,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	153,728,000	
	２１０回　高速道路機構債	100,000,000	73,930,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,910,000	
	１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	81,616,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	496,045,000	
	１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	97,933,000	
	１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	93,675,000	
	２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	263,586,000	
	２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	88,049,000	
	２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	134,240,000	
	第２６２回　政保道路債	500,000,000	428,520,000	
	２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	65,294,000	
	２７２回　政保日本高速道路	200,000,000	158,836,000	

保有・債務返済機構			
２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	153,928,000	
２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	77,261,000	
３０１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	156,968,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	154,320,000	
３２２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	76,285,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	75,362,000	
３４６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	74,117,000	
３７９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	140,348,000	
３８７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	189,842,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	134,139,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	72,984,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	89,414,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	90,410,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	508,320,000	
１９８回　地方公共団体金融機構債券	100,000,000	91,292,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	201,778,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	304,308,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	304,179,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	100,093,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	195,684,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	96,178,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	192,088,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	260,274,000	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	92,343,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	452,430,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	259,701,000	

４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	175,826,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	232,257,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	77,944,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,207,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,923,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	198,432,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	133,809,000	
Ｆ５６４回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	151,312,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	198,670,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	98,093,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	191,822,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	94,134,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,956,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	347,998,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,677,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,914,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	193,335,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	86,763,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	294,984,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	293,946,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	74,199,000	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,222,000	11,256,900	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,985,000	71,373,127	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,704,000	106,093,653	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,494,000	15,152,202	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,360,000	13,247,642	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,622,000	15,215,671	

５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,543,000	16,017,428	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,089,000	18,918,413	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,486,000	45,722,645	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,472,000	20,549,295	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,414,000	24,286,610	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,829,000	24,613,915	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,283,000	27,245,616	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,477,000	27,641,499	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,559,000	30,664,669	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,184,000	34,058,344	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,327,000	35,273,810	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,054,000	127,479,042	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,670,000	43,546,040	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,438,000	43,547,768	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,001,000	43,859,776	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,698,000	134,805,380	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,900,000	134,030,619	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,062,000	91,504,409	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,569,000	135,191,255	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,761,000	133,388,945	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	319,015,000	233,139,351	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,407,000	46,213,557	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,743,000	47,187,695	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	214,290,000	151,119,450	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	284,060,000	200,688,390	
１６０回貸付債権担保住宅金	220,251,000	154,937,768	

	融支援機構債券			
	１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	223,161,000	156,777,297	
	１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	681,309,000	475,451,485	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	96,153,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	294,090,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	95,586,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	181,770,000	
特殊債券　合計		20,100,439,000	16,502,015,666	
社債券	２５回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１７）	300,000,000	295,392,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	67,086,000	
	３９回　成田国際空港社債	100,000,000	79,403,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	188,280,000	
	１１４回　中日本高速道路債券	200,000,000	194,102,000	
	１０３回　西日本高速道路債券	200,000,000	194,542,000	
	２５回　アサヒグループホールディングス社債	200,000,000	193,036,000	
	3回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	278,622,000	
	9回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	80,222,000	
	２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	156,992,000	
	１７回　ダイセル社債	300,000,000	276,183,000	
	１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	444,180,000	
	4回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	270,009,000	
	１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	287,757,000	
	１９回　パナソニック社債	100,000,000	93,521,000	
	２３回　パナソニック社債	200,000,000	182,960,000	
	４３回　ソニー社債	100,000,000	90,573,000	
	５８回　川崎重工業社債	300,000,000	269,124,000	
	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	96,887,000	
	１８回　本田技研工業　社債	100,000,000	93,919,000	
	２６回　豊田通商社債	100,000,000	74,731,000	
	７３回　三井物産社債	400,000,000	381,528,000	
	５８回　住友商事社債	100,000,000	92,597,000	
	１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	294,261,000	
	１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	369,472,000	
	２２回　ＮＴＴファイナンス社債	100,000,000	89,223,000	

８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,427,000	
１１５回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	95,454,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	188,690,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	275,001,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	95,736,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	185,298,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	294,489,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	98,231,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	72,378,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	100,591,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,075,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	199,298,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	66,825,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	57,786,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	74,778,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	93,581,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	41,308,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	130,360,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	91,488,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,132,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	186,640,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	48,194,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	41,709,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	90,915,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	130,120,000	
８３回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,325,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	100,973,000	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	40,428,000	
7回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	282,927,000	
6回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	185,260,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	387,804,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	181,846,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	74,701,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	189,976,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	382,772,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	136,656,000	

	５４１回　関西電力社債	300,000,000	269,232,000	
	３９６回　中国電力社債	200,000,000	179,380,000	
	４２５回　中国電力社債	100,000,000	93,010,000	
	３１１回　北陸電力社債	100,000,000	99,164,000	
	５２１回　東北電力社債	400,000,000	374,340,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	196,548,000	
	５３６回　東北電力社債	300,000,000	267,924,000	
	３２０回　四国電力社債	300,000,000	267,315,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	72,665,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	71,503,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	272,250,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	63,678,000	
	５０７回　九州電力社債	200,000,000	178,634,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	145,298,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	98,363,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	178,752,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	154,260,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	68,800,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	65,939,000	
	５７回　東京瓦斯社債	300,000,000	114,549,000	
	7回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	194,970,000	
	8回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	149,118,000	
社債券　合計		15,800,000,000	13,722,466,000	
合計			442,529,814,904	

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。

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7月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	52,045,832,592
株式	867,739,556,230
派生商品評価勘定	496,231,270
未収入金	174,041,700
未収配当金	894,554,810
その他未収収益	9,074,942
差入委託証拠金	1,409,290,991
流動資産合計	922,768,582,535
資産合計	922,768,582,535
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,356,780
前受金	743,398,200
未払解約金	212,231,000
未払利息	7,868,396
受入担保金	30,194,280,007
流動負債合計	31,177,134,383
負債合計	31,177,134,383
純資産の部	
元本等	
元本	120,146,441,981
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	771,445,006,171
元本等合計	891,591,448,152
純資産合計	891,591,448,152
負債純資産合計	922,768,582,535

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年7月13日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	122,799,103,456円
同期中追加設定元本額	11,401,320,147円
同期中一部解約元本額	14,053,981,622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	2,153,155,631円
たわらノーロード　国内株式＜ラップ専用＞	3,839,552,469円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	40,775,892,825円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	3,507,890,255円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	4,893,729,043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）	38,140,268円
たわらノーロード　バランス（標準型）	382,425,889円
たわらノーロード　バランス（積極型）	858,163,857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）	1,063,761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）	116,126,777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）	415,163,372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）	437,517,491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）	650,460,184円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	132,074円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,437,279円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	29,917,512円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	13,735,922円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	26,872,943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）	55,085,409円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	30,658,210,771円
Ｏｎｅグローバルバランス	119,203,087円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～１９７２年生まれ向け）	1,387,164円

未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７３～１９７７年生まれ向け）	699,758円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７８～１９８２年生まれ向け）	514,468円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８３～１９８７年生まれ向け）	524,233円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	417,864円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	333,141円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９８～２００２年生まれ向け）	354,304円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／２００３～２００７年生まれ向け）	494,163円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	682,275,527円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,703,780,686円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,524,081,426円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	180,196,892円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	708,825,399円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	924,139,800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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	196,989,848円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	296,441,754円
ＤＩＡＭ　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	1,638,147,245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＞	366,576,631円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	279,598,155円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,553,723,270円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	220,177,564円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	357,355,723円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	81,550,327円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	42,794,651円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,462,769円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	140,995,682円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	642,749,863円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	103,953,883円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	163,731,316円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	76,872,100円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	50,415,747円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	27,804,134円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	941,752,810円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	12,275,849円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	238,635円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	23,288,614円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	501,099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）	16,712,413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）	71,054,808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）	27,805,016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）	93,354,795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）	247,453,748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）	245,962,035円
ＡＭＯｎｅ　ＴＯＰＩＸインデックスファンド２０２５－０１（適格機関投資家限定）	3,505,989,872円
ＡＭＯｎｅ　ＴＯＰＩＸインデックスファンド２０２６－０４（適格機関投資家限定）	556,195,642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）	53,430,273円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	8,064,828円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,158,911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）	509,772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）	1,192,662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）	11,402,807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）	41,176,605円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,477,392円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,361,030円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,495,398円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	60,693円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	101,953,336円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	219,955,695円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	723,477,551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）	4,020,691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）	7,901,188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）	44,300,769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）	10,354,045円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,405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）	56,410,202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	4,556,171円

定）	
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）	11,190,314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）	25,186,671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）	33,048,562円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,145,982円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,295,658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	711,136,695円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	22,309,960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］	2,517,198,721円
計	120,146,441,981円
２．　受益権の総数	120,146,441,981口
３．　有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	28,614,957,580円

（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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	（1）有価証券

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	48,951,823,747
合計	48,951,823,747

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	23,085,111,800	－	23,562,180,000	477,068,200
合計	23,085,111,800	－	23,562,180,000	477,068,200

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	7.4209円 （74,209円）

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2026年7月13日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	9,100	4,490.00	40,859,000	
ニッスイ	194,700	1,250.50	243,472,350	貸付株式数 1,600株
Ｕｍｉｏｓ	105,800	1,307.50	138,333,500	貸付株式数 700株
ユキグニファクトリー	18,600	1,160.00	21,576,000	貸付株式数 200株
カネコ種苗	6,200	1,532.00	9,498,400	
サカタのタネ	26,300	4,385.00	115,325,500	貸付株式数 300株
ホクト	19,400	1,914.00	37,131,600	貸付株式数 900株
ショーボンドホールディングス	127,000	1,259.00	159,893,000	貸付株式数 600株
ミライト・ワン	74,100	3,673.00	272,169,300	貸付株式数 4,800株
タマホーム	13,600	3,015.00	41,004,000	貸付株式数 9,200株
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	42,200	169.00	7,131,800	貸付株式数 28,600株
住石ホールディングス	19,400	571.00	11,077,400	
日鉄鉱業	41,900	2,368.00	99,219,200	貸付株式数 2,700株
三井松島ホールディングス	26,500	1,537.00	40,730,500	貸付株式数 18,000株
ＩＮＰＥＸ	730,500	3,391.00	2,477,125,500	貸付株式数 300株
石油資源開発	134,100	1,668.00	223,678,800	貸付株式数 1,300株
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	19,800	1,831.00	36,253,800	
リョーサン菱洋ホールディングス	29,000	2,773.00	80,417,000	
第一カッター興業	5,600	1,410.00	7,896,000	貸付株式数 100株
安藤・間	115,500	1,797.00	207,553,500	貸付株式数 300株
東急建設	68,100	1,173.00	79,881,300	貸付株式数 2,600株
コムシスホールディングス	68,400	5,154.00	352,533,600	
高松コンストラクショングループ	16,100	3,595.00	57,879,500	貸付株式数 500株
東建コーポレーション	4,800	12,680.00	60,864,000	貸付株式数 3,200株
ヤマウラ	12,200	1,497.00	18,263,400	貸付株式数 8,200株
オリエンタル白石	80,400	354.00	28,461,600	貸付株式数

				8,000株
大成建設	113,600	13,600.00	1,544,960,000	貸付株式数 100株
大林組	481,400	3,182.00	1,531,814,800	貸付株式数 1,500株
清水建設	415,700	2,454.00	1,020,127,800	貸付株式数 4,600株
長谷工コーポレーション	135,800	2,772.50	376,505,500	貸付株式数 700株
松井建設	12,500	1,445.00	18,062,500	貸付株式数 500株
鹿島建設	337,300	5,627.00	1,897,987,100	
不動テトラ	8,600	2,653.00	22,815,800	貸付株式数 200株
鉄建建設	9,600	4,415.00	42,384,000	貸付株式数 800株
西松建設	24,300	5,304.00	128,887,200	貸付株式数 300株
大豊建設	21,300	793.00	16,890,900	貸付株式数 300株
奥村組	24,700	5,560.00	137,332,000	
東鉄工業	16,800	4,120.00	69,216,000	貸付株式数 400株
淺沼組	60,700	838.00	50,866,600	貸付株式数 5,800株 (3,800株)
戸田建設	184,400	1,513.00	278,997,200	貸付株式数 52,900株 (49,200株)
熊谷組	90,200	1,461.00	131,782,200	
矢作建設工業	28,300	1,843.00	52,156,900	貸付株式数 4,600株 (800株)
ピーエス・コンストラクション	13,900	2,101.00	29,203,900	
日本ハウスホールディングス	32,400	308.00	9,979,200	貸付株式数 22,300株 (300株)
大東建託	259,900	3,150.00	818,685,000	貸付株式数 9,300株
新日本建設	21,500	2,053.00	44,139,500	貸付株式数 800株
東亜道路工業	23,400	1,567.00	36,667,800	貸付株式数 2,300株
東亜建設工業	56,300	2,007.00	112,994,100	貸付株式数 3,900株
日本国土開発	46,600	531.00	24,744,600	貸付株式数 1,300株
若築建設	400	3,340.00	1,336,000	
五洋建設	215,600	1,586.50	342,049,400	貸付株式数 200株
世紀東急工業	24,000	1,451.00	34,824,000	貸付株式数

				800株
福田組	10,600	3,720.00	39,432,000	
住友林業	394,800	1,317.50	520,149,000	貸付株式数 26,900株
大和ハウス工業	420,900	4,541.00	1,911,306,900	
ライト工業	27,300	3,880.00	105,924,000	貸付株式数 500株
積水ハウス	453,300	3,472.00	1,573,857,600	貸付株式数 9,900株
日特建設	14,800	1,119.00	16,561,200	貸付株式数 800株 (800株)
北陸電気工事	8,800	1,590.00	13,992,000	
ユアテック	32,200	2,346.00	75,541,200	貸付株式数 900株
日本リーテック	11,800	2,551.00	30,101,800	
四電工	19,000	1,960.00	37,240,000	貸付株式数 400株 (400株)
中電工	20,200	5,060.00	102,212,000	貸付株式数 200株
関電工	83,300	6,130.00	510,629,000	貸付株式数 100株
きんでん	104,400	7,387.00	771,202,800	貸付株式数 200株
東京エネシス	14,300	1,997.00	28,557,100	
トーエネック	29,500	2,085.00	61,507,500	貸付株式数 100株
日本電設工業	28,500	4,055.00	115,567,500	貸付株式数 1,600株
エクシオグループ	143,100	2,630.00	376,353,000	貸付株式数 1,700株
新日本空調	19,700	3,440.00	67,768,000	貸付株式数 600株
クラフティア	32,900	8,579.00	282,249,100	貸付株式数 600株
三機工業	93,600	2,552.00	238,867,200	貸付株式数 1,700株
日揮ホールディングス	155,900	2,303.00	359,037,700	
中外炉工業	4,200	3,990.00	16,758,000	貸付株式数 400株
太平電業	30,200	2,471.00	74,624,200	貸付株式数 100株
高砂熱学工業	81,500	4,644.00	378,486,000	
朝日工業社	15,800	4,135.00	65,333,000	貸付株式数 300株
明星工業	25,800	1,800.00	46,440,000	貸付株式数 1,600株
大氣社	36,800	4,585.00	168,728,000	貸付株式数 200株
ダイダン	88,000	2,670.00	234,960,000	貸付株式数

				9,300株
日比谷総合設備	20,400	2,845.00	58,038,000	
ニップン	54,100	2,780.00	150,398,000	貸付株式数 1,000株
日清製粉グループ本社	147,200	2,024.50	298,006,400	貸付株式数 1,100株
日東富士製粉	9,800	1,793.00	17,571,400	貸付株式数 200株
昭和産業	13,000	3,475.00	45,175,000	
中部飼料	19,400	1,886.00	36,588,400	貸付株式数 13,100株
フィード・ワン	20,100	1,281.00	25,748,100	
日本甜菜製糖	6,700	4,690.00	31,423,000	貸付株式数 200株 (100株)
ＤＭ三井製糖	12,800	3,310.00	42,368,000	
ウェルネオシュガー	8,600	2,691.00	23,142,600	
ＬＩＦＵＬＬ	46,900	201.00	9,426,900	貸付株式数 5,600株
ＭＩＸＩ	28,900	2,907.00	84,012,300	貸付株式数 800株
ジェイエイシーリクルートメント	57,600	877.00	50,515,200	貸付株式数 37,400株
日本M&Aセンターホールディングス	254,200	671.40	170,669,880	貸付株式数 21,500株
メンバーズ	5,500	1,143.00	6,286,500	
ＵＴグループ	312,500	181.00	56,562,500	貸付株式数 1,400株
アイティメディア	8,500	1,177.00	10,004,500	貸付株式数 1,700株 (100株)
Ｅ・Ｊホールディングス	10,400	1,665.00	17,316,000	貸付株式数 200株
オープンアップグループ	48,000	1,945.00	93,360,000	貸付株式数 100株
コシダカホールディングス	43,700	1,035.00	45,229,500	貸付株式数 29,700株
パソナグループ	16,300	1,546.00	25,199,800	貸付株式数 700株
リンクアンドモチベーション	38,000	586.00	22,268,000	貸付株式数 25,800株
エス・エム・エス	60,800	2,441.00	148,412,800	貸付株式数 6,900株
パーソルホールディングス	1,453,800	253.40	368,392,920	貸付株式数 15,300株
クックパッド	31,200	117.00	3,650,400	
森永製菓	59,800	2,666.50	159,456,700	貸付株式数 500株
中村屋	3,900	3,220.00	12,558,000	貸付株式数 2,600株
江崎グリコ	43,700	5,212.00	227,764,400	貸付株式数

				29,700株
ｍｅｉｔｏ	6,800	3,115.00	21,182,000	貸付株式数 4,600株
井村屋グループ	8,400	2,399.00	20,151,600	貸付株式数 5,700株
不二家	10,400	2,459.00	25,573,600	貸付株式数 7,000株
山崎製パン	102,300	3,255.00	332,986,500	貸付株式数 400株
モロゾフ	14,900	1,562.00	23,273,800	貸付株式数 8,100株
亀田製菓	29,200	1,271.00	37,113,200	貸付株式数 800株
寿スピリッツ	81,300	2,654.00	215,770,200	貸付株式数 100株
カルビー	69,900	2,990.50	209,035,950	貸付株式数 900株
森永乳業	220,000	1,233.50	271,370,000	
六甲バター	12,500	1,120.00	14,000,000	貸付株式数 8,500株
ヤクルト本社	196,700	2,850.00	560,595,000	貸付株式数 4,100株
明治ホールディングス	212,800	3,756.00	799,276,800	貸付株式数 2,800株
雪印メグミルク	37,000	3,680.00	136,160,000	貸付株式数 1,000株
プリマハム	20,500	2,405.00	49,302,500	貸付株式数 13,900株
日本ハム	54,700	6,158.00	336,842,600	
丸大食品	15,400	2,260.00	34,804,000	貸付株式数 10,400株
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	16,800	2,765.00	46,452,000	貸付株式数 11,400株
柿安本店	5,900	2,555.00	15,074,500	貸付株式数 4,000株
伊藤ハム米久ホールディングス	26,600	4,835.00	128,611,000	貸付株式数 600株
学情	7,200	1,626.00	11,707,200	貸付株式数 4,800株
スタジオアリス	7,700	1,912.00	14,722,400	貸付株式数 5,200株
クロスキャット	8,900	1,003.00	8,926,700	
システナ	222,500	421.00	93,672,500	貸付株式数 2,600株
ＮＪＳ	3,600	4,395.00	15,822,000	貸付株式数 2,400株
デジタルアーツ	8,200	3,980.00	32,636,000	
日鉄ソリューションズ	42,400	3,782.00	160,356,800	貸付株式数 29,300株 (500株)
ＡＬＳＯＫ	266,300	1,102.50	293,595,750	

キューブシステム	7,900	1,062.00	8,389,800	貸付株式数 900株
いちご	120,600	437.00	52,702,200	
日本駐車場開発	181,800	261.00	47,449,800	貸付株式数 77,100株
コア	6,900	1,995.00	13,765,500	貸付株式数 100株
カカクコム	103,500	3,640.00	376,740,000	
ルネサンス	12,500	1,044.00	13,050,000	貸付株式数 2,500株
ディップ	27,700	1,830.00	50,691,000	貸付株式数 18,800株
ＳＢＳホールディングス	13,900	4,180.00	58,102,000	
新日本科学	16,900	1,293.00	21,851,700	貸付株式数 600株
エムスリー	315,200	1,874.50	590,842,400	貸付株式数 6,200株
ワールドホールディングス	7,300	2,573.00	18,782,900	貸付株式数 300株
ディー・エヌ・エー	63,900	2,472.50	157,992,750	貸付株式数 14,400株
博報堂ＤＹホールディングス	190,000	1,218.50	231,515,000	
ぐるなび	29,700	126.00	3,742,200	貸付株式数 900株 (600株)
タカミヤ	21,700	400.00	8,680,000	貸付株式数 400株
ファンコミュニケーションズ	23,100	403.00	9,309,300	
ライク	8,400	1,514.00	12,717,600	貸付株式数 5,700株
エスプール	41,500	265.00	10,997,500	貸付株式数 700株
ＷＤＢホールディングス	7,000	1,781.00	12,467,000	貸付株式数 4,700株
手間いらず	2,200	2,318.00	5,099,600	
アドウェイズ	17,100	314.00	5,369,400	貸付株式数 400株
バリューコマース	14,100	469.00	6,612,900	貸付株式数 1,500株
インフォマート	150,500	469.00	70,584,500	貸付株式数 14,200株
サッポロビール	228,600	1,960.50	448,170,300	
アサヒグループホールディングス	1,147,000	1,601.50	1,836,920,500	
キリンホールディングス	567,800	2,832.00	1,608,009,600	貸付株式数 100株 (100株)
シマダヤ	7,000	1,680.00	11,760,000	
宝ホールディングス	125,900	2,111.50	265,837,850	貸付株式数 75,100株 (23,900株)
オエノンホールディングス	45,900	501.00	22,995,900	貸付株式数

				700株
飛島ホールディングス	15,700	2,010.00	31,557,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	99,300	4,144.00	411,499,200	
ライフドリンク　カンパニー	27,100	1,451.00	39,322,100	貸付株式数100株
サントリービバレッジ&フード	107,600	4,612.00	496,251,200	貸付株式数1,300株
ダイドーグループホールディングス	17,300	2,823.00	48,837,900	貸付株式数10,000株
伊藤園	49,400	2,963.00	146,372,200	貸付株式数33,500株
キーコーヒー	17,000	1,989.00	33,813,000	貸付株式数11,500株
日清オイリオグループ	60,800	1,877.00	114,121,600	貸付株式数41,300株
不二製油	30,600	3,935.00	120,411,000	
Ｊ－オイルミルズ	17,500	2,093.00	36,627,500	貸付株式数600株
インターメスティック	7,100	1,850.00	13,135,000	
サンエー	37,100	3,210.00	119,091,000	貸付株式数25,200株
カワチ薬品	12,800	3,435.00	43,968,000	貸付株式数8,700株
エービーシー・マート	86,200	2,677.50	230,800,500	貸付株式数2,500株
ハードオフコーポレーション	6,500	2,659.00	17,283,500	貸付株式数100株
高千穂交易	13,000	2,144.00	27,872,000	貸付株式数800株
アスクル	31,300	1,267.00	39,657,100	
ゲオホールディングス	18,500	1,958.00	36,223,000	貸付株式数700株
アンドエスティＨＤ	22,800	3,480.00	79,344,000	貸付株式数15,500株
リガク・ホールディングス	91,900	2,420.00	222,398,000	貸付株式数100株
くら寿司	38,000	1,612.00	61,256,000	貸付株式数2,400株
キャンドゥ	5,900	3,525.00	20,797,500	貸付株式数4,000株
パルグループホールディングス	64,600	1,484.00	95,866,400	貸付株式数2,000株
エディオン	77,900	2,318.00	180,572,200	貸付株式数52,900株
あらた	25,300	2,548.00	64,464,400	貸付株式数800株
サーラコーポレーション	34,500	1,138.00	39,261,000	貸付株式数23,400株
トーメンデバイス	2,300	15,550.00	35,765,000	貸付株式数1,500株

ハローズ	7,500	3,775.00	28,312,500	貸付株式数 5,100株
ＪＰホールディングス	40,700	616.00	25,071,200	貸付株式数 27,800株 (200株)
フジオフードグループ本社	26,600	1,086.00	28,887,600	貸付株式数 18,000株
あみやき亭	11,800	1,319.00	15,564,200	貸付株式数 8,000株
東京エレクトロン　デバイス	16,300	3,805.00	62,021,500	
円谷フィールズホールディングス	30,400	1,446.00	43,958,400	貸付株式数 800株
双日	158,300	5,054.00	800,048,200	貸付株式数 2,000株
アルフレッサ　ホールディングス	155,400	2,209.00	343,278,600	貸付株式数 2,000株
大黒天物産	5,900	4,520.00	26,668,000	
ハニーズホールディングス	14,700	1,385.00	20,359,500	
キッコーマン	506,200	1,627.00	823,587,400	貸付株式数 35,200株
味の素	737,300	5,615.00	4,139,939,500	貸付株式数 159,500株
ブルドックソース	8,100	1,801.00	14,588,100	貸付株式数 5,500株
キユーピー	82,000	4,470.00	366,540,000	貸付株式数 400株
ハウス食品グループ本社	53,400	3,864.00	206,337,600	貸付株式数 4,900株
カゴメ	79,300	2,693.00	213,554,900	
アリアケジャパン	17,100	5,190.00	88,749,000	貸付株式数 1,700株
エバラ食品工業	3,900	2,479.00	9,668,100	貸付株式数 2,600株
キオクシアホールディングス	95,000	67,100.00	6,374,500,000	
ニチレイ	134,000	2,111.50	282,941,000	
横浜冷凍	37,800	2,085.00	78,813,000	貸付株式数 300株
東洋水産	70,800	10,585.00	749,418,000	
イートアンドホールディングス	7,200	2,025.00	14,580,000	貸付株式数 400株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,100	664.00	7,370,400	貸付株式数 1,500株
日清食品ホールディングス	172,600	2,828.00	488,112,800	貸付株式数 10,300株
フジッコ	17,400	1,559.00	27,126,600	貸付株式数 900株 (900株)
ロック・フィールド	17,100	1,351.00	23,102,100	貸付株式数 11,600株
日本たばこ産業	928,300	6,101.00	5,663,558,300	
ケンコーマヨネーズ	9,600	2,087.00	20,035,200	貸付株式数

				200株
わらべや日洋ホールディングス	10,300	2,620.00	26,986,000	貸付株式数 100株
なとり	9,700	1,978.00	19,186,600	貸付株式数 6,500株
ファーマフーズ	20,100	602.00	12,100,200	
北の達人コーポレーション	65,500	125.00	8,187,500	貸付株式数 44,500株
ユーグレナ	103,000	355.00	36,565,000	
紀文食品	13,300	1,075.00	14,297,500	貸付株式数 9,000株
ピックルスホールディングス	9,000	1,151.00	10,359,000	貸付株式数 6,100株
スター・マイカ・ホールディングス	16,100	1,501.00	24,166,100	貸付株式数 500株
ＳＲＥホールディングス	7,500	2,529.00	18,967,500	
片倉工業	16,300	2,587.00	42,168,100	貸付株式数 300株
グンゼ	22,000	3,970.00	87,340,000	
ヒューリック	445,400	1,765.50	786,353,700	貸付株式数 7,200株
ラサ商事	8,600	1,800.00	15,480,000	貸付株式数 200株
アルペン	15,700	2,129.00	33,425,300	貸付株式数 10,600株
ラクーンホールディングス	11,500	620.00	7,130,000	貸付株式数 7,800株
クオールホールディングス	20,300	2,060.00	41,818,000	
アルコニックス	25,300	2,454.00	62,086,200	貸付株式数 2,200株
神戸物産	142,800	2,679.00	382,561,200	貸付株式数 97,100株
ソリトンシステムズ	8,000	1,967.00	15,736,000	貸付株式数 200株
ジンズホールディングス	12,500	6,240.00	78,000,000	貸付株式数 8,500株
ビックカメラ	98,200	1,629.50	160,016,900	貸付株式数 66,700株
ＤＣＭホールディングス	85,000	1,480.00	125,800,000	
ペッパーフードサービス	57,100	180.00	10,278,000	貸付株式数 38,800株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	232,600	1,950.50	453,686,300	貸付株式数 141,700株
あい　ホールディングス	32,800	2,652.00	86,985,600	貸付株式数 14,500株
Ｊ．フロント　リテイリング	188,300	3,129.00	589,190,700	貸付株式数 2,000株
ドトール・日レスホールディングス	29,100	2,800.00	81,480,000	貸付株式数 19,700株
マツキヨココカラ&カンパニー	282,200	2,437.00	687,721,400	
ブロンコビリー	19,200	2,235.00	42,912,000	

ＺＯＺＯ	258,700	1,166.00	301,644,200	貸付株式数 700株
トレジャー・ファクトリー	11,300	2,081.00	23,515,300	貸付株式数 1,000株
物語コーポレーション	31,800	4,995.00	158,841,000	貸付株式数 21,600株
三越伊勢丹ホールディングス	255,700	3,984.00	1,018,708,800	
東洋紡	67,000	1,692.00	113,364,000	貸付株式数 1,000株
ユニチカ	53,700	879.00	47,202,300	
富士紡ホールディングス	21,600	3,860.00	83,376,000	貸付株式数 1,200株
日清紡ホールディングス	117,800	2,150.50	253,328,900	
倉敷紡績	10,800	9,870.00	106,596,000	
ダイワボウホールディングス	61,500	3,341.00	205,471,500	
シキボウ	10,400	1,038.00	10,795,200	
日東紡績	98,000	3,400.00	333,200,000	
トヨタ紡織	76,200	2,163.50	164,858,700	貸付株式数 4,000株
マクニカホールディングス	114,300	3,162.00	361,416,600	貸付株式数 1,200株
ラクト・ジャパン	6,900	3,430.00	23,667,000	
クリエイトＳＤホールディングス	23,300	3,280.00	76,424,000	貸付株式数 14,400株
グリムス	5,600	2,493.00	13,960,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,700	1,564.00	35,502,800	
八洲電機	12,200	2,775.00	33,855,000	貸付株式数 3,900株
メディアスホールディングス	9,700	784.00	7,604,800	貸付株式数 6,500株
レスター	14,100	3,630.00	51,183,000	貸付株式数 300株
ＴＯＫＡＩホールディングス	89,200	1,144.00	102,044,800	貸付株式数 1,400株
三洋貿易	40,400	807.00	32,602,800	
シュッピン	18,000	1,077.00	19,386,000	貸付株式数 12,200株
ビューティガレージ	4,600	1,438.00	6,614,800	貸付株式数 3,100株
オイシックス	24,300	1,504.00	36,547,200	貸付株式数 1,000株
ウイン・パートナーズ	11,800	1,300.00	15,340,000	貸付株式数 8,000株
ネクステージ	37,600	3,385.00	127,276,000	貸付株式数 24,000株
ジョイフル本田	48,100	2,245.00	107,984,500	貸付株式数 700株
エターナルホスピタリティグループ	6,700	2,776.00	18,599,200	
ホットランドホールディングス	12,500	1,576.00	19,700,000	貸付株式数 8,500株

すかいらーくホールディングス	224,400	2,926.00	656,594,400	貸付株式数 152,500株
綿半ホールディングス	12,800	1,342.00	17,177,600	貸付株式数 200株
日本毛織	38,900	1,885.00	73,326,500	貸付株式数 1,200株
ヨシックスホールディングス	4,900	3,290.00	16,121,000	貸付株式数 3,300株
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	829.00	67,066,100	貸付株式数 55,000株
野村不動産ホールディングス	425,900	930.90	396,470,310	貸付株式数 3,700株
三重交通グループホールディングス	37,600	543.00	20,416,800	貸付株式数 25,500株
ディア・ライフ	23,400	1,068.00	24,991,200	貸付株式数 700株
地主	12,500	2,905.00	36,312,500	貸付株式数 500株
フィル・カンパニー	2,800	696.00	1,948,800	
ＪＰＭＣ	8,400	1,594.00	13,389,600	貸付株式数 600株
フージャースホールディングス	26,600	1,226.00	32,611,600	
オープンハウスグループ	47,500	8,531.00	405,222,500	貸付株式数 100株
東急不動産ホールディングス	417,500	1,296.50	541,288,750	貸付株式数 4,700株
飯田グループホールディングス	130,200	2,210.50	287,807,100	貸付株式数 500株
帝国繊維	16,000	3,360.00	53,760,000	
日本コークス工業	157,600	95.00	14,972,000	貸付株式数 1,600株
あさひ	13,700	1,339.00	18,344,300	貸付株式数 600株 (600株)
コスモス薬品	27,700	6,369.00	176,421,300	
シップヘルスケアホールディングス	60,200	2,287.00	137,677,400	
ソフトクリエイトホールディングス	12,800	1,923.00	24,614,400	貸付株式数 8,700株
セブン&アイ・ホールディングス	1,813,100	2,013.00	3,649,770,300	貸付株式数 45,100株
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	276,700	770.00	213,059,000	
明治電機工業	8,100	2,205.00	17,860,500	貸付株式数 1,000株
ツルハホールディングス	256,800	2,290.00	588,072,000	貸付株式数 26,200株
サンマルクホールディングス	14,700	2,540.00	37,338,000	貸付株式数 700株
トリドールホールディングス	46,300	4,019.00	186,079,700	貸付株式数 31,400株
帝人	137,800	1,655.00	228,059,000	貸付株式数

				2,700株
東レ	1,047,100	1,138.00	1,191,599,800	
クラレ	192,700	1,696.00	326,819,200	
旭化成	1,030,000	1,815.50	1,869,965,000	貸付株式数 3,300株
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	22,800	401.00	9,142,800	
稲葉製作所	7,900	1,739.00	13,738,100	
宮地エンジニアリンググループ	21,000	1,538.00	32,298,000	貸付株式数 900株
トーカロ	46,200	3,015.00	139,293,000	貸付株式数 800株
ＳＵＭＣＯ	304,700	5,133.00	1,564,025,100	貸付株式数 200株
川田テクノロジーズ	36,300	1,303.00	47,298,900	貸付株式数 2,300株
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	10,700	7,600.00	81,320,000	貸付株式数 100株
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	9,300	982.00	9,132,600	貸付株式数 6,300株
ケイアイスター不動産	12,700	3,640.00	46,228,000	
グッドコムアセット	15,900	1,484.00	23,595,600	貸付株式数 7,800株
ジェイ・エス・ビー	6,500	8,990.00	58,435,000	
ロードスターキャピタル	10,400	2,658.00	27,643,200	
アズーム	2,600	4,380.00	11,388,000	貸付株式数 100株
霞ヶ関キャピタル	15,100	6,690.00	101,019,000	貸付株式数 200株
ＪＭホールディングス	23,700	1,271.00	30,122,700	貸付株式数 16,100株
コメダホールディングス	40,200	2,835.00	113,967,000	貸付株式数 12,200株
ユニシアホールディングス	5,000	1,606.00	8,030,000	
バロックジャパンリミテッド	19,000	746.00	14,174,000	貸付株式数 12,900株
クスリのアオキホールディングス	38,900	3,810.00	148,209,000	貸付株式数 900株
力の源ホールディングス	12,200	1,543.00	18,824,600	貸付株式数 300株
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	188,400	5,078.00	956,695,200	
アセンテック	20,000	416.00	8,320,000	貸付株式数 2,000株
セーレン	33,800	3,200.00	108,160,000	貸付株式数 900株
小松マテーレ	20,400	717.00	14,626,800	
ワコールホールディングス	30,500	4,458.00	135,969,000	貸付株式数 200株
ＴＳＩホールディングス	40,500	1,201.00	48,640,500	貸付株式数 7,100株
ワールド	51,400	1,600.00	82,240,000	貸付株式数

				34,900株
ＴＩＳＩ	159,000	3,423.00	544,257,000	貸付株式数 4,200株
グリーホールディングス	52,200	391.00	20,410,200	貸付株式数 800株
GMOペパボ	1,900	1,723.00	3,273,700	
コーエーテクモホールディングス	97,500	1,600.00	156,000,000	貸付株式数 500株
三菱総合研究所	7,400	4,630.00	34,262,000	貸付株式数 300株
ファインデックス	10,800	889.00	9,601,200	貸付株式数 200株
ＫＬａｂ	42,200	204.00	8,608,800	貸付株式数 4,600株
ポールトゥウィンホールディングス	22,400	329.00	7,369,600	
ネクソン	367,800	2,261.00	831,595,800	貸付株式数 100株
アイスタイル	59,300	406.00	24,075,800	貸付株式数 3,400株
エムアップホールディングス	38,200	747.00	28,535,400	貸付株式数 900株
エイチームホールディングス	12,000	1,031.00	12,372,000	
セルシス	21,100	1,891.00	39,900,100	貸付株式数 1,500株 (1,100株)
エニグモ	17,300	402.00	6,954,600	貸付株式数 11,700株
コロプラ	52,900	392.00	20,736,800	貸付株式数 2,400株 (1,400株)
ブロードリーフ	113,800	432.00	49,161,600	貸付株式数 2,000株
デジタルハーツホールディングス	9,800	731.00	7,163,800	
メディアドゥ	5,300	1,315.00	6,969,500	
じげん	44,600	402.00	17,929,200	貸付株式数 30,300株
フィックスターズ	21,500	2,279.00	48,998,500	貸付株式数 10,000株
北里	12,000	1,350.00	16,200,000	
オプティム	16,100	412.00	6,633,200	貸付株式数 10,900株
セレス	7,000	2,133.00	14,931,000	貸付株式数 100株
ＳＨＩＦＴ	155,100	703.30	109,081,830	
特種東海製紙	27,100	1,969.00	53,359,900	貸付株式数 200株
セック	4,900	2,976.00	14,582,400	貸付株式数 1,700株
テクマトリックス	31,100	1,854.00	57,659,400	
プロシップ	12,400	1,852.00	22,964,800	貸付株式数 8,400株

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,100	2,339.00	84,437,900	
GMOペイメントゲートウェイ	35,500	9,706.00	344,563,000	貸付株式数300株
システムリサーチ	11,500	1,833.00	21,079,500	貸付株式数7,800株
インターネットイニシアティブ	85,100	3,525.00	299,977,500	貸付株式数400株
さくらインターネット	21,900	2,834.00	62,064,600	貸付株式数100株
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,900	2,143.00	10,500,700	
ＳＲＡホールディングス	8,700	4,530.00	39,411,000	貸付株式数400株
朝日ネット	16,700	630.00	10,521,000	
ｅＢＡＳＥ	19,100	430.00	8,213,000	
アバントグループ	17,500	1,172.00	20,510,000	貸付株式数300株
アドソル日進	12,500	1,489.00	18,612,500	
フリービット	8,100	1,572.00	12,733,200	貸付株式数100株(100株)
コムチュア	20,700	1,359.00	28,131,300	
アステリア	12,100	1,115.00	13,491,500	
アイル	8,700	2,425.00	21,097,500	貸付株式数400株
王子ホールディングス	530,200	815.30	432,272,060	貸付株式数4,800株
日本製紙	87,700	1,342.00	117,693,400	貸付株式数4,700株
北越コーポレーション	75,700	895.00	67,751,500	貸付株式数2,500株
大王製紙	78,600	931.00	73,176,600	貸付株式数2,000株
マークラインズ	9,200	1,386.00	12,751,200	貸付株式数400株
ｇｕｍｉ	28,600	239.00	6,835,400	貸付株式数500株
テラスカイ	5,300	2,285.00	12,110,500	貸付株式数300株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	16,200	951.00	15,406,200	貸付株式数300株
ネオジャパン	4,200	1,630.00	6,846,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,200	2,437.00	7,798,400	貸付株式数100株(100株)
ラクス	143,800	1,019.00	146,532,200	貸付株式数6,100株
ダブルスタンダード	5,600	1,205.00	6,748,000	貸付株式数100株
オープンドア	9,200	345.00	3,174,000	貸付株式数

				100株
アカツキ	7,500	2,907.00	21,802,500	貸付株式数 200株
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,100	1,000.00	5,100,000	貸付株式数 200株
カナミックネットワーク	19,500	498.00	9,711,000	貸付株式数 400株
レンゴー	157,200	1,405.00	220,866,000	貸付株式数 2,400株
トーモク	9,000	4,080.00	36,720,000	貸付株式数 200株
ザ・パック	31,200	1,355.00	42,276,000	貸付株式数 21,200株
チェンジホールディングス	30,000	955.00	28,650,000	
オークネット	28,900	1,380.00	39,882,000	貸付株式数 19,600株
オロ	6,400	2,172.00	13,900,800	貸付株式数 1,600株
ユーザーローカル	6,600	1,794.00	11,840,400	
ＰＫＳＨＡ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｙ	16,700	2,796.00	46,693,200	
マネーフォワード	35,400	5,071.00	179,513,400	貸付株式数 16,800株
レゾナック・ホールディングス	150,100	15,330.00	2,301,033,000	
住友化学	1,250,300	519.00	648,905,700	貸付株式数 14,900株
住友精化	31,800	1,261.00	40,099,800	貸付株式数 900株
日産化学	78,100	7,906.00	617,458,600	貸付株式数 5,400株
ラサ工業	25,600	1,861.00	47,641,600	貸付株式数 500株
クレハ	23,200	4,090.00	94,888,000	貸付株式数 11,400株
多木化学	6,000	4,785.00	28,710,000	貸付株式数 4,000株
テイカ	11,100	2,277.00	25,274,700	貸付株式数 200株
石原産業	25,800	2,756.00	71,104,800	貸付株式数 500株
日本曹達	32,100	3,620.00	116,202,000	
東ソー	226,200	2,690.50	608,591,100	貸付株式数 6,800株
トクヤマ	54,500	4,507.00	245,631,500	貸付株式数 1,300株
セントラル硝子	19,600	4,135.00	81,046,000	
東亞合成	62,600	1,706.00	106,795,600	貸付株式数 1,800株
大阪ソーダ	54,400	1,783.00	96,995,200	貸付株式数 800株
関東電化工業	30,000	2,935.00	88,050,000	貸付株式数 800株

GMOフィナンシャルゲート	2,500	6,780.00	16,950,000	
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	13,700	448.00	6,137,600	貸付株式数 9,300株
デンカ	61,500	3,838.00	236,037,000	貸付株式数 600株
イビデン	196,100	18,690.00	3,665,109,000	貸付株式数 3,400株
信越化学工業	1,381,700	7,340.00	10,141,678,000	貸付株式数 4,600株
日本カーバイド工業	7,600	3,235.00	24,586,000	貸付株式数 3,100株
プラスアルファ・コンサルティング	19,800	2,860.00	56,628,000	
電算システムホールディングス	6,800	2,903.00	19,740,400	
堺化学工業	12,000	4,065.00	48,780,000	貸付株式数 700株
第一稀元素化学工業	15,700	1,900.00	29,830,000	
日本酸素ホールディングス	175,900	6,052.00	1,064,546,800	貸付株式数 1,700株
日本化学工業	6,300	4,245.00	26,743,500	貸付株式数 100株
日本パーカライジング	77,000	1,634.00	125,818,000	貸付株式数 7,900株
高圧ガス工業	22,700	1,111.00	25,219,700	
四国化成ホールディングス	35,200	2,866.00	100,883,200	
オリオンビール	34,300	1,235.00	42,360,500	貸付株式数 8,300株
戸田工業	3,600	1,446.00	5,205,600	貸付株式数 500株
ステラ　ケミファ	8,400	5,690.00	47,796,000	貸付株式数 200株
保土谷化学工業	9,800	2,012.00	19,717,600	貸付株式数 500株
日本触媒	95,600	2,056.50	196,601,400	貸付株式数 800株
大日精化工業	41,900	1,069.00	44,791,100	貸付株式数 2,100株
カネカ	36,600	5,568.00	203,788,800	貸付株式数 500株
協和キリン	182,900	2,630.00	481,027,000	
ブルーゾーンホールディングス	96,900	1,762.50	170,786,250	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	59,400	927.00	55,063,800	貸付株式数 1,600株
三菱瓦斯化学	110,400	4,564.00	503,865,600	
三井化学	279,600	2,070.00	578,772,000	貸付株式数 8,900株
東京応化工業	74,100	10,350.00	766,935,000	貸付株式数 800株
大阪有機化学工業	13,000	4,965.00	64,545,000	
三菱ケミカルグループ	1,086,900	1,161.50	1,262,434,350	貸付株式数 8,300株
ＫＨネオケム	25,900	2,910.00	75,369,000	貸付株式数

				4,500株
ビジョナル	21,000	8,295.00	174,195,000	
ダイセル	163,400	1,404.00	229,413,600	貸付株式数 1,200株
住友ベークライト	51,200	7,035.00	360,192,000	貸付株式数 200株
積水化学工業	305,700	2,611.00	798,182,700	貸付株式数 4,400株
日本ゼオン	109,300	2,224.50	243,137,850	貸付株式数 400株
アイカ工業	39,300	3,675.00	144,427,500	貸付株式数 13,300株
ＵＢＥ	80,000	3,100.00	248,000,000	
積水樹脂	18,500	2,616.00	48,396,000	貸付株式数 100株
旭有機材	10,400	6,430.00	66,872,000	貸付株式数 500株
ニチバン	9,700	1,894.00	18,371,800	貸付株式数 200株
リケンテクノス	26,700	1,815.00	48,460,500	貸付株式数 3,800株 (1,900株)
大倉工業	7,900	4,945.00	39,065,500	貸付株式数 5,300株
積水化成品工業	24,700	507.00	12,522,900	貸付株式数 400株
群栄化学工業	3,800	4,545.00	17,271,000	貸付株式数 100株
ダイキョーニシカワ	33,100	989.00	32,735,900	貸付株式数 700株
森六	8,400	2,408.00	20,227,200	貸付株式数 100株
恵和	10,100	1,225.00	12,372,500	貸付株式数 200株
日本化薬	103,500	1,951.50	201,980,250	貸付株式数 400株
カーリット	13,300	2,327.00	30,949,100	貸付株式数 600株
ＣＬホールディングス	4,000	1,118.00	4,472,000	貸付株式数 100株
プレステージ・インターナショナル	59,100	668.00	39,478,800	貸付株式数 700株
ハイマックス	5,000	1,189.00	5,945,000	貸付株式数 3,400株
テクセンドフォトマスク	57,600	4,170.00	240,192,000	貸付株式数 8,100株
アミューズ	8,700	1,881.00	16,364,700	貸付株式数 100株
野村総合研究所	303,400	5,037.00	1,528,225,800	貸付株式数 200株
ドリームインキュベータ	5,100	2,547.00	12,989,700	

クイック	39,500	762.00	30,099,000	貸付株式数 3,600株 (2,000株)
日本システム技術	14,500	1,827.00	26,491,500	貸付株式数 3,300株
電通グループ	154,200	3,356.00	517,495,200	貸付株式数 2,100株
インテージホールディングス	11,600	1,872.00	21,715,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,700	677.00	5,212,900	貸付株式数 200株
ぴあ	7,300	2,831.00	20,666,300	
イオンファンタジー	6,800	2,697.00	18,339,600	貸付株式数 4,600株
ソースネクスト	80,700	105.00	8,473,500	貸付株式数 56,000株 (1,200株)
シーティーエス	19,600	856.00	16,777,600	貸付株式数 100株
メディカルシステムネットワーク	16,000	494.00	7,904,000	貸付株式数 1,100株
日本精化	9,700	2,600.00	25,220,000	貸付株式数 300株
扶桑化学工業	49,200	3,960.00	194,832,000	貸付株式数 400株
トリケミカル研究所	18,800	3,305.00	62,134,000	
シンプレクス・ホールディングス	123,300	1,033.00	127,368,900	貸付株式数 8,000株
ＨＥＲＯＺ	6,200	692.00	4,290,400	貸付株式数 100株
メルカリ	66,900	4,712.00	315,232,800	
ＩＰＳ	4,600	3,485.00	16,031,000	
システムサポートホールディングス	10,800	1,065.00	11,502,000	貸付株式数 200株
ＡＤＥＫＡ	60,100	4,101.00	246,470,100	貸付株式数 1,000株
日油	178,300	2,720.00	484,976,000	貸付株式数 9,800株
ハリマ化成グループ	12,100	1,024.00	12,390,400	
ボードルア	8,400	3,160.00	26,544,000	貸付株式数 900株
イーソル	10,400	831.00	8,642,400	貸付株式数 300株
ウイングアーク１ｓｔ	16,200	2,533.00	41,034,600	貸付株式数 2,000株
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,300	894.00	5,632,200	
サーバーワークス	3,300	1,986.00	6,553,800	
Ｓａｎｓａｎ	51,400	1,695.00	87,123,000	貸付株式数 1,900株
花王	736,800	3,223.00	2,374,706,400	貸付株式数 299,600株

第一工業製薬	6,200	10,460.00	64,852,000	
石原ケミカル	6,600	2,993.00	19,753,800	貸付株式数 4,400株
三洋化成工業	9,600	4,855.00	46,608,000	貸付株式数 800株
メドレー	18,900	2,075.00	39,217,500	貸付株式数 2,100株 (1,300株)
ベース	6,500	3,160.00	20,540,000	貸付株式数 300株 (100株)
ＪＭＤＣ	22,900	3,225.00	73,852,500	貸付株式数 5,500株
武田薬品工業	1,384,500	5,318.00	7,362,771,000	貸付株式数 9,800株
アステラス製薬	1,364,700	2,121.00	2,894,528,700	貸付株式数 3,000株
住友ファーマ	156,300	1,342.00	209,754,600	貸付株式数 200株
塩野義製薬	567,600	2,818.00	1,599,496,800	
日本新薬	40,800	4,032.00	164,505,600	貸付株式数 100株
中外製薬	486,900	7,230.00	3,520,287,000	
科研製薬	23,000	3,810.00	87,630,000	
エーザイ	203,000	4,243.00	861,329,000	貸付株式数 3,400株
理研ビタミン	13,400	3,125.00	41,875,000	
ロート製薬	164,400	2,467.00	405,574,800	貸付株式数 111,000株 (88,200株)
小野薬品工業	347,000	2,400.50	832,973,500	貸付株式数 3,600株
持田製薬	18,900	3,110.00	58,779,000	貸付株式数 300株
参天製薬	261,700	2,151.00	562,916,700	貸付株式数 3,700株
扶桑薬品工業	6,100	2,140.00	13,054,000	貸付株式数 4,100株
ツムラ	53,400	3,823.00	204,148,200	貸付株式数 200株
テルモ	1,030,700	2,213.50	2,281,454,450	貸付株式数 2,000株
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	49,900	3,344.00	166,865,600	
キッセイ薬品工業	24,300	4,090.00	99,387,000	貸付株式数 700株
生化学工業	26,300	723.00	19,014,900	貸付株式数 300株 (300株)
栄研化学	22,100	2,541.00	56,156,100	貸付株式数 300株
ＪＣＲファーマ	67,700	476.00	32,225,200	貸付株式数

				10,000株
東和薬品	21,000	4,040.00	84,840,000	貸付株式数 2,800株
富士製薬工業	11,400	1,872.00	21,340,800	貸付株式数 200株
ゼリア新薬工業	21,200	2,059.00	43,650,800	貸付株式数 700株
ネクセラファーマ	68,100	896.00	61,017,600	貸付株式数 600株
第一三共	1,428,500	2,691.50	3,844,807,750	貸付株式数 4,000株
杏林製薬	31,400	1,177.00	36,957,800	貸付株式数 800株
大幸薬品	32,400	266.00	8,618,400	貸付株式数 1,300株 (100株)
ダイト	19,100	1,294.00	24,715,400	
大塚ホールディングス	346,400	10,960.00	3,796,544,000	
ペプチドリーム	75,500	1,012.00	76,406,000	貸付株式数 16,700株
大日本塗料	17,200	1,389.00	23,890,800	
日本ペイントホールディングス	825,200	1,053.50	869,348,200	貸付株式数 6,700株
関西ペイント	123,800	2,661.50	329,493,700	貸付株式数 2,600株
中国塗料	31,900	3,610.00	115,159,000	貸付株式数 400株
藤倉化成	18,000	966.00	17,388,000	
太陽ホールディングス	74,500	4,788.00	356,706,000	
ＤＩＣ	55,300	4,520.00	249,956,000	貸付株式数 700株
サカタインクス	31,900	2,391.00	76,272,900	貸付株式数 200株
ａｒｔｉｅｎｃｅ	29,100	4,270.00	124,257,000	
アルプス技研	39,900	805.00	32,119,500	
サニックスホールディングス	20,100	248.00	4,984,800	貸付株式数 300株
日本空調サービス	17,200	1,615.00	27,778,000	貸付株式数 800株
オリエンタルランド	940,000	2,650.00	2,491,000,000	貸付株式数 639,100株
フォーカスシステムズ	10,400	1,684.00	17,513,600	貸付株式数 100株
ダスキン	36,200	4,445.00	160,909,000	貸付株式数 800株
パーク２４	109,300	1,986.50	217,124,450	貸付株式数 14,700株 (14,100株)
明光ネットワークジャパン	21,100	708.00	14,938,800	貸付株式数 14,300株
ファルコホールディングス	6,300	2,680.00	16,884,000	

クレスコ	26,700	1,526.00	40,744,200	貸付株式数 2,500株 (100株)
フジ・メディア・ホールディングス	122,300	4,158.00	508,523,400	
ラウンドワン	150,700	1,255.50	189,203,850	
リゾートトラスト	151,000	1,706.00	257,606,000	貸付株式数 1,900株
オービック	285,300	4,187.00	1,194,551,100	貸付株式数 2,400株
ジャストシステム	22,500	3,860.00	86,850,000	貸付株式数 500株
ＴＤＣソフト	29,100	999.00	29,070,900	貸付株式数 500株
ＬＩＮＥヤフー	2,395,500	445.60	1,067,434,800	貸付株式数 8,200株
ビー・エム・エル	21,400	3,635.00	77,789,000	貸付株式数 700株
トレンドマイクロ	89,900	6,242.00	561,155,800	
ＩＤホールディングス	20,300	1,106.00	22,451,800	
リソー教育グループ	50,200	202.00	10,140,400	
日本オラクル	29,700	8,653.00	256,994,100	貸付株式数 100株
早稲田アカデミー	7,700	2,445.00	18,826,500	貸付株式数 5,200株
アルファシステムズ	5,100	3,330.00	16,983,000	貸付株式数 700株
ＮＳグループ	27,200	1,507.00	40,990,400	
フューチャー	33,300	1,940.00	64,602,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,600	1,821.00	17,481,600	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	302,500	1,976.00	597,740,000	
オービックビジネスコンサルタント	26,300	6,591.00	173,343,300	貸付株式数 900株
アイティフォー	16,200	1,663.00	26,940,600	
東計電算	4,500	4,790.00	21,555,000	貸付株式数 3,000株
サイバーエージェント	352,900	1,497.50	528,467,750	
楽天グループ	1,257,100	798.10	1,003,291,510	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	9,400	1,461.00	13,733,400	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	29,800	581.00	17,313,800	
テー・オー・ダブリュー	28,300	333.00	9,423,900	貸付株式数 300株
大塚商会	176,400	2,924.00	515,793,600	貸付株式数 600株
サイボウズ	21,500	2,571.00	55,276,500	貸付株式数 9,600株
山田コンサルティンググループ	6,900	1,688.00	11,647,200	
セントラルスポーツ	6,000	2,390.00	14,340,000	貸付株式数 600株

パラカ	4,400	2,098.00	9,231,200	貸付株式数 200株
電通総研	56,600	2,678.00	151,574,800	貸付株式数 36,700株
デジタルガレージ	22,200	2,129.00	47,263,800	貸付株式数 4,000株
イーエムシステムズ	20,500	505.00	10,352,500	貸付株式数 1,900株 (700株)
ウェザーニューズ	22,100	2,000.00	44,200,000	貸付株式数 800株
ＣＩＪ	37,700	500.00	18,850,000	
ビジネスエンジニアリング	18,300	1,111.00	20,331,300	
WOWOW	11,600	1,018.00	11,808,800	貸付株式数 4,800株
スカラ	14,600	335.00	4,891,000	
フルキャストホールディングス	12,200	1,633.00	19,922,600	貸付株式数 8,300株 (100株)
エン	26,000	1,223.00	31,798,000	
セルソース	9,300	348.00	3,236,400	
あすか製薬ホールディングス	15,100	2,233.00	33,718,300	貸付株式数 700株
サワイグループホールディングス	80,400	1,661.00	133,544,400	貸付株式数 1,600株
富士フイルムホールディングス	938,000	3,566.00	3,344,908,000	貸付株式数 195,500株
コニカミノルタ	349,900	589.70	206,336,030	貸付株式数 9,900株
資生堂	301,600	2,800.00	844,480,000	貸付株式数 200株
ライオン	178,500	1,661.50	296,577,750	貸付株式数 900株
高砂香料工業	58,500	1,157.00	67,684,500	貸付株式数 1,100株
ミルボン	25,100	2,773.00	69,602,300	貸付株式数 17,000株
コーセーホールディングス	35,100	5,290.00	185,679,000	貸付株式数 23,100株 (2,600株)
コタ	18,100	1,190.00	21,539,000	貸付株式数 2,000株
ポーラ・オルビスホールディングス	79,700	1,312.00	104,566,400	貸付株式数 54,100株
ノエビアホールディングス	14,000	4,555.00	63,770,000	
新日本製薬	8,900	2,015.00	17,933,500	貸付株式数 1,700株
Ｉ－ｎｅ	4,200	1,223.00	5,136,600	貸付株式数 2,800株
アクシージア	9,900	350.00	3,465,000	
エステー	14,700	1,510.00	22,197,000	

コニシ	49,000	1,436.00	70,364,000	貸付株式数 800株
長谷川香料	29,700	3,220.00	95,634,000	貸付株式数 2,600株 (1,700株)
小林製薬	40,800	5,531.00	225,664,800	
荒川化学工業	13,200	2,176.00	28,723,200	
メック	11,300	9,010.00	101,813,000	貸付株式数 300株
日本高純度化学	3,900	5,000.00	19,500,000	貸付株式数 500株
ＪＣＵ	16,900	6,720.00	113,568,000	
ＯＡＴアグリオ	5,800	2,475.00	14,355,000	貸付株式数 200株 (100株)
デクセリアルズ	131,700	3,922.00	516,527,400	貸付株式数 2,800株
アース製薬	14,300	4,645.00	66,423,500	貸付株式数 9,200株
北興化学工業	11,400	1,990.00	22,686,000	貸付株式数 200株
大成ラミックグループ	4,600	2,457.00	11,302,200	貸付株式数 100株
クミアイ化学工業	69,400	721.00	50,037,400	貸付株式数 45,100株
日本農薬	23,800	1,004.00	23,895,200	貸付株式数 500株
ニチレキグループ	16,600	2,096.00	34,793,600	貸付株式数 600株
ユシロ	8,100	2,879.00	23,319,900	貸付株式数 1,400株
ＪＸ金属	612,500	3,836.00	2,349,550,000	貸付株式数 351,300株
出光興産	638,400	1,246.50	795,765,600	貸付株式数 10,500株
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,198,300	1,254.50	2,757,767,350	貸付株式数 3,500株
コスモエネルギーホールディングス	86,200	3,845.00	331,439,000	貸付株式数 700株
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	24,900	2,418.00	60,208,200	貸付株式数 16,000株
日本ビジネスシステムズ	16,800	1,550.00	26,040,000	貸付株式数 11,400株
テスホールディングス	36,900	745.00	27,490,500	貸付株式数 25,000株
インフロニア・ホールディングス	159,400	2,803.50	446,877,900	貸付株式数 81,800株 (77,100株)
横浜ゴム	87,000	7,443.00	647,541,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	98,300	3,900.00	383,370,000	貸付株式数 500株

ブリヂストン	851,200	3,579.00	3,046,444,800	
住友ゴム工業	167,900	2,188.00	367,365,200	貸付株式数 1,200株
藤倉コンポジット	12,800	2,562.00	32,793,600	貸付株式数 200株
オカモト	8,000	5,430.00	43,440,000	貸付株式数 1,100株
アキレス	8,400	1,231.00	10,340,400	貸付株式数 800株
フコク	8,200	1,840.00	15,088,000	
ニッタ	15,400	6,390.00	98,406,000	貸付株式数 400株
三ツ星ベルト	19,800	3,970.00	78,606,000	貸付株式数 1,200株
バンドー化学	23,100	2,226.00	51,420,600	貸付株式数 800株
ＡＧＣ	151,400	6,339.00	959,724,600	
日本板硝子	86,100	482.00	41,500,200	
有沢製作所	27,100	2,462.00	66,720,200	貸付株式数 3,400株 (1,700株)
日本電気硝子	51,900	5,849.00	303,563,100	
オハラ	6,000	1,417.00	8,502,000	貸付株式数 200株
住友大阪セメント	26,000	5,381.00	139,906,000	
太平洋セメント	95,900	3,869.00	371,037,100	貸付株式数 15,800株
日本ヒューム	27,100	1,033.00	27,994,300	貸付株式数 18,400株
日本コンクリート工業	30,500	338.00	10,309,000	貸付株式数 20,700株
三谷セキサン	21,800	1,732.00	37,757,600	
アジアパイルホールディングス	24,400	1,455.00	35,502,000	
東海カーボン	156,600	1,610.50	252,204,300	
日本カーボン	8,900	4,620.00	41,118,000	貸付株式数 200株
東洋炭素	13,400	7,020.00	94,068,000	貸付株式数 500株
ノリタケ	32,600	3,510.00	114,426,000	貸付株式数 500株
ＴＯＴＯ	96,500	7,888.00	761,192,000	
ＮＧＫ	169,600	6,664.00	1,130,214,400	
日本特殊陶業	127,100	10,245.00	1,302,139,500	貸付株式数 500株
ＭＡＲＵＷＡ	6,400	60,210.00	385,344,000	貸付株式数 200株
品川リフラ	19,000	1,974.00	37,506,000	貸付株式数 500株
ヨータイ	9,100	1,744.00	15,870,400	
フジミインコーポレーテッド	46,500	4,060.00	188,790,000	
ニチアス	121,900	3,527.00	429,941,300	貸付株式数

				4,600株
日本製鉄	4,364,300	560.00	2,444,008,000	貸付株式数 18,800株
神戸製鋼所	321,800	1,847.50	594,525,500	貸付株式数 74,500株 (74,500株)
中山製鋼所	33,200	623.00	20,683,600	
合同製鐵	9,000	2,692.00	24,228,000	
ＪＦＥホールディングス	519,300	1,626.50	844,641,450	貸付株式数 227,800株 (5,900株)
東京製鐵	44,600	1,726.00	76,979,600	貸付株式数 2,700株
ＡＲＣＨＩＯＮ	233,200	307.00	71,592,400	貸付株式数 117,400株
共英製鋼	18,300	1,799.00	32,921,700	貸付株式数 800株
大和工業	28,600	12,625.00	361,075,000	貸付株式数 5,100株
東京鐵鋼	17,600	1,906.00	33,545,600	貸付株式数 11,900株
大阪製鐵	7,300	2,532.00	18,483,600	貸付株式数 4,900株
ＧＭＳグループ	20,800	361.00	7,508,800	
ヨドコウ	90,700	1,320.00	119,724,000	貸付株式数 5,600株
トランヴィア	9,200	918.00	8,445,600	
中部鋼鈑	14,700	2,031.00	29,855,700	貸付株式数 700株
丸一鋼管	160,900	1,777.00	285,919,300	
モリ工業	18,100	937.00	16,959,700	貸付株式数 100株
ＭＩＲＡＩＮＩ　ホールディングス	24,600	2,197.00	54,046,200	
大同特殊鋼	113,400	2,449.00	277,716,600	貸付株式数 10,500株
ムニノバホールディングス	253,100	440.00	111,364,000	
日本冶金工業	10,700	4,935.00	52,804,500	
愛知製鋼	29,900	2,983.00	89,191,700	貸付株式数 2,500株
大平洋金属	13,700	2,249.00	30,811,300	貸付株式数 100株
新日本電工	88,000	422.00	37,136,000	貸付株式数 9,000株
栗本鐵工所	37,000	1,458.00	53,946,000	
日本製鋼所	47,500	7,827.00	371,782,500	
三菱製鋼	10,900	2,072.00	22,584,800	貸付株式数 100株
日本精線	12,800	1,511.00	19,340,800	貸付株式数 8,700株
エンビプロ・ホールディングス	14,200	779.00	11,061,800	
大紀アルミニウム工業所	23,000	1,461.00	33,603,000	

日本軽金属ホールディングス	47,000	2,682.00	126,054,000	貸付株式数 700株
三井金属	40,000	35,280.00	1,411,200,000	
東邦亜鉛	13,400	808.00	10,827,200	貸付株式数 400株
三菱マテリアル	106,800	4,047.00	432,219,600	貸付株式数 60,400株 (27,400株)
住友金属鉱山	219,400	7,156.00	1,570,026,400	貸付株式数 7,800株
ＤＯＷＡホールディングス	43,100	8,280.00	356,868,000	貸付株式数 400株
古河機械金属	17,000	3,560.00	60,520,000	貸付株式数 1,300株
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,600	2,545.00	70,242,000	
ＵＡＣＪ	96,800	2,454.00	237,547,200	貸付株式数 100株
ＣＫサンエツ	3,100	5,230.00	16,213,000	貸付株式数 2,100株
前澤ホールディングス	11,100	1,522.00	16,894,200	
古河電気工業	533,000	3,589.00	1,912,937,000	
住友電気工業	2,210,400	2,486.00	5,495,054,400	
フジクラ	1,235,500	5,007.00	6,186,148,500	貸付株式数 2,100株
ＳＷＣＣ	23,300	11,390.00	265,387,000	貸付株式数 1,300株
平河ヒューテック	9,600	3,245.00	31,152,000	貸付株式数 300株
いよぎんホールディングス	199,900	3,310.00	661,669,000	貸付株式数 3,200株
しずおかフィナンシャルグループ	336,500	3,286.00	1,105,739,000	貸付株式数 5,300株
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	128,600	3,265.00	419,879,000	
楽天銀行	81,000	5,809.00	470,529,000	貸付株式数 1,400株
京都フィナンシャルグループ	209,800	4,660.00	977,668,000	貸付株式数 3,600株
リョービ	18,900	2,486.00	46,985,400	貸付株式数 500株
ＡＲＥホールディングス	70,500	2,969.00	209,314,500	貸付株式数 400株
東洋製罐グループホールディングス	80,000	3,999.00	319,920,000	貸付株式数 1,400株
ホッカンホールディングス	8,500	2,335.00	19,847,500	
コロナ	9,000	1,006.00	9,054,000	
ギフティグループ	12,000	1,000.00	12,000,000	
横河ブリッジホールディングス	27,400	2,847.00	78,007,800	
三和ホールディングス	153,900	3,660.00	563,274,000	貸付株式数 2,300株
文化シヤッター	50,200	1,901.00	95,430,200	貸付株式数 2,800株

三協立山	20,000	624.00	12,480,000	貸付株式数 400株
アルインコ	12,200	1,078.00	13,151,600	貸付株式数 300株
ＬＩＸＩＬ	250,000	1,838.50	459,625,000	貸付株式数 38,100株
ノーリツ	28,000	2,292.00	64,176,000	貸付株式数 500株
長府製作所	15,800	1,968.00	31,094,400	貸付株式数 1,100株
リンナイ	81,800	3,563.00	291,453,400	貸付株式数 1,100株
ユニプレス	28,600	1,249.00	35,721,400	貸付株式数 900株
日東精工	21,100	771.00	16,268,100	貸付株式数 1,000株
岡部	28,400	900.00	25,560,000	貸付株式数 600株
ジーテクト	20,300	2,067.00	41,960,100	貸付株式数 400株
東プレ	28,100	2,604.00	73,172,400	貸付株式数 500株
高周波熱錬	24,200	1,323.00	32,016,600	貸付株式数 2,000株 (1,100株)
東京製綱	9,600	1,955.00	18,768,000	貸付株式数 200株
サンコール	15,800	1,489.00	23,526,200	
パイオラックス	17,200	1,642.00	28,242,400	貸付株式数 3,200株
エイチワン	16,400	1,604.00	26,305,600	貸付株式数 600株
日本発条	120,600	3,717.00	448,270,200	貸付株式数 1,500株
中央発條	10,400	3,695.00	38,428,000	貸付株式数 2,300株
三浦工業	72,700	3,210.00	233,367,000	貸付株式数 2,500株 (2,400株)
タクマ	43,900	3,405.00	149,479,500	
弁護士ドットコム	6,000	2,358.00	14,148,000	貸付株式数 600株 (200株)
アイ・アールジャパンホールディングス	8,400	709.00	5,955,600	貸付株式数 900株
ＫｅｅＰｅｒ技研	9,900	2,975.00	29,452,500	貸付株式数 800株
Ｇｕｎｏｓｙ	12,600	470.00	5,922,000	貸付株式数 400株 (100株)
イー・ガーディアン	5,000	1,742.00	8,710,000	貸付株式数

				3,400株
ジャパンマテリアル	48,800	2,623.00	128,002,400	貸付株式数 300株
ベクトル	21,900	1,948.00	42,661,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	13,300	1,356.00	18,034,800	貸付株式数 300株
キャリアリンク	5,900	2,344.00	13,829,600	貸付株式数 4,000株
ＩＢＪ	12,100	853.00	10,321,300	貸付株式数 8,200株
アサンテ	7,600	1,494.00	11,354,400	貸付株式数 5,100株
バリューＨＲ	14,400	1,495.00	21,528,000	貸付株式数 9,700株
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	12,900	3,655.00	47,149,500	貸付株式数 600株
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	575.00	25,760,000	貸付株式数 900株
ウィルグループ	14,800	1,069.00	15,821,200	貸付株式数 10,000株
リクルートホールディングス	1,110,100	12,350.00	13,709,735,000	貸付株式数 1,600株
エラン	14,200	758.00	10,763,600	
ツガミ	33,400	7,490.00	250,166,000	
オークマ	27,200	5,030.00	136,816,000	
芝浦機械	18,700	4,905.00	91,723,500	貸付株式数 100株
アマダ	220,900	2,946.50	650,881,850	貸付株式数 5,400株
アイダエンジニアリング	27,600	1,250.00	34,500,000	貸付株式数 600株
ＦＵＪＩ	62,400	7,838.00	489,091,200	貸付株式数 900株
牧野フライス製作所	15,800	14,820.00	234,156,000	
オーエスジー	55,900	4,058.00	226,842,200	貸付株式数 2,700株
旭ダイヤモンド工業	37,700	1,157.00	43,618,900	貸付株式数 900株
ＤＭＧ森精機	107,300	3,639.00	390,464,700	貸付株式数 13,700株
ソディック	38,200	1,878.00	71,739,600	貸付株式数 24,800株
ディスコ	75,600	70,870.00	5,357,772,000	貸付株式数 600株
日東工器	5,600	1,700.00	9,520,000	貸付株式数 100株
日進工具	13,200	983.00	12,975,600	貸付株式数 200株
冨士ダイス	11,500	962.00	11,063,000	貸付株式数

				300株 (300株)
日本郵政	1,311,300	2,333.00	3,059,262,900	
ベルシステム２４ホールディングス	21,700	1,365.00	29,620,500	貸付株式数 700株
鎌倉新書	15,900	521.00	8,283,900	
エアトリ	13,000	868.00	11,284,000	貸付株式数 500株
アトラエ	11,800	816.00	9,628,800	貸付株式数 1,300株
ストライクグループ	23,400	1,345.00	31,473,000	貸付株式数 3,100株 (1,000株)
セラク	4,900	1,244.00	6,095,600	
インソース	34,600	620.00	21,452,000	貸付株式数 5,300株
リケンＮＰＲ	18,000	3,860.00	69,480,000	
島精機製作所	25,100	922.00	23,142,200	貸付株式数 1,300株 (900株)
オプトラン	25,800	3,620.00	93,396,000	貸付株式数 16,700株
イワキ	10,400	4,525.00	47,060,000	貸付株式数 500株
フリュー	16,400	1,393.00	22,845,200	貸付株式数 11,100株
ヤマシンフィルタ	32,500	507.00	16,477,500	貸付株式数 5,700株
日阪製作所	18,400	1,690.00	31,096,000	貸付株式数 600株
やまびこ	25,700	3,720.00	95,604,000	貸付株式数 16,700株
野村マイクロ・サイエンス	28,100	4,335.00	121,813,500	貸付株式数 900株
平田機工	22,600	3,025.00	68,365,000	貸付株式数 1,300株
ＰＥＧＡＳＵＳ	17,300	546.00	9,445,800	貸付株式数 1,300株
マルマエ	12,000	2,142.00	25,704,000	貸付株式数 1,000株
タツモ	10,400	5,090.00	52,936,000	
ナブテスコ	89,100	5,089.00	453,429,900	貸付株式数 800株
三井海洋開発	39,700	9,855.00	391,243,500	貸付株式数 500株
レオン自動機	18,100	1,496.00	27,077,600	貸付株式数 1,500株
ＳＭＣ	44,300	73,820.00	3,270,226,000	
ホソカワミクロン	11,700	4,925.00	57,622,500	貸付株式数 400株
ユニオンツール	6,800	20,710.00	140,828,000	

瑞光	13,300	895.00	11,903,500	貸付株式数 9,000株
オイレス工業	19,300	2,822.00	54,464,600	貸付株式数 13,100株
日精エー・エス・ビー機械	6,100	9,680.00	59,048,000	貸付株式数 500株
サトー	21,500	2,392.00	51,428,000	貸付株式数 200株
技研製作所	14,200	1,855.00	26,341,000	貸付株式数 1,500株
日本エアーテック	7,300	1,309.00	9,555,700	貸付株式数 200株
ワイエイシイホールディングス	13,600	1,238.00	16,836,800	
小松製作所	755,500	6,403.00	4,837,466,500	貸付株式数 3,900株
住友重機械工業	92,700	5,112.00	473,882,400	貸付株式数 100株
日立建機	62,400	5,181.00	323,294,400	貸付株式数 500株
日工	30,200	935.00	28,237,000	貸付株式数 400株
巴工業	17,400	1,865.00	32,451,000	
井関農機	14,700	1,810.00	26,607,000	貸付株式数 200株
ＴＯＷＡ	56,700	3,155.00	178,888,500	貸付株式数 1,100株
北川鉄工所	6,200	1,682.00	10,428,400	貸付株式数 100株
ローツェ	92,100	4,684.00	431,396,400	貸付株式数 3,600株
ハーモニック・ドライブ・システムズ	42,000	7,240.00	304,080,000	貸付株式数 4,900株
クボタ	792,600	2,703.50	2,142,794,100	貸付株式数 352,100株
荏原実業	16,400	2,384.00	39,097,600	貸付株式数 800株
東洋エンジニアリング	34,100	1,935.00	65,983,500	
三菱化工機	16,500	3,430.00	56,595,000	
月島ホールディングス	21,000	2,584.00	54,264,000	貸付株式数 1,600株
ＴＥＩＫＯＫＵ	10,000	3,150.00	31,500,000	
新東工業	31,600	1,209.00	38,204,400	貸付株式数 800株 (800株)
澁谷工業	14,700	4,310.00	63,357,000	貸付株式数 200株
アイチコーポレーション	22,500	1,394.00	31,365,000	貸付株式数 500株
小森コーポレーション	37,300	1,590.00	59,307,000	貸付株式数 1,200株 (500株)

鶴見製作所	22,200	2,234.00	49,594,800	貸付株式数 1,300株
酒井重工業	6,200	2,135.00	13,237,000	貸付株式数 100株
荏原製作所	318,300	5,908.00	1,880,516,400	
酉島製作所	11,600	2,877.00	33,373,200	
ＡＩＲＭＡＮ	15,700	1,859.00	29,186,300	貸付株式数 1,600株
ダイキン工業	204,100	24,990.00	5,100,459,000	貸付株式数 10,600株 (10,600株)
オルガノ	21,600	15,260.00	329,616,000	
トーヨーカネツ	13,000	2,435.00	31,655,000	貸付株式数 600株
栗田工業	94,300	9,054.00	853,792,200	貸付株式数 4,600株
椿本チエイン	67,800	2,589.00	175,534,200	貸付株式数 1,400株
日機装	36,100	3,605.00	130,140,500	貸付株式数 23,500株 (3,500株)
木村化工機	11,800	1,171.00	13,817,800	貸付株式数 500株 (200株)
レイズネクスト	22,100	2,390.00	52,819,000	貸付株式数 15,000株
アネスト岩田	29,000	1,738.00	50,402,000	貸付株式数 500株
ダイフク	264,400	6,672.00	1,764,076,800	貸付株式数 2,400株
サムコ	4,300	12,920.00	55,556,000	
タダノ	82,600	1,263.00	104,323,800	貸付株式数 1,200株
ＣＫＤ	47,300	6,850.00	324,005,000	貸付株式数 2,800株
平和	46,300	2,034.00	94,174,200	貸付株式数 31,400株
理想科学工業	25,300	1,016.00	25,704,800	貸付株式数 800株
ＳＡＮＫＹＯ	146,800	1,649.50	242,146,600	貸付株式数 3,400株
日本金銭機械	18,900	1,057.00	19,977,300	貸付株式数 1,500株
マースグループホールディングス	13,200	3,085.00	40,722,000	貸付株式数 600株
ガリレイホールディングス	23,100	3,340.00	77,154,000	貸付株式数 800株
ダイコク電機	7,700	2,371.00	18,256,700	貸付株式数 5,200株
竹内製作所	28,200	7,330.00	206,706,000	貸付株式数 4,200株

アマノ	41,400	3,723.00	154,132,200	貸付株式数 200株
ＪＵＫＩ	24,400	530.00	12,932,000	貸付株式数 1,500株 (1,100株)
ジャノメ	11,400	1,305.00	14,877,000	貸付株式数 1,700株
ブラザー工業	194,300	3,677.00	714,441,100	貸付株式数 1,100株
マックス	86,500	1,700.00	147,050,000	貸付株式数 5,300株
モリタホールディングス	23,700	2,369.00	56,145,300	
グローリー	41,000	4,141.00	169,781,000	貸付株式数 2,500株
新晃工業	42,100	1,249.00	52,582,900	貸付株式数 4,300株
だいわ	24,100	1,652.00	39,813,200	貸付株式数 600株
セガサミーホールディングス	123,800	2,414.50	298,915,100	貸付株式数 3,800株
ＴＰＲ	35,700	1,390.00	49,623,000	貸付株式数 700株
ツバキ・ナカシマ	36,400	405.00	14,742,000	
ホシザキ	100,800	5,458.00	550,166,400	貸付株式数 800株
大豊工業	11,900	1,054.00	12,542,600	
日本精工	289,900	1,125.50	326,282,450	貸付株式数 3,200株
ＮＴＮ	415,800	377.10	156,798,180	
ジェイテクト	148,000	2,068.00	306,064,000	貸付株式数 1,400株
不二越	11,400	6,140.00	69,996,000	
ミネベアミツミ	272,600	4,166.00	1,135,651,600	貸付株式数 1,400株
日本トムソン	42,600	2,013.00	85,753,800	貸付株式数 300株
ＴＨＫ	82,900	7,290.00	604,341,000	貸付株式数 700株
ＹＵＳＨＩＮ	12,500	671.00	8,387,500	
前澤給装工業	11,300	1,539.00	17,390,700	
イーグル工業	17,300	2,867.00	49,599,100	
ＰＩＬＬＡＲ	14,600	9,820.00	143,372,000	
キッツ	56,000	2,338.00	130,928,000	貸付株式数 500株
日立製作所	3,945,200	4,716.00	18,605,563,200	貸付株式数 17,600株
三菱電機	1,716,200	5,647.00	9,691,381,400	貸付株式数 6,100株
富士電機	112,500	12,820.00	1,442,250,000	貸付株式数 2,200株
安川電機	170,300	5,972.00	1,017,031,600	貸付株式数

				500株
シンフォニア　テクノロジー	17,300	14,290.00	247,217,000	貸付株式数 200株
明電舎	29,000	8,930.00	258,970,000	貸付株式数 200株
山洋電気	18,100	5,940.00	107,514,000	貸付株式数 300株
デンヨー	11,300	3,505.00	39,606,500	貸付株式数 1,300株 (700株)
ＰＨＣホールディングス	29,400	1,060.00	31,164,000	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	179,600	10,620.00	1,907,352,000	貸付株式数 3,100株
ソシオネクスト	135,700	2,677.00	363,268,900	
ベイカレント	117,200	6,711.00	786,529,200	貸付株式数 1,500株
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,600	1,168.00	4,204,800	
アイモバイル	23,600	517.00	12,201,200	貸付株式数 1,500株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	10,200	978.00	9,975,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	134,200	1,830.50	245,653,100	貸付株式数 14,700株
エル・ティー・エス	2,100	1,849.00	3,882,900	
ミダックホールディングス	8,100	2,155.00	17,455,500	
キュービーネットホールディングス	7,700	1,267.00	9,755,900	貸付株式数 5,200株
オープングループ	22,000	219.00	4,818,000	貸付株式数 1,200株
三櫻工業	23,700	864.00	20,476,800	貸付株式数 700株
マキタ	194,800	5,548.00	1,080,750,400	貸付株式数 1,300株
東芝テック	20,000	2,905.00	58,100,000	貸付株式数 300株
芝浦メカトロニクス	48,500	5,630.00	273,055,000	
マブチモーター	151,200	1,588.50	240,181,200	貸付株式数 84,900株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,100	229.00	2,312,900	
トレックス・セミコンダクター	6,100	2,071.00	12,633,100	
東光高岳	8,500	7,190.00	61,115,000	貸付株式数 200株
ダブル・スコープ	51,200	175.00	8,960,000	
宮越ホールディングス	7,000	737.00	5,159,000	貸付株式数 200株
ダイヘン	14,500	15,070.00	218,515,000	
ヤーマン	30,500	736.00	22,448,000	貸付株式数 20,700株
ＪＶＣケンウッド	121,800	1,135.00	138,243,000	貸付株式数 75,900株 (14,100株)

ミマキエンジニアリング	13,000	2,061.00	26,793,000	貸付株式数 1,500株
大崎電気工業	29,900	1,453.00	43,444,700	貸付株式数 15,000株
オムロン	131,600	5,623.00	739,986,800	貸付株式数 4,900株
日東工業	18,700	4,470.00	83,589,000	貸付株式数 600株
ＩＤＥＣ	20,000	3,255.00	65,100,000	貸付株式数 700株
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	64,200	6,015.00	386,163,000	
ＢＵＦＦＡＬＯ	8,400	2,611.00	21,932,400	貸付株式数 5,700株
テクノメディカ	3,100	2,036.00	6,311,600	貸付株式数 2,100株
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	6,300	481.00	3,030,300	貸付株式数 300株
日本電気	1,028,900	4,339.00	4,464,397,100	貸付株式数 1,600株
富士通	1,441,900	3,308.00	4,769,805,200	
沖電気工業	76,000	3,250.00	247,000,000	貸付株式数 4,700株
電気興業	5,800	2,988.00	17,330,400	貸付株式数 500株 (300株)
サンケン電気	16,000	10,160.00	162,560,000	貸付株式数 9,600株
アイホン	8,200	2,790.00	22,878,000	貸付株式数 100株
ルネサスエレクトロニクス	1,519,100	4,469.00	6,788,857,900	
セイコーエプソン	194,800	2,790.50	543,589,400	貸付株式数 800株
ワコム	93,900	759.00	71,270,100	貸付株式数 2,000株
アルバック	40,100	9,972.00	399,877,200	貸付株式数 100株
アクセル	7,100	1,141.00	8,101,100	貸付株式数 100株
ＥＩＺＯ	22,200	2,611.00	57,964,200	貸付株式数 600株
ジャパンディスプレイ	900,600	52.00	46,831,200	貸付株式数 52,400株
日本信号	39,700	1,601.00	63,559,700	貸付株式数 300株
京三製作所	36,500	861.00	31,426,500	貸付株式数 500株
能美防災	21,300	4,235.00	90,205,500	貸付株式数 700株
ホーチキ	36,600	1,968.00	72,028,800	貸付株式数 1,700株
エレコム	37,500	1,815.00	68,062,500	

パナソニック　ホールディングス	1,851,100	4,419.00	8,180,010,900	貸付株式数 100株
シャープ	188,700	637.40	120,277,380	貸付株式数 4,500株
アンリツ	102,500	4,051.00	415,227,500	貸付株式数 1,600株
ソニーグループ	5,188,200	3,341.00	17,333,776,200	貸付株式数 30,100株
ＴＤＫ	1,353,100	3,203.00	4,333,979,300	貸付株式数 2,300株
帝国通信工業	6,700	2,830.00	18,961,000	貸付株式数 500株 (300株)
タムラ製作所	62,500	906.00	56,625,000	貸付株式数 2,300株
アルプスアルパイン	120,800	2,073.50	250,478,800	貸付株式数 200株
日本電波工業	18,700	3,200.00	59,840,000	貸付株式数 800株
鈴木	8,400	3,140.00	26,376,000	貸付株式数 200株
メイコー	14,000	25,880.00	362,320,000	
日本トリム	3,600	4,595.00	16,542,000	
フォスター電機	14,600	2,837.00	41,420,200	貸付株式数 2,200株
ＳＭＫ	3,800	2,918.00	11,088,400	
ヨコオ	14,000	4,790.00	67,060,000	
ホシデン	30,500	2,753.00	83,966,500	貸付株式数 1,100株 (100株)
ヒロセ電機	22,900	26,855.00	614,979,500	貸付株式数 1,000株
日本航空電子工業	36,700	2,317.00	85,033,900	貸付株式数 2,300株 (100株)
ＴＯＡ	15,800	1,587.00	25,074,600	
マクセル	28,300	2,047.00	57,930,100	貸付株式数 500株
古野電気	20,300	7,390.00	150,017,000	貸付株式数 500株
スミダコーポレーション	26,800	1,334.00	35,751,200	貸付株式数 700株
アイコム	6,000	3,260.00	19,560,000	貸付株式数 4,000株
リオン	6,400	3,500.00	22,400,000	
横河電機	164,000	5,577.00	914,628,000	
新電元工業	6,500	3,590.00	23,335,000	貸付株式数 300株
アズビル	376,800	1,680.00	633,024,000	
日本光電工業	128,900	1,538.50	198,312,650	貸付株式数 4,800株

チノー	12,900	1,596.00	20,588,400	貸付株式数 8,700株
日本電子材料	9,600	7,200.00	69,120,000	貸付株式数 200株
堀場製作所	29,300	27,475.00	805,017,500	
アドバンテスト	467,000	28,820.00	13,458,940,000	貸付株式数 11,400株
エスペック	15,200	3,855.00	58,596,000	貸付株式数 300株
キーエンス	155,200	76,700.00	11,903,840,000	
日置電機	8,100	11,390.00	92,259,000	貸付株式数 5,200株
シスメックス	401,700	1,551.50	623,237,550	貸付株式数 1,200株
日本マイクロニクス	25,600	16,550.00	423,680,000	貸付株式数 100株
メガチップス	9,900	10,180.00	100,782,000	貸付株式数 1,000株
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,300	6,040.00	44,092,000	貸付株式数 500株 (300株)
デンソー	1,519,800	1,925.50	2,926,374,900	
コーセル	18,900	1,341.00	25,344,900	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
イリソ電子工業	12,800	2,881.00	36,876,800	貸付株式数 400株
オプテックスグループ	26,300	3,625.00	95,337,500	貸付株式数 17,000株
千代田インテグレ	3,900	3,220.00	12,558,000	
レーザーテック	65,600	44,770.00	2,936,912,000	
スタンレー電気	65,800	3,484.00	229,247,200	
ウシオ電機	58,200	4,195.00	244,149,000	貸付株式数 1,200株
日本セラミック	12,600	3,720.00	46,872,000	
山一電機	14,300	8,890.00	127,127,000	貸付株式数 1,100株
図研	12,900	4,690.00	60,501,000	
日本電子	35,900	7,815.00	280,558,500	貸付株式数 500株
カシオ計算機	122,400	1,836.00	224,726,400	
ファナック	740,900	6,957.00	5,154,441,300	貸付株式数 1,900株
日本シイエムケイ	49,500	645.00	31,927,500	貸付株式数 7,400株 (2,300株)
エンプラス	4,600	12,470.00	57,362,000	貸付株式数 100株
大真空	22,500	788.00	17,730,000	貸付株式数 9,900株 (9,700株)

ローム	304,500	5,243.00	1,596,493,500	
浜松ホトニクス	240,700	2,453.00	590,437,100	貸付株式数 14,100株
三井ハイテック	80,200	968.00	77,633,600	貸付株式数 1,300株
京セラ	905,100	3,637.00	3,291,848,700	貸付株式数 5,700株
太陽誘電	83,000	11,900.00	987,700,000	貸付株式数 48,900株
村田製作所	1,480,500	9,066.00	13,422,213,000	貸付株式数 31,700株
双葉電子工業	32,000	569.00	18,208,000	貸付株式数 2,500株
日東電工	472,300	3,221.00	1,521,278,300	
東海理化電機製作所	41,600	3,015.00	125,424,000	貸付株式数 800株
ニチコン	40,600	3,200.00	129,920,000	貸付株式数 3,700株
日本ケミコン	23,900	3,655.00	87,354,500	
ＫＯＡ	28,100	2,440.00	68,564,000	貸付株式数 100株
三井Ｅ＆Ｓ	77,700	4,533.00	352,214,100	貸付株式数 1,400株
カナデビア	128,300	1,212.00	155,499,600	
三菱重工業	2,935,500	3,758.00	11,031,609,000	
川崎重工業	584,700	2,716.50	1,588,337,550	貸付株式数 209,900株
ＩＨＩ	816,600	2,812.50	2,296,687,500	貸付株式数 5,000株
名村造船所	48,300	3,795.00	183,298,500	貸付株式数 600株
マネジメントソリューションズ	8,800	1,362.00	11,985,600	貸付株式数 2,300株
プロレド・パートナーズ	3,900	332.00	1,294,800	貸付株式数 100株
フロンティア・マネジメント	5,100	555.00	2,830,500	貸付株式数 3,400株
アンビスホールディングス	34,200	373.00	12,756,600	貸付株式数 600株
カーブスホールディングス	43,600	910.00	39,676,000	貸付株式数 2,800株
Ｍａｃｂｅｅ　Ｐｌａｎｅｔ	6,000	1,152.00	6,912,000	
日本車輌製造	6,000	3,495.00	20,970,000	貸付株式数 700株
ユニゾルホールディングス	14,200	2,566.00	36,437,200	
ヤマエグループホールディングス	16,100	3,030.00	48,783,000	
ＦＰＧ	48,600	1,566.00	76,107,600	貸付株式数 5,400株
ライフネット生命保険	32,600	1,715.00	55,909,000	貸付株式数 1,300株
全国保証	87,900	3,083.00	270,995,700	貸付株式数

				3,300株
めぶきフィナンシャルグループ	714,400	1,531.50	1,094,103,600	貸付株式数 900株
ジャパンインベストメントアドバイザー	24,900	2,076.00	51,692,400	貸付株式数 1,300株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	156,000	1,690.00	263,640,000	
九州フィナンシャルグループ	295,700	1,536.00	454,195,200	貸付株式数 4,100株
かんぽ生命保険	517,800	1,622.50	840,130,500	貸付株式数 34,300株
ゆうちょ銀行	1,659,700	3,299.00	5,475,350,300	貸付株式数 9,700株
富山第一銀行	48,500	2,675.00	129,737,500	貸付株式数 5,000株
横浜フィナンシャルグループ	796,800	1,885.00	1,501,968,000	貸付株式数 2,600株
ジェイリース	11,400	1,360.00	15,504,000	貸付株式数 200株
西日本フィナンシャルホールディングス	93,400	4,336.00	404,982,400	
ＳＢＩアルヒ	15,600	809.00	12,620,400	
プレミアグループ	26,000	2,039.00	53,014,000	
日産自動車	2,370,000	305.10	723,087,000	貸付株式数 234,500株
いすゞ自動車	399,500	2,319.50	926,640,250	貸付株式数 4,400株
トヨタ自動車	8,246,500	2,806.00	23,139,679,000	
三菱自動車工業	593,000	368.80	218,698,400	
武蔵精密工業	34,200	3,590.00	122,778,000	
日産車体	23,700	927.00	21,969,900	貸付株式数 700株
新明和工業	44,600	1,965.00	87,639,000	貸付株式数 400株
極東開発工業	25,700	2,274.00	58,441,800	貸付株式数 900株
トピー工業	11,100	2,847.00	31,601,700	貸付株式数 800株
ティラド	28,000	1,468.00	41,104,000	
曙ブレーキ工業	94,900	110.00	10,439,000	貸付株式数 1,800株
タチエス	28,400	2,121.00	60,236,400	貸付株式数 400株
ＮＯＫ	56,000	2,915.00	163,240,000	貸付株式数 2,700株
フタバ産業	41,700	962.00	40,115,400	貸付株式数 800株
カヤバ	26,300	4,130.00	108,619,000	
市光工業	33,800	512.00	17,305,600	貸付株式数 200株
大同メタル工業	30,400	1,350.00	41,040,000	
プレス工業	63,900	807.00	51,567,300	貸付株式数

				700株
アイシン	378,900	2,254.00	854,040,600	貸付株式数 4,400株
マツダ	513,100	1,101.00	564,923,100	貸付株式数 20,600株
本田技研工業	2,892,300	1,495.00	4,323,988,500	貸付株式数 21,900株
スズキ	1,139,500	2,029.50	2,312,615,250	貸付株式数 300株
ＳＵＢＡＲＵ	457,700	2,475.00	1,132,807,500	貸付株式数 4,400株
ヤマハ発動機	767,600	1,238.50	950,672,600	
小糸製作所	160,800	2,536.00	407,788,800	貸付株式数 1,000株
エクセディ	25,400	5,850.00	148,590,000	貸付株式数 500株
ミツバ	29,300	1,166.00	34,163,800	貸付株式数 1,200株
豊田合成	47,800	4,937.00	235,988,600	
愛三工業	25,800	2,432.00	62,745,600	貸付株式数 1,100株
ヨロズ	14,700	876.00	12,877,200	貸付株式数 9,900株
エフ・シー・シー	30,200	3,460.00	104,492,000	貸付株式数 500株
シマノ	65,200	17,530.00	1,142,956,000	
テイ・エス　テック	57,500	1,737.00	99,877,500	貸付株式数 1,200株
三十三フィナンシャルグループ	59,100	1,797.00	106,202,700	
第四北越フィナンシャルグループ	143,800	2,270.00	326,426,000	
ひろぎんホールディングス	212,600	2,206.00	468,995,600	貸付株式数 4,100株
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	6,810.00	88,530,000	
ダイレクトマーケティングミックス	16,700	350.00	5,845,000	貸付株式数 300株
ポピンズ	2,300	1,500.00	3,450,000	貸付株式数 100株
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	14,700	1,658.00	24,372,600	
十六フィナンシャルグループ	107,100	2,440.00	261,324,000	貸付株式数 200株
ＣＣＩグループ	159,500	1,040.00	165,880,000	貸付株式数 6,200株
ネットプロテクションズホールディングス	46,200	393.00	18,156,600	貸付株式数 1,300株
プロクレアホールディングス	18,700	4,040.00	75,548,000	
ＦＰパートナー	6,600	2,207.00	14,566,200	
あいちフィナンシャルグループ	156,800	1,484.00	232,691,200	貸付株式数 5,500株
小野建	17,600	1,380.00	24,288,000	貸付株式数 1,400株
ノジマ	160,800	1,331.00	214,024,800	貸付株式数

				1,300株
カッパ・クリエイト	25,900	1,545.00	40,015,500	貸付株式数 17,600株
伯東	9,800	4,500.00	44,100,000	貸付株式数 800株
コンドーテック	13,900	1,535.00	21,336,500	貸付株式数 9,400株
ナガイレーベン	17,900	1,732.00	31,002,800	貸付株式数 500株
良品計画	358,300	4,233.00	1,516,683,900	貸付株式数 900株
松田産業	12,500	5,620.00	70,250,000	
第一興商	54,400	1,774.50	96,532,800	
メディパルホールディングス	175,400	2,661.00	466,739,400	貸付株式数 1,800株
アドヴァングループ	10,600	937.00	9,932,200	貸付株式数 7,200株
ＳＰＫ	12,900	1,350.00	17,415,000	貸付株式数 200株
アルビス	5,400	2,550.00	13,770,000	貸付株式数 3,600株
アズワン	52,400	2,438.50	127,777,400	貸付株式数 2,300株
スズデン	9,400	2,450.00	23,030,000	貸付株式数 100株
シモジマ	12,400	1,370.00	16,988,000	貸付株式数 200株
ドウシシャ	19,400	2,931.00	56,861,400	貸付株式数 2,500株 (1,000株)
高速	10,900	3,910.00	42,619,000	貸付株式数 7,400株
Ｇ－７ホールディングス	18,000	1,402.00	25,236,000	貸付株式数 400株
たけびし	6,300	2,334.00	14,704,200	貸付株式数 3,000株
イオン北海道	48,600	846.00	41,115,600	貸付株式数 33,000株
コジマ	27,000	1,277.00	34,479,000	貸付株式数 18,300株
コーナン商事	18,100	4,255.00	77,015,500	貸付株式数 12,300株
エコス	6,100	2,349.00	14,328,900	貸付株式数 4,100株
ワタミ	19,700	933.00	18,380,100	
リックス	4,200	3,550.00	14,910,000	
システムソフト	54,200	50.00	2,710,000	貸付株式数 7,400株
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	872.70	1,447,634,760	
丸文	14,700	1,633.00	24,005,100	貸付株式数

				9,900株
西松屋チェーン	36,300	2,018.00	73,253,400	貸付株式数 22,900株 (13,600株)
ゼンショーホールディングス	83,900	8,984.00	753,757,600	貸付株式数 57,000株
ハピネット	22,400	3,110.00	69,664,000	貸付株式数 2,100株
幸楽苑	15,700	1,119.00	17,568,300	
橋本総業ホールディングス	5,800	1,411.00	8,183,800	
日本ライフライン	41,500	1,361.00	56,481,500	貸付株式数 300株
サイゼリヤ	24,300	5,830.00	141,669,000	貸付株式数 700株
タカショー	13,300	397.00	5,280,100	貸付株式数 4,400株
ＶＴホールディングス	64,000	467.00	29,888,000	貸付株式数 2,200株
アルゴグラフィックス	55,900	1,306.00	73,005,400	貸付株式数 900株
魚力	5,800	2,308.00	13,386,400	貸付株式数 3,900株
ＩＤＯＭ	49,500	1,341.00	66,379,500	貸付株式数 23,900株 (1,900株)
日本エム・ディ・エム	12,200	944.00	11,516,800	貸付株式数 200株 (200株)
ユナイテッドアローズ	17,500	2,418.00	42,315,000	貸付株式数 900株
進和	9,600	3,060.00	29,376,000	貸付株式数 1,200株
ダイトロン	13,400	3,385.00	45,359,000	貸付株式数 300株
ハイデイ日高	26,600	2,755.00	73,283,000	貸付株式数 18,000株
シークス	26,300	1,338.00	35,189,400	貸付株式数 17,800株
コロワイド	92,700	1,937.50	179,606,250	貸付株式数 63,100株
オーハシテクニカ	15,200	1,131.00	17,191,200	貸付株式数 200株
壱番屋	64,800	908.00	58,838,400	貸付株式数 44,000株
白銅	4,800	3,365.00	16,152,000	貸付株式数 3,200株
スギホールディングス	88,200	2,914.00	257,014,800	
薬王堂ホールディングス	9,200	1,677.00	15,428,400	貸付株式数 1,900株
ダブルエー	6,600	1,416.00	9,345,600	貸付株式数 4,400株

島津製作所	206,100	4,170.00	859,437,000	
ＪＭＳ	14,400	474.00	6,825,600	貸付株式数 300株
長野計器	10,200	3,850.00	39,270,000	
ブイ・テクノロジー	7,600	7,180.00	54,568,000	
東京計器	12,900	6,260.00	80,754,000	貸付株式数 1,200株
愛知時計電機	7,400	3,010.00	22,274,000	貸付株式数 200株
インターアクション	8,000	1,779.00	14,232,000	
東京精密	29,400	18,815.00	553,161,000	貸付株式数 100株
マニー	68,300	1,742.00	118,978,600	貸付株式数 1,900株
ニコン	193,600	2,293.50	444,021,600	貸付株式数 3,800株
オリンパス	840,500	1,775.50	1,492,307,750	貸付株式数 4,400株
理研計器	22,100	3,430.00	75,803,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	110,800	17,755.00	1,967,254,000	貸付株式数 200株
タムロン	79,200	1,142.00	90,446,400	貸付株式数 600株
ＨＯＹＡ	291,200	25,480.00	7,419,776,000	貸付株式数 1,200株
ノーリツ鋼機	43,600	1,968.00	85,804,800	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	21,100	2,900.00	61,190,000	貸付株式数 200株
朝日インテック	184,700	3,578.00	660,856,600	貸付株式数 800株
キヤノン	696,400	4,312.00	3,002,876,800	
リコー	363,400	1,499.00	544,736,600	貸付株式数 92,100株
シチズン時計	128,200	2,225.00	285,245,000	貸付株式数 600株
メニコン	57,900	1,671.00	96,750,900	貸付株式数 3,400株
トランザクション	26,700	1,414.00	37,753,800	貸付株式数 18,100株
ニホンフラッシュ	14,700	717.00	10,539,900	
前田工繊	31,600	1,848.00	58,396,800	貸付株式数 300株
アートネイチャー	14,200	850.00	12,070,000	貸付株式数 2,900株
フルヤ金属	14,700	7,150.00	105,105,000	貸付株式数 1,100株
バンダイナムコホールディングス	411,400	4,065.00	1,672,341,000	
ＳＨＯＥＩ	37,400	1,835.00	68,629,000	貸付株式数 25,400株
フランスベッドホールディングス	22,300	1,263.00	28,164,900	貸付株式数 15,100株

マーベラス	28,700	448.00	12,857,600	貸付株式数 400株
パイロットコーポレーション	65,100	1,763.50	114,803,850	
萩原工業	10,400	1,764.00	18,345,600	貸付株式数 7,000株
エイベックス	26,600	1,257.00	33,436,200	貸付株式数 700株
フジシールインターナショナル	31,400	2,965.00	93,101,000	貸付株式数 800株
タカラトミー	76,000	3,367.00	255,892,000	貸付株式数 3,800株
広済堂ホールディングス	50,100	564.00	28,256,400	貸付株式数 20,000株
レック	15,600	969.00	15,116,400	貸付株式数 400株 (400株)
三光合成	19,500	767.00	14,956,500	貸付株式数 2,000株
プロネクサス	16,100	1,135.00	18,273,500	貸付株式数 700株
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	188,000	5,148.00	967,824,000	貸付株式数 1,900株
大日本印刷	334,700	3,101.00	1,037,904,700	貸付株式数 1,200株
共同印刷	15,700	1,635.00	25,669,500	貸付株式数 1,000株
ＮＩＳＳＨＡ	27,700	1,316.00	36,453,200	貸付株式数 3,600株
ＺＡＣＲＯＳ	49,200	1,308.00	64,353,600	貸付株式数 800株
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,400	4,255.00	35,742,000	貸付株式数 3,000株
未来工業	7,400	3,220.00	23,828,000	
アシックス	596,500	4,886.00	2,914,499,000	
ツツミ	3,700	2,584.00	9,560,800	
ＪＳＰ	9,100	2,430.00	22,113,000	
ニチハ	18,000	2,942.00	52,956,000	貸付株式数 400株
ローランド	12,200	4,005.00	48,861,000	貸付株式数 4,000株 (100株)
エフピコ	29,400	2,532.00	74,440,800	
小松ウオール工業	11,300	2,581.00	29,165,300	貸付株式数 500株
ヤマハ	241,700	1,178.00	284,722,600	貸付株式数 19,500株
河合楽器製作所	4,300	3,170.00	13,631,000	
クリナップ	17,500	936.00	16,380,000	貸付株式数 300株
ピジョン	91,700	2,040.00	187,068,000	貸付株式数 59,600株

キングジム	14,000	776.00	10,864,000	貸付株式数 400株
象印マホービン	42,100	1,382.00	58,182,200	貸付株式数 26,200株
リンテック	33,700	6,330.00	213,321,000	貸付株式数 800株
信越ポリマー	33,600	2,466.00	82,857,600	貸付株式数 500株
イトーキ	34,100	2,760.00	94,116,000	貸付株式数 21,000株
任天堂	970,500	7,106.00	6,896,373,000	
三菱鉛筆	21,000	2,675.00	56,175,000	
松風	14,100	2,116.00	29,835,600	
タカラスタンダード	33,100	3,050.00	100,955,000	貸付株式数 900株
コクヨ	307,000	847.80	260,274,600	貸付株式数 2,000株
ナカバヤシ	16,800	566.00	9,508,800	貸付株式数 300株
ニフコ	58,200	5,016.00	291,931,200	
立川ブラインド工業	8,100	2,520.00	20,412,000	
グローブライド	14,600	2,406.00	35,127,600	
オカムラ	46,700	2,263.00	105,682,100	貸付株式数 200株
バルカー	13,000	6,660.00	86,580,000	貸付株式数 200株
伊藤忠商事	5,516,400	1,877.50	10,357,041,000	
丸紅	1,252,500	4,862.00	6,089,655,000	
スクロール	28,000	1,728.00	48,384,000	貸付株式数 2,300株
ヨンドシーホールディングス	15,500	2,109.00	32,689,500	貸付株式数 800株 (800株)
三陽商会	7,300	4,195.00	30,623,500	
長瀬産業	280,400	1,135.50	318,394,200	貸付株式数 27,600株
蝶理	8,800	3,875.00	34,100,000	貸付株式数 300株
豊田通商	493,000	6,054.00	2,984,622,000	
オンワードホールディングス	90,500	720.00	65,160,000	
三共生興	21,500	803.00	17,264,500	貸付株式数 400株
兼松	137,100	2,049.00	280,917,900	貸付株式数 1,300株
美津濃	41,700	3,600.00	150,120,000	貸付株式数 700株
ルックホールディングス	5,100	2,653.00	13,530,300	貸付株式数 3,400株
三井物産	2,325,700	4,580.00	10,651,706,000	貸付株式数 14,900株
日本紙パルプ商事	87,300	1,101.00	96,117,300	貸付株式数

				3,200株
東京エレクトロン	325,700	71,300.00	23,222,410,000	貸付株式数 500株
カメイ	15,400	3,600.00	55,440,000	
スターゼン	37,400	1,284.00	48,021,600	
セイコーグループ	43,200	7,270.00	314,064,000	
山善	49,600	1,740.00	86,304,000	貸付株式数 1,500株
椿本興業	11,300	2,768.00	31,278,400	貸付株式数 7,600株
住友商事	3,880,000	1,555.50	6,035,340,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	51,700	4,588.00	237,199,600	貸付株式数 900株
内田洋行	30,000	2,110.00	63,300,000	
三菱商事	3,012,300	4,440.00	13,374,612,000	貸付株式数 42,000株
第一実業	15,300	3,380.00	51,714,000	貸付株式数 2,500株
キヤノンマーケティングジャパン	77,200	3,465.00	267,498,000	貸付株式数 500株
西華産業	23,600	2,623.00	61,902,800	貸付株式数 600株
佐藤商事	11,300	2,929.00	33,097,700	貸付株式数 600株
東京産業	16,600	820.00	13,612,000	貸付株式数 2,700株
ＹＵＡＳＡ	14,200	5,390.00	76,538,000	貸付株式数 400株
神鋼商事	12,200	2,437.00	29,731,400	貸付株式数 200株
阪和興業	134,700	1,660.00	223,602,000	貸付株式数 700株
正栄食品工業	10,800	4,230.00	45,684,000	貸付株式数 7,300株
カナデン	13,100	2,534.00	33,195,400	貸付株式数 400株
ＲＹＯＤＥＮ	12,500	3,835.00	47,937,500	貸付株式数 8,500株
ニプロ	129,200	1,552.50	200,583,000	貸付株式数 1,900株
岩谷産業	163,100	1,973.50	321,877,850	貸付株式数 2,100株
極東貿易	9,200	1,722.00	15,842,400	貸付株式数 5,700株 (5,700株)
アステナホールディングス	31,400	529.00	16,610,600	貸付株式数 600株
三愛オブリ	36,600	2,192.00	80,227,200	貸付株式数 700株
稲畑産業	37,400	3,905.00	146,047,000	
ＧＳＩクレオス	9,500	2,417.00	22,961,500	貸付株式数

				6,400株
明和産業	23,500	900.00	21,150,000	
ゴールドウイン	90,900	2,300.00	209,070,000	貸付株式数 3,000株
ユニ・チャーム	972,300	953.70	927,282,510	貸付株式数 4,000株
ワキタ	27,100	1,833.00	49,674,300	貸付株式数 18,400株
東邦ホールディングス	46,600	3,970.00	185,002,000	貸付株式数 500株
サンゲツ	41,200	2,982.00	122,858,400	貸付株式数 200株
ミツウロコグループホールディングス	19,800	2,023.00	40,055,400	貸付株式数 100株 (100株)
シナネンホールディングス	3,200	7,000.00	22,400,000	貸付株式数 100株
伊藤忠エネクス	40,700	2,010.00	81,807,000	貸付株式数 400株
サンリオ	814,900	1,161.00	946,098,900	貸付株式数 4,200株
サンワ　テクノス	9,300	3,805.00	35,386,500	貸付株式数 6,300株
新光商事	19,700	1,586.00	31,244,200	
トーホー	18,800	1,344.00	25,267,200	貸付株式数 12,700株
三信電気	9,400	2,819.00	26,498,600	貸付株式数 200株
東陽テクニカ	13,600	1,961.00	26,669,600	貸付株式数 6,100株
モスフードサービス	24,200	3,765.00	91,113,000	貸付株式数 16,400株
加賀電子	30,500	4,180.00	127,490,000	貸付株式数 300株
都築電気	9,900	4,030.00	39,897,000	
ソーダニッカ	16,000	1,152.00	18,432,000	貸付株式数 10,800株
立花エレテック	9,800	3,320.00	32,536,000	
木曽路	25,000	2,393.00	59,825,000	貸付株式数 17,000株
ＳＲＳホールディングス	27,000	1,271.00	34,317,000	貸付株式数 18,300株
千趣会	33,300	109.00	3,629,700	貸付株式数 22,600株
リテールパートナーズ	24,400	1,365.00	33,306,000	貸付株式数 16,500株
Ｊｏｓｈｉｎ	17,800	3,425.00	60,965,000	貸付株式数 12,100株
日本瓦斯	75,100	2,832.50	212,720,750	
ロイヤルホールディングス	63,700	1,253.00	79,816,100	貸付株式数 43,300株

チヨダ	16,500	995.00	16,417,500	貸付株式数 6,000株
ライフコーポレーション	31,500	2,444.00	76,986,000	
リンガーハット	22,800	2,313.00	52,736,400	貸付株式数 15,500株
ＭｒＭａｘＨＤ	14,000	768.00	10,752,000	
ＡＯＫＩホールディングス	35,200	1,681.00	59,171,200	
オークワ	22,000	785.00	17,270,000	貸付株式数 14,900株
コメリ	21,900	3,470.00	75,993,000	貸付株式数 900株
青山商事	105,500	707.00	74,588,500	貸付株式数 7,300株
しまむら	115,500	3,350.00	386,925,000	貸付株式数 8,100株 (1,000株)
高島屋	230,100	2,302.50	529,805,250	貸付株式数 900株
松屋	31,000	1,735.00	53,785,000	貸付株式数 4,300株
エイチ・ツー・オー　リテイリング	80,000	2,795.00	223,600,000	貸付株式数 2,200株
近鉄百貨店	9,400	1,898.00	17,841,200	貸付株式数 6,300株
丸井グループ	95,800	2,956.00	283,184,800	貸付株式数 1,500株
クレディセゾン	74,700	4,663.00	348,326,100	貸付株式数 800株
アクシアル　リテイリング	44,700	1,179.00	52,701,300	
イオン	1,937,500	1,403.50	2,719,281,250	貸付株式数 17,200株
イズミ	87,100	989.00	86,141,900	貸付株式数 3,800株
フォーバル	6,400	1,026.00	6,566,400	貸付株式数 1,300株
平和堂	26,800	2,557.00	68,527,600	貸付株式数 12,400株
フジ	25,300	1,988.00	50,296,400	貸付株式数 17,200株
ゼビオホールディングス	19,400	1,083.00	21,010,200	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
ケーズホールディングス	107,200	1,771.50	189,904,800	
三谷産業	28,500	698.00	19,893,000	貸付株式数 19,300株
ＳＢＩ新生銀行	259,700	1,444.00	375,006,800	貸付株式数 10,600株
あおぞら銀行	97,300	2,907.50	282,899,750	貸付株式数 2,600株
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,637,800	3,541.00	34,127,449,800	貸付株式数 35,500株

りそなホールディングス	1,873,700	2,362.50	4,426,616,250	
三井住友トラストグループ	526,800	6,632.00	3,493,737,600	
三井住友フィナンシャルグループ	3,330,100	6,925.00	23,060,942,500	
千葉銀行	449,900	2,753.00	1,238,574,700	
群馬銀行	275,600	2,513.50	692,720,600	貸付株式数 7,100株
武蔵野銀行	64,000	2,591.00	165,824,000	
千葉興業銀行	28,700	2,727.00	78,264,900	
筑波銀行	66,900	614.00	41,076,600	貸付株式数 4,000株
七十七銀行	146,700	3,517.00	515,943,900	
秋田銀行	10,300	7,120.00	73,336,000	
山形銀行	19,600	3,690.00	72,324,000	
岩手銀行	39,000	2,086.00	81,354,000	
東邦銀行	175,800	819.00	143,980,200	貸付株式数 3,700株
ふくおかフィナンシャルグループ	122,000	7,334.00	894,748,000	
スルガ銀行	89,800	2,617.00	235,006,600	貸付株式数 1,500株
八十二長野銀行	315,100	2,565.00	808,231,500	
山梨中央銀行	18,600	6,500.00	120,900,000	貸付株式数 200株
大垣共立銀行	31,100	7,740.00	240,714,000	
福井銀行	14,700	5,810.00	85,407,000	貸付株式数 300株
清水銀行	6,100	2,660.00	16,226,000	
滋賀銀行	104,600	2,867.00	299,888,200	
南都銀行	114,800	1,843.00	211,576,400	貸付株式数 200株
百五銀行	143,600	2,060.00	295,816,000	貸付株式数 6,000株
紀陽銀行	50,700	4,610.00	233,727,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	91,300	7,582.00	692,236,600	貸付株式数 200株
山陰合同銀行	95,500	2,436.00	232,638,000	
百十四銀行	59,800	2,647.00	158,290,600	貸付株式数 500株
四国銀行	24,000	3,145.00	75,480,000	
阿波銀行	22,700	7,580.00	172,066,000	貸付株式数 100株
大分銀行	48,200	2,508.00	120,885,600	
宮崎銀行	44,500	2,194.00	97,633,000	
佐賀銀行	9,600	5,640.00	54,144,000	
琉球銀行	32,500	2,739.00	89,017,500	貸付株式数 100株
セブン銀行	478,700	294.50	140,977,150	貸付株式数 120,200株 (115,500株)
みずほフィナンシャルグループ	2,124,800	8,417.00	17,884,441,600	貸付株式数 8,200株

山口フィナンシャルグループ	149,700	2,984.50	446,779,650	
芙蓉総合リース	42,200	4,271.00	180,236,200	貸付株式数 100株
みずほリース	114,800	1,295.00	148,666,000	
東京センチュリー	114,300	2,536.00	289,864,800	貸付株式数 400株
ＳＢＩホールディングス	536,400	2,790.00	1,496,556,000	貸付株式数 52,300株 (52,300株)
日本証券金融	53,000	2,376.00	125,928,000	貸付株式数 1,500株
名古屋銀行	28,500	6,530.00	186,105,000	貸付株式数 100株
北洋銀行	197,400	1,180.00	232,932,000	
愛媛銀行	22,400	2,261.00	50,646,400	
京葉銀行	65,900	2,600.00	171,340,000	貸付株式数 200株
栃木銀行	82,500	976.00	80,520,000	貸付株式数 400株
北日本銀行	5,000	6,110.00	30,550,000	貸付株式数 200株
東和銀行	30,200	1,311.00	39,592,200	貸付株式数 900株
リコーリース	14,600	6,380.00	93,148,000	
イオンフィナンシャルサービス	87,700	1,544.50	135,452,650	
アコム	272,900	481.80	131,483,220	貸付株式数 1,900株
ジャックス	18,300	3,675.00	67,252,500	貸付株式数 200株
オリエントコーポレーション	59,700	880.00	52,536,000	貸付株式数 600株
オリックス	912,600	6,391.00	5,832,426,600	貸付株式数 1,000株
三菱ＨＣキャピタル	765,800	1,378.00	1,055,272,400	貸付株式数 8,900株
ジャフコ　グループ	40,900	2,342.00	95,787,800	貸付株式数 14,000株
トモニホールディングス	145,900	939.00	137,000,100	貸付株式数 2,800株
大和証券グループ本社	1,092,600	1,777.00	1,941,550,200	
野村ホールディングス	2,507,400	1,542.50	3,867,664,500	貸付株式数 22,900株
岡三証券グループ	120,700	1,011.00	122,027,700	貸付株式数 6,000株
丸三証券	50,700	1,119.00	56,733,300	
東洋証券	47,200	640.00	30,208,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	181,200	774.00	140,248,800	
水戸証券	42,000	692.00	29,064,000	貸付株式数

				1,400株
いちよし証券	28,400	1,485.00	42,174,000	貸付株式数 5,000株
松井証券	105,200	1,050.00	110,460,000	貸付株式数 2,100株
ＳＯＭＰＯホールディングス	758,700	6,478.00	4,914,858,600	貸付株式数 2,300株
日本取引所グループ	837,900	2,196.50	1,840,447,350	
マネックスグループ	161,800	726.00	117,466,800	貸付株式数 19,000株
極東証券	21,000	1,661.00	34,881,000	貸付株式数 700株
岩井コスモホールディングス	15,900	4,200.00	66,780,000	
アイザワ証券グループ	16,000	1,563.00	25,008,000	貸付株式数 900株 (900株)
フィデアホールディングス	15,700	2,079.00	32,640,300	貸付株式数 200株
池田泉州ホールディングス	211,800	1,018.00	215,612,400	貸付株式数 4,500株
アニコム　ホールディングス	47,800	1,230.00	58,794,000	貸付株式数 4,500株
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	952,500	4,431.00	4,220,527,500	貸付株式数 2,400株
ソニーフィナンシャルグループ	5,065,500	150.90	764,383,950	貸付株式数 37,500株
スパークス・グループ	16,900	2,276.00	38,464,400	貸付株式数 11,400株
第一ライフグループ	2,940,100	1,828.00	5,374,502,800	貸付株式数 23,800株
東京海上ホールディングス	1,570,400	7,613.00	11,955,455,200	貸付株式数 56,100株 (50,500株)
イー・ギャランティ	23,700	1,856.00	43,987,200	貸付株式数 2,500株
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,500	4,135.00	31,012,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	339,700	4,928.00	1,674,041,600	貸付株式数 3,400株
アドバンスクリエイト	11,800	132.00	1,557,600	貸付株式数 2,300株
三井不動産	2,206,700	1,517.00	3,347,563,900	貸付株式数 4,600株
三菱地所	917,900	4,141.00	3,801,023,900	
平和不動産	28,700	2,335.00	67,014,500	
東京建物	144,700	3,345.00	484,021,500	
京阪神ビルディング	45,600	1,127.00	51,391,200	貸付株式数 1,000株
住友不動産	434,300	3,767.00	1,636,008,100	
テーオーシー	27,100	927.00	25,121,700	貸付株式数 18,400株
レオパレス２１	135,800	665.00	90,307,000	

スターツコーポレーション	28,000	4,700.00	131,600,000	
フジ住宅	19,000	773.00	14,687,000	貸付株式数 300株
空港施設	21,600	969.00	20,930,400	貸付株式数 400株
明和地所	12,100	822.00	9,946,200	貸付株式数 200株
ゴールドクレスト	8,400	3,330.00	27,972,000	
リログループ	71,100	2,030.00	144,333,000	
エスリード	7,100	5,080.00	36,068,000	
日神グループホールディングス	24,500	660.00	16,170,000	貸付株式数 16,600株
エスコン	34,200	1,121.00	38,338,200	貸付株式数 900株
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	97,400	414.00	40,323,600	貸付株式数 2,000株
ランド	984,900	10.00	9,849,000	
カチタス	41,100	3,285.00	135,013,500	貸付株式数 900株
東祥	13,400	773.00	10,358,200	貸付株式数 1,800株
トーセイ	45,100	1,733.00	78,158,300	貸付株式数 29,300株
サンフロンティア不動産	22,700	2,469.00	56,046,300	
ＦＪネクストホールディングス	14,200	1,799.00	25,545,800	貸付株式数 600株
グランディハウス	14,500	534.00	7,743,000	
東武鉄道	160,200	2,931.50	469,626,300	貸付株式数 2,100株
相鉄ホールディングス	59,700	2,538.50	151,548,450	
東急	398,700	1,712.50	682,773,750	貸付株式数 173,800株 (28,800株)
京浜急行電鉄	176,000	1,546.50	272,184,000	貸付株式数 5,000株
小田急電鉄	235,200	1,715.00	403,368,000	貸付株式数 16,800株
京王電鉄	339,800	757.20	257,296,560	
京成電鉄	270,000	1,239.50	334,665,000	
富士急行	18,900	2,545.00	48,100,500	貸付株式数 12,800株
東日本旅客鉄道	855,400	3,531.00	3,020,417,400	貸付株式数 97,700株 (82,000株)
西日本旅客鉄道	369,900	2,962.00	1,095,643,800	貸付株式数 214,500株
東海旅客鉄道	638,600	3,657.00	2,335,360,200	貸付株式数 2,700株
東京地下鉄	247,000	1,460.00	360,620,000	貸付株式数 167,900株
西武ホールディングス	159,700	3,554.00	567,573,800	貸付株式数

				300株
鴻池運輸	26,400	2,804.00	74,025,600	貸付株式数 400株
西日本鉄道	44,800	3,020.00	135,296,000	
ハマキョウレックス	48,500	1,818.00	88,173,000	
サカイ引越センター	19,600	2,908.00	56,996,800	貸付株式数 13,300株
近鉄グループホールディングス	165,800	3,470.00	575,326,000	貸付株式数 11,100株
阪急阪神ホールディングス	204,300	4,681.00	956,328,300	貸付株式数 12,200株
ＮＡＮＫＡＩ	70,800	2,916.50	206,488,200	
京阪ホールディングス	80,600	3,203.00	258,161,800	貸付株式数 900株
神戸電鉄	4,300	2,420.00	10,406,000	貸付株式数 2,900株
名古屋鉄道	171,200	1,865.50	319,373,600	貸付株式数 88,500株 (28,000株)
山陽電気鉄道	11,600	1,988.00	23,060,800	貸付株式数 7,800株
ヤマトホールディングス	188,200	1,937.50	364,637,500	貸付株式数 1,600株
山九	33,700	8,653.00	291,606,100	
丸全昭和運輸	9,600	7,560.00	72,576,000	貸付株式数 200株
センコーグループホールディングス	112,000	2,103.50	235,592,000	
ニッコンホールディングス	66,000	5,481.00	361,746,000	貸付株式数 2,400株
福山通運	15,900	5,640.00	89,676,000	貸付株式数 1,400株
セイノーホールディングス	76,100	2,672.00	203,339,200	
神奈川中央交通	4,500	3,685.00	16,582,500	貸付株式数 3,000株
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	48,100	843.00	40,548,300	貸付株式数 1,500株
日本郵船	305,500	5,319.00	1,624,954,500	
商船三井	294,700	5,340.00	1,573,698,000	貸付株式数 2,800株
川崎汽船	333,600	2,537.00	846,343,200	
ＮＳユナイテッド海運	9,700	6,900.00	66,930,000	貸付株式数 200株
飯野海運	56,900	1,464.00	83,301,600	貸付株式数 20,500株
九州旅客鉄道	116,600	3,578.00	417,194,800	貸付株式数 1,600株
ＳＧホールディングス	260,100	1,576.00	409,917,600	貸付株式数 1,300株
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	155,100	5,323.00	825,597,300	貸付株式数 100株
日本航空	354,900	2,917.50	1,035,420,750	

ＡＮＡホールディングス	421,500	3,015.00	1,270,822,500	貸付株式数 1,200株
ビーウィズ	4,200	1,585.00	6,657,000	貸付株式数 100株
サンウェルズ	12,100	150.00	1,815,000	
ＴＲＥホールディングス	36,600	2,119.00	77,555,400	貸付株式数 4,100株
人・夢・技術グループ	6,400	1,539.00	9,849,600	
シルバーライフ	4,600	665.00	3,059,000	貸付株式数 400株
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	14,500	3,810.00	55,245,000	貸付株式数 1,900株
コーア商事ホールディングス	14,800	770.00	11,396,000	貸付株式数 300株
ＫＰＰグループホールディングス	42,900	1,036.00	44,444,400	貸付株式数 2,300株
ブックオフグループホールディングス	11,800	2,088.00	24,638,400	貸付株式数 100株
ギフトホールディングス	9,300	4,560.00	42,408,000	貸付株式数 6,300株
三菱倉庫	168,000	1,562.50	262,500,000	貸付株式数 2,300株
三井倉庫ホールディングス	47,900	3,570.00	171,003,000	
住友倉庫	44,400	3,885.00	172,494,000	貸付株式数 2,800株
澁澤倉庫	24,900	1,977.00	49,227,300	貸付株式数 1,300株
ヤマタネ	13,200	2,105.00	27,786,000	貸付株式数 100株
乾汽船	19,600	1,581.00	30,987,600	貸付株式数 3,000株
日本トランスシティ	39,100	1,226.00	47,936,600	貸付株式数 1,900株
中央倉庫	8,400	1,866.00	15,674,400	貸付株式数 5,700株
安田倉庫	10,500	2,471.00	25,945,500	貸付株式数 7,100株
ＮＩＳＳＯホールディングス	13,900	610.00	8,479,000	貸付株式数 9,400株
大栄環境	34,700	3,870.00	134,289,000	貸付株式数 900株
ＧＥＮＯＶＡ	9,400	619.00	5,818,600	貸付株式数 1,000株
日本管財ホールディングス	16,700	2,746.00	45,858,200	
上組	68,000	5,164.00	351,152,000	貸付株式数 1,200株
キユーソー流通システム	8,800	3,170.00	27,896,000	
エーアイテイー	9,800	2,360.00	23,128,000	
ＴＢＳホールディングス	74,700	6,320.00	472,104,000	
日本テレビホールディングス	136,400	2,875.50	392,218,200	
朝日放送グループホールディングス	19,400	833.00	16,160,200	貸付株式数

				13,100株
テレビ朝日ホールディングス	37,800	3,165.00	119,637,000	
スカパーＪＳＡＴ	103,600	2,487.00	257,653,200	貸付株式数 65,200株
テレビ東京ホールディングス	9,600	3,670.00	35,232,000	貸付株式数 400株
ビジョン	32,500	1,014.00	32,955,000	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	52,200	1,713.00	89,418,600	貸付株式数 35,400株
日本通信	125,400	116.00	14,546,400	貸付株式数 1,800株
ＮＴＴ	42,718,700	149.10	6,369,358,170	
ＫＤＤＩ	2,091,200	2,809.50	5,875,226,400	
ソフトバンク	25,013,300	214.60	5,367,854,180	貸付株式数 133,800株
光通信	15,300	37,440.00	572,832,000	貸付株式数 300株
エムティーアイ	10,500	612.00	6,426,000	貸付株式数 400株 (400株)
ＧＭＯインターネットグループ	50,200	3,912.00	196,382,400	貸付株式数 100株
ファイバーゲート	6,000	772.00	4,632,000	貸付株式数 200株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	86,400	3,756.00	324,518,400	貸付株式数 2,900株
学研ホールディングス	25,800	1,019.00	26,290,200	貸付株式数 800株
ゼンリン	23,300	915.00	21,319,500	貸付株式数 200株
東京電力ホールディングス	1,398,300	485.30	678,594,990	貸付株式数 41,600株
中部電力	571,600	2,991.50	1,709,941,400	貸付株式数 200株
関西電力	840,900	2,252.50	1,894,127,250	
中国電力	269,500	910.90	245,487,550	貸付株式数 12,900株
北陸電力	158,600	883.20	140,075,520	貸付株式数 3,800株
東北電力	408,400	1,088.00	444,339,200	
四国電力	144,400	1,470.50	212,340,200	貸付株式数 2,000株
九州電力	357,500	1,692.00	604,890,000	
北海道電力	174,800	952.90	166,566,920	貸付株式数 1,200株
沖縄電力	39,700	909.00	36,087,300	貸付株式数 1,500株 (100株)
電源開発	112,500	3,568.00	401,400,000	
エフオン	11,300	326.00	3,683,800	貸付株式数 700株

イーレックス	31,800	792.00	25,185,600	貸付株式数 2,800株
レノバ	42,300	921.00	38,958,300	貸付株式数 600株
東京瓦斯	252,500	5,905.00	1,491,012,500	
大阪瓦斯	277,100	5,299.00	1,468,352,900	
東邦瓦斯	212,400	1,186.00	251,906,400	貸付株式数 1,600株
北海道瓦斯	46,300	761.00	35,234,300	貸付株式数 5,500株
広島ガス	33,100	414.00	13,703,400	貸付株式数 22,500株
西部ガスホールディングス	17,900	2,295.00	41,080,500	貸付株式数 12,100株
静岡ガス	35,400	1,238.00	43,825,200	貸付株式数 24,000株
メタウォーター	20,500	3,205.00	65,702,500	貸付株式数 400株
クオンツ総研ホールディングス	18,800	862.00	16,205,600	
松竹	8,900	10,820.00	96,298,000	貸付株式数 6,000株
東宝	394,300	1,350.00	532,305,000	貸付株式数 600株
エイチ・アイ・エス	46,300	992.00	45,929,600	貸付株式数 31,400株
東映	25,800	5,640.00	145,512,000	貸付株式数 900株
ラックランド	7,200	1,291.00	9,295,200	
共立メンテナンス	63,600	2,875.00	182,850,000	貸付株式数 43,200株
イチネンホールディングス	15,200	2,260.00	34,352,000	貸付株式数 900株
建設技術研究所	16,400	2,948.00	48,347,200	貸付株式数 1,000株
スペース	11,400	1,433.00	16,336,200	貸付株式数 100株
アインホールディングス	18,500	5,652.00	104,562,000	貸付株式数 12,500株
燦ホールディングス	13,400	1,433.00	19,202,200	
ピー・シー・エー	10,300	1,412.00	14,543,600	貸付株式数 7,000株
スバル興業	5,400	3,570.00	19,278,000	貸付株式数 3,600株
タナベコンサルティンググループ	13,300	752.00	10,001,600	
ビジネスブレイン太田昭和	16,600	1,025.00	17,015,000	
ナガワ	4,400	5,110.00	22,484,000	貸付株式数 800株
東京都競馬	11,500	4,875.00	56,062,500	貸付株式数 7,100株
カナモト	22,600	5,100.00	115,260,000	貸付株式数 400株

ＤＴＳ	123,700	1,066.00	131,864,200	貸付株式数 2,500株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	256,000	2,573.00	658,688,000	貸付株式数 5,800株
シーイーシー	18,800	2,174.00	40,871,200	貸付株式数 700株
カプコン	309,300	3,336.00	1,031,824,800	貸付株式数 6,700株
ニシオホールディングス	13,200	4,000.00	52,800,000	貸付株式数 200株
アイ・エス・ビー	7,300	2,213.00	16,154,900	
日本空港ビルデング	54,100	5,347.00	289,272,700	貸付株式数 1,100株
トランス・コスモス	20,300	3,625.00	73,587,500	貸付株式数 3,300株
乃村工藝社	69,500	1,171.00	81,384,500	貸付株式数 4,000株
藤田観光	31,600	1,885.00	59,566,000	貸付株式数 21,500株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	7,900	1,883.00	14,875,700	
トーカイ	11,400	2,408.00	27,451,200	貸付株式数 400株
セコム	297,800	6,622.00	1,972,031,600	貸付株式数 700株
ＮＳＷ	6,700	2,515.00	16,850,500	貸付株式数 100株
セントラル警備保障	7,700	2,761.00	21,259,700	貸付株式数 200株
アイネス	12,000	2,166.00	25,992,000	貸付株式数 600株 (600株)
丹青社	33,700	1,391.00	46,876,700	
メイテックグループホールディングス	58,800	3,185.00	187,278,000	貸付株式数 1,900株
ＴＫＣ	24,000	3,580.00	85,920,000	貸付株式数 200株
応用地質	14,200	2,758.00	39,163,600	貸付株式数 2,600株
船井総研ホールディングス	63,900	1,111.00	70,992,900	貸付株式数 39,200株
ＮＳＤ	55,000	2,674.00	147,070,000	貸付株式数 100株
コナミグループ	66,600	18,535.00	1,234,431,000	貸付株式数 100株
学究社	6,300	2,555.00	16,096,500	貸付株式数 200株
ナック	16,300	531.00	8,655,300	貸付株式数 11,000株
福井コンピュータホールディングス	8,400	3,200.00	26,880,000	貸付株式数 100株
ダイセキ	30,700	3,960.00	121,572,000	

ステップ	5,900	2,240.00	13,216,000	
泉州電業	10,400	6,320.00	65,728,000	貸付株式数 7,000株
ＧＥＮＫＩ　ＧＬＯＢＡＬ　ＤＩＮＩＮＧ　ＣＯＮＣＥＰＴＳ	9,300	3,330.00	30,969,000	貸付株式数 6,300株
トラスコ中山	34,400	2,318.00	79,739,200	貸付株式数 300株
ヤマダホールディングス	504,800	662.50	334,430,000	貸付株式数 343,200株
オートバックスセブン	57,100	1,486.00	84,850,600	貸付株式数 100株
モリト	11,500	1,767.00	20,320,500	貸付株式数 300株
アークランズ	48,800	1,860.00	90,768,000	貸付株式数 33,200株
ニトリホールディングス	265,400	2,397.00	636,163,800	貸付株式数 100株
グルメ杵屋	13,400	966.00	12,944,400	貸付株式数 1,300株
ケーユーホールディングス	11,400	1,171.00	13,349,400	貸付株式数 200株
吉野家ホールディングス	60,400	3,586.00	216,594,400	貸付株式数 41,000株
加藤産業	20,300	6,110.00	124,033,000	
イノテック	10,400	3,490.00	36,296,000	
イエローハット	39,900	1,813.00	72,338,700	貸付株式数 800株
松屋フーズホールディングス	7,700	4,965.00	38,230,500	貸付株式数 600株
ＪＢＣＣホールディングス	41,400	1,404.00	58,125,600	貸付株式数 400株
ＪＫホールディングス	10,900	1,460.00	15,914,000	
サガミホールディングス	26,400	1,756.00	46,358,400	貸付株式数 18,300株 (400株)
日伝	9,200	2,707.00	24,904,400	貸付株式数 6,200株
ミロク情報サービス	13,200	1,800.00	23,760,000	貸付株式数 100株
杉本商事	13,200	1,249.00	16,486,800	貸付株式数 500株
因幡電機産業	85,700	2,705.00	231,818,500	貸付株式数 400株
王将フードサービス	33,900	2,926.00	99,191,400	貸付株式数 23,000株
ミニストップ	11,800	1,841.00	21,723,800	貸付株式数 8,000株
アークス	27,400	3,495.00	95,763,000	貸付株式数 18,600株
バローホールディングス	31,400	3,285.00	103,149,000	貸付株式数 19,000株

東テク	18,300	4,040.00	73,932,000	
ミスミグループ本社	231,600	3,872.00	896,755,200	貸付株式数 3,600株
ベルク	7,200	6,380.00	45,936,000	貸付株式数 4,800株
大　庄	11,100	1,095.00	12,154,500	
ファーストリテイリング	110,600	81,230.00	8,984,038,000	貸付株式数 200株
ソフトバンクグループ	2,982,100	6,364.00	18,978,084,400	貸付株式数 186,800株 (180,900株)
スズケン	54,500	4,910.00	267,595,000	
サンドラッグ	48,400	3,821.00	184,936,400	
サックスバー　ホールディングス	14,100	759.00	10,701,900	貸付株式数 9,500株
ジェコス	11,700	1,569.00	18,357,300	貸付株式数 200株
ベルーナ	39,600	1,058.00	41,896,800	貸付株式数 26,900株
合計	327,052,600		867,739,556,230	

（注）貸付株式数のうち（括弧書）の数値は、委託者の利害関係人であるみずほ証券株式会社に対する貸付であります。

（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。

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7月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	381,326,349
コール・ローン	1,010,029,930
国債証券	261,445,871,191
派生商品評価勘定	748,736,563
未収入金	1,209,791,135
未収利息	2,261,489,166
前払費用	375,952,660
流動資産合計	267,433,196,994
資産合計	267,433,196,994
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	181,299,420
未払金	1,608,501
未払解約金	1,727,868,000
流動負債合計	1,910,775,921
負債合計	1,910,775,921
純資産の部	
元本等	
元本	232,670,434,383
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	32,851,986,690
元本等合計	265,522,421,073
純資産合計	265,522,421,073
負債純資産合計	267,433,196,994

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年7月13日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	233,867,531,404円
同期中追加設定元本額	62,808,652,070円
同期中一部解約元本額	64,005,749,091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＞	14,207,189,719円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	2,076,928,399円
たわらノーロード　バランス（標準型）	8,229,506,022円
たわらノーロード　バランス（積極型）	5,586,424,844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）	72,592,488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）	2,344,878,484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）	3,152,522,489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）	350,599,990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）	1,702,253円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	33,859,267円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	288,316,124円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	41,182,439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）	191,971,404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
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～１９７２年生まれ向け）	18,467,451円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７３～１９７７年生まれ向け）	5,813,708円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７８～１９８２年生まれ向け）	2,442,754円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８３～１９８７年生まれ向け）	969,549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）	24,448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	69,854,351,680円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	15,773,854,240円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	17,898,890,219円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	29,013,887,895円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,547,243,862円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,698,707,963円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,440,147,886円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	698,516,060円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	200,311,743円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	5,432,511,098円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	9,569,947,131円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	7,931,552,173円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	2,223,562,849円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	816,828,132円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	457,425,762円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	204,093,669円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	3,023,240円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	8,052,834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）	19,091,989,086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）	8,106,940,061円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	335,106,270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）	49,740,673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）	241,574,425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）	29,272,795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）	143,877,786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）	269,637,517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）	353,427,420円
計	232,670,434,383円
２．　受益権の総数	232,670,434,383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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2．	金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3．	金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
1．	貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．	時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3．	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,183,525,766
合計	△1,183,525,766

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	268,193,091,635	－	267,625,654,492	567,437,143
アメリカ・ドル	120,398,228,466	－	120,207,955,663	190,272,803
イギリス・ポンド	15,440,713,127	－	15,538,306,006	△97,592,879
イスラエル・シュケル	1,200,538,710	－	1,183,405,860	17,132,850
オーストラリア・ドル	3,438,853,605	－	3,437,428,752	1,424,853
オフショア・人民元	33,914,365,376	－	33,835,693,868	78,671,508
カナダ・ドル	5,588,147,065	－	5,583,361,346	4,785,719
シンガポール・ドル	990,440,369	－	988,033,867	2,406,502
スウェーデン・クローナ	500,327,037	－	498,054,829	2,272,208
デンマーク・クローネ	546,733,099	－	543,860,272	2,872,827
ニュージーランド・ドル	750,468,918	－	757,196,493	△6,727,575
ノルウェー・クローネ	426,536,370	－	430,454,590	△3,918,220
ポーランド・ズロチ	2,027,866,965	－	2,000,359,703	27,507,262
マレーシア・リンギット	1,289,644,310	－	1,286,383,662	3,260,648
メキシコ・ペソ	2,317,999,880	－	2,309,855,380	8,144,500
ユーロ	76,897,613,532	－	76,488,185,467	409,428,065
韓国・ウォン	2,464,614,806	－	2,537,118,734	△72,503,928
合計	268,193,091,635	－	267,625,654,492	567,437,143

（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7月13日現在
1口当たり純資産額	1.1412円
（1万口当たり純資産額）	（11,412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7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.375 07/31/27	2,600,000.000	2,500,064.730	
		US T N/B 0.375 09/30/27	2,820,000.000	2,694,862.500	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,500,000.000	2,415,364.750	
		US T N/B 0.5 08/31/27	2,900,000.000	2,783,830.080	
		US T N/B 0.5 10/31/27	1,300,000.000	1,240,103.510	
		US T N/B 0.625 05/15/30	1,690,000.000	1,473,534.760	
		US T N/B 0.625 08/15/30	4,690,000.000	4,052,453.120	
		US T N/B 0.625 11/30/27	2,200,000.000	2,095,929.670	
		US T N/B 0.625 12/31/27	2,860,000.000	2,716,553.120	
		US T N/B 0.75 01/31/28	870,000.000	825,344.530	
		US T N/B 0.875 11/15/30	2,690,000.000	2,329,949.790	
		US T N/B 1.0 07/31/28	7,770,000.000	7,283,768.000	
		US T N/B 1.125 02/15/31	4,000,000.000	3,479,687.520	
		US T N/B 1.125 02/29/28	1,520,000.000	1,446,909.370	
		US T N/B 1.125 05/15/40	1,500,000.000	934,892.580	
		US T N/B 1.125 08/15/40	1,060,000.000	653,846.090	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,970,000.000	3,721,564.860	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,500,000.000	3,330,195.330	
		US T N/B 1.25 04/30/28	2,600,000.000	2,467,917.970	
		US T N/B 1.25 05/15/50	2,700,000.000	1,256,449.200	
		US T N/B 1.25 05/31/28	3,140,000.000	2,973,187.500	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,570,000.000	3,372,464.640	
		US T N/B 1.25 08/15/31	7,000,000.000	6,026,972.630	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,250,000.000	3,047,319.340	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,300,000.000	2,062,908.180	
		US T N/B 1.375 10/31/28	2,300,000.000	2,157,462.880	
		US T N/B 1.375 11/15/31	2,800,000.000	2,408,164.050	
		US T N/B 1.375 11/15/40	1,730,000.000	1,101,354.480	
		US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	3,268,261.710	
		US T N/B 1.5 02/15/30	1,500,000.000	1,363,828.120	
		US T N/B 1.5 11/30/28	3,840,000.000	3,604,724.990	
		US T N/B 1.625 05/15/31	2,950,000.000	2,607,465.820	
		US T N/B 1.625 08/15/29	1,200,000.000	1,110,421.870	
		US T N/B 1.625 11/15/50	2,400,000.000	1,227,562.500	
		US T N/B 1.75 01/31/29	1,600,000.000	1,504,656.250	
		US T N/B 1.75 08/15/41	500,000.000	329,843.750	
		US T N/B 1.75 11/15/29	3,000,000.000	2,769,960.930	
		US T N/B 1.875 02/15/32	4,780,000.000	4,198,184.370	
		US T N/B 1.875 02/15/41	2,900,000.000	1,981,912.100	
		US T N/B 1.875 02/15/51	2,000,000.000	1,087,968.760	
		US T N/B 1.875 02/28/29	2,600,000.000	2,448,824.220	
		US T N/B 1.875 11/15/51	2,500,000.000	1,343,945.300	
		US T N/B 2.0 02/15/50	1,000,000.000	570,742.190	
		US T N/B 2.0 08/15/51	1,300,000.000	724,572.260	
		US T N/B 2.0 11/15/41	1,200,000.000	817,945.300	
		US T N/B 2.25 02/15/52	3,370,000.000	1,986,062.110	

		US T N/B 2.25 05/15/41	1,000,000.000	718,066.400	
		US T N/B 2.25 08/15/27	2,900,000.000	2,841,660.140	
		US T N/B 2.25 08/15/46	3,500,000.000	2,240,410.160	
		US T N/B 2.25 08/15/49	2,890,000.000	1,761,771.100	
		US T N/B 2.25 11/15/27	2,140,000.000	2,086,667.170	
		US T N/B 2.375 02/15/42	1,000,000.000	717,714.840	
		US T N/B 2.375 03/31/29	2,200,000.000	2,095,800.780	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,320,000.000	3,156,658.580	
		US T N/B 2.375 05/15/51	1,180,000.000	722,680.860	
		US T N/B 2.375 11/15/49	2,880,000.000	1,798,312.480	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,110,000.000	1,452,850.390	
		US T N/B 2.5 02/15/46	900,000.000	609,117.190	
		US T N/B 2.5 05/15/46	800,000.000	539,296.870	
		US T N/B 2.625 02/15/29	1,400,000.000	1,345,285.150	
		US T N/B 2.625 07/31/29	7,600,000.000	7,252,210.920	
		US T N/B 2.75 02/15/28	2,200,000.000	2,151,187.500	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,900,000.000	3,743,847.660	
		US T N/B 2.75 07/31/27	2,150,000.000	2,119,349.530	
		US T N/B 2.75 08/15/32	3,580,000.000	3,270,805.450	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,080,000.000	811,982.810	
		US T N/B 2.75 08/15/47	1,300,000.000	902,078.120	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,500,000.000	1,121,367.180	
		US T N/B 2.75 11/15/47	800,000.000	553,374.990	
		US T N/B 2.875 04/30/29	3,150,000.000	3,037,965.800	
		US T N/B 2.875 05/15/28	3,440,000.000	3,359,375.000	
		US T N/B 2.875 05/15/32	2,500,000.000	2,309,765.620	
		US T N/B 2.875 05/15/43	1,590,000.000	1,200,015.230	
		US T N/B 2.875 05/15/49	2,700,000.000	1,881,087.890	
		US T N/B 2.875 05/15/52	3,900,000.000	2,643,849.610	
		US T N/B 2.875 08/15/28	2,900,000.000	2,822,798.830	
		US T N/B 2.875 08/15/45	500,000.000	364,453.120	
		US T N/B 2.875 11/15/46	2,550,000.000	1,828,529.270	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,390,000.000	1,015,514.450	
		US T N/B 3.0 02/15/48	1,700,000.000	1,228,316.400	
		US T N/B 3.0 02/15/49	2,100,000.000	1,502,320.290	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,200,000.000	940,125.000	
		US T N/B 3.0 05/15/45	2,500,000.000	1,868,066.400	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,200,000.000	874,406.250	
		US T N/B 3.0 08/15/48	2,010,000.000	1,444,844.520	
		US T N/B 3.0 08/15/52	3,200,000.000	2,223,375.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,500,000.000	1,127,109.370	
		US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	741,914.060	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,000,000.000	800,546.880	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,260,000.000	991,068.750	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,220,000.000	1,636,903.120	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,000,000.000	1,538,281.240	
		US T N/B 3.125 08/31/29	3,000,000.000	2,902,148.430	
		US T N/B 3.125 11/15/28	3,210,000.000	3,132,069.730	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,280,000.000	1,029,699.980	
		US T N/B 3.25 05/15/42	1,550,000.000	1,256,680.660	

		US T N/B 3.25 06/30/27	3,390,000.000	3,362,612.890	
		US T N/B 3.25 06/30/29	1,000,000.000	972,636.720	
		US T N/B 3.375 02/29/28	7,000,000.000	6,910,039.080	
		US T N/B 3.375 05/15/33	2,900,000.000	2,722,261.720	
		US T N/B 3.375 05/15/44	1,800,000.000	1,443,164.050	
		US T N/B 3.375 08/15/42	2,300,000.000	1,889,144.530	
		US T N/B 3.375 09/15/28	5,600,000.000	5,502,218.730	
		US T N/B 3.375 11/15/48	2,550,000.000	1,957,125.000	
		US T N/B 3.5 01/15/29	5,200,000.000	5,109,812.500	
		US T N/B 3.5 01/31/28	5,900,000.000	5,838,003.920	
		US T N/B 3.5 01/31/30	1,500,000.000	1,462,558.590	
		US T N/B 3.5 02/15/29	4,500,000.000	4,419,492.210	
		US T N/B 3.5 02/15/33	1,600,000.000	1,517,624.990	
		US T N/B 3.5 02/15/39	700,000.000	622,125.000	
		US T N/B 3.5 02/28/31	2,000,000.000	1,934,062.500	
		US T N/B 3.5 03/15/29	2,200,000.000	2,159,781.250	
		US T N/B 3.5 04/30/28	2,800,000.000	2,765,656.260	
		US T N/B 3.5 04/30/30	1,900,000.000	1,849,197.260	
		US T N/B 3.5 09/30/27	1,000,000.000	992,167.970	
		US T N/B 3.5 09/30/29	2,700,000.000	2,639,935.550	
		US T N/B 3.5 10/15/28	2,800,000.000	2,756,359.360	
		US T N/B 3.5 10/31/27	2,000,000.000	1,982,968.760	
		US T N/B 3.5 11/15/28	2,800,000.000	2,754,828.130	
		US T N/B 3.5 11/30/30	3,400,000.000	3,293,085.940	
		US T N/B 3.5 12/15/28	2,000,000.000	1,966,640.620	
		US T N/B 3.625 02/15/44	2,000,000.000	1,666,562.500	
		US T N/B 3.625 02/15/53	4,350,000.000	3,410,077.130	
		US T N/B 3.625 03/31/28	3,000,000.000	2,970,937.500	
		US T N/B 3.625 03/31/30	2,600,000.000	2,542,820.300	
		US T N/B 3.625 05/15/53	3,880,000.000	3,038,828.100	
		US T N/B 3.625 05/31/28	2,650,000.000	2,621,895.490	
		US T N/B 3.625 08/15/28	1,600,000.000	1,581,093.740	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,800,000.000	1,508,695.300	
		US T N/B 3.625 08/31/27	200,000.000	198,835.930	
		US T N/B 3.625 08/31/29	2,000,000.000	1,963,789.060	
		US T N/B 3.625 08/31/30	2,300,000.000	2,242,769.530	
		US T N/B 3.625 09/30/30	2,300,000.000	2,241,871.080	
		US T N/B 3.625 09/30/31	2,500,000.000	2,419,091.800	
		US T N/B 3.625 10/31/30	7,200,000.000	7,013,250.000	
		US T N/B 3.625 12/31/30	1,600,000.000	1,556,624.990	
		US T N/B 3.75 01/31/31	3,700,000.000	3,616,750.000	
		US T N/B 3.75 02/28/33	2,000,000.000	1,925,468.760	
		US T N/B 3.75 04/15/28	3,000,000.000	2,976,679.680	
		US T N/B 3.75 05/15/28	3,500,000.000	3,471,425.790	
		US T N/B 3.75 05/31/30	2,200,000.000	2,159,093.750	
		US T N/B 3.75 06/30/27	5,500,000.000	5,481,134.890	
		US T N/B 3.75 06/30/30	2,500,000.000	2,452,148.450	
		US T N/B 3.75 08/15/27	3,200,000.000	3,186,249.980	
		US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	876,093.750	
		US T N/B 3.75 08/31/31	3,500,000.000	3,408,398.420	

		US T N/B 3.75 10/31/32	1,500,000.000	1,447,558.590	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	850,507.810	
		US T N/B 3.75 11/30/32	3,000,000.000	2,893,652.340	
		US T N/B 3.75 12/31/28	3,200,000.000	3,164,062.490	
		US T N/B 3.75 12/31/30	2,390,000.000	2,337,111.900	
		US T N/B 3.875 02/15/43	2,500,000.000	2,180,322.270	
		US T N/B 3.875 03/15/28	1,000,000.000	994,726.560	
		US T N/B 3.875 03/31/31	4,000,000.000	3,927,812.480	
		US T N/B 3.875 04/15/29	4,500,000.000	4,458,164.040	
		US T N/B 3.875 04/30/30	3,900,000.000	3,846,527.330	
		US T N/B 3.875 04/30/31	2,500,000.000	2,454,101.550	
		US T N/B 3.875 05/15/29	4,000,000.000	3,962,031.240	
		US T N/B 3.875 05/15/43	1,900,000.000	1,652,851.570	
		US T N/B 3.875 06/15/28	2,500,000.000	2,484,472.640	
		US T N/B 3.875 06/30/30	3,900,000.000	3,843,480.450	
		US T N/B 3.875 07/15/28	4,400,000.000	4,370,781.270	
		US T N/B 3.875 07/31/27	5,000,000.000	4,986,067.850	
		US T N/B 3.875 07/31/30	3,000,000.000	2,955,234.360	
		US T N/B 3.875 08/15/33	5,100,000.000	4,928,373.060	
		US T N/B 3.875 08/15/34	3,500,000.000	3,355,625.000	
		US T N/B 3.875 08/15/40	600,000.000	540,105.460	
		US T N/B 3.875 08/31/32	4,200,000.000	4,087,535.170	
		US T N/B 3.875 09/30/29	2,500,000.000	2,472,119.150	
		US T N/B 3.875 09/30/32	5,500,000.000	5,348,857.410	
		US T N/B 3.875 11/30/29	2,100,000.000	2,074,898.440	
		US T N/B 3.875 12/31/27	2,800,000.000	2,787,312.500	
		US T N/B 3.875 12/31/29	2,500,000.000	2,469,287.100	
		US T N/B 3.875 12/31/32	2,500,000.000	2,427,490.220	
		US T N/B 4.0 01/31/29	3,600,000.000	3,579,398.420	
		US T N/B 4.0 01/31/31	1,500,000.000	1,481,484.370	
		US T N/B 4.0 01/31/33	4,000,000.000	3,909,140.640	
		US T N/B 4.0 02/15/34	5,500,000.000	5,337,578.110	
		US T N/B 4.0 02/28/30	5,100,000.000	5,055,673.800	
		US T N/B 4.0 02/29/28	3,100,000.000	3,090,009.750	
		US T N/B 4.0 03/31/30	2,000,000.000	1,981,757.820	
		US T N/B 4.0 04/30/32	2,000,000.000	1,963,710.940	
		US T N/B 4.0 05/31/30	2,000,000.000	1,980,585.940	
		US T N/B 4.0 06/30/28	2,800,000.000	2,788,898.440	
		US T N/B 4.0 06/30/32	2,000,000.000	1,961,835.940	
		US T N/B 4.0 07/31/29	1,210,000.000	1,201,775.770	
		US T N/B 4.0 07/31/30	2,500,000.000	2,474,121.100	
		US T N/B 4.0 07/31/32	3,000,000.000	2,941,054.680	
		US T N/B 4.0 10/31/29	2,400,000.000	2,381,390.610	
		US T N/B 4.0 11/15/35	5,100,000.000	4,890,421.870	
		US T N/B 4.0 11/15/42	2,500,000.000	2,221,826.170	
		US T N/B 4.0 11/15/52	4,170,000.000	3,498,890.620	
		US T N/B 4.0 12/15/27	1,500,000.000	1,496,132.820	
		US T N/B 4.125 02/15/36	8,800,000.000	8,509,875.000	
		US T N/B 4.125 02/29/32	2,500,000.000	2,472,900.400	
		US T N/B 4.125 03/31/29	5,000,000.000	4,985,644.550	

		US T N/B 4.125 03/31/31	1,753,000.000	1,739,510.110	
		US T N/B 4.125 03/31/32	3,700,000.000	3,657,796.870	
		US T N/B 4.125 04/30/33	1,000,000.000	983,125.000	
		US T N/B 4.125 05/31/32	2,700,000.000	2,666,935.540	
		US T N/B 4.125 06/15/29	5,000,000.000	4,984,960.950	
		US T N/B 4.125 06/30/28	2,500,000.000	2,496,240.220	
		US T N/B 4.125 07/31/28	2,600,000.000	2,595,531.240	
		US T N/B 4.125 07/31/31	3,000,000.000	2,974,453.140	
		US T N/B 4.125 08/15/44	2,000,000.000	1,778,789.050	
		US T N/B 4.125 08/15/53	3,950,000.000	3,383,344.720	
		US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,484,716.800	
		US T N/B 4.125 09/30/27	2,580,000.000	2,578,891.390	
		US T N/B 4.125 10/31/27	1,500,000.000	1,499,003.910	
		US T N/B 4.125 10/31/29	4,000,000.000	3,984,140.640	
		US T N/B 4.125 10/31/31	2,500,000.000	2,476,025.400	
		US T N/B 4.125 11/15/27	2,800,000.000	2,797,648.440	
		US T N/B 4.125 11/15/32	4,200,000.000	4,139,625.000	
		US T N/B 4.125 11/30/29	6,000,000.000	5,975,742.180	
		US T N/B 4.125 11/30/31	2,500,000.000	2,475,244.150	
		US T N/B 4.25 01/15/28	3,000,000.000	3,001,875.000	
		US T N/B 4.25 01/31/30	3,700,000.000	3,698,265.620	
		US T N/B 4.25 02/15/28	2,000,000.000	2,001,328.120	
		US T N/B 4.25 02/15/54	3,800,000.000	3,324,332.030	
		US T N/B 4.25 02/28/29	2,500,000.000	2,501,269.520	
		US T N/B 4.25 02/28/31	2,400,000.000	2,395,078.120	
		US T N/B 4.25 03/31/33	2,000,000.000	1,981,757.820	
		US T N/B 4.25 05/15/35	4,800,000.000	4,705,406.240	
		US T N/B 4.25 05/15/39	600,000.000	572,531.250	
		US T N/B 4.25 05/31/33	5,500,000.000	5,445,859.370	
		US T N/B 4.25 06/30/29	2,900,000.000	2,900,736.330	
		US T N/B 4.25 06/30/31	2,500,000.000	2,492,968.750	
		US T N/B 4.25 08/15/35	5,000,000.000	4,895,214.840	
		US T N/B 4.25 08/15/54	4,700,000.000	4,113,050.790	
		US T N/B 4.25 11/15/34	8,300,000.000	8,156,046.870	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	936,074.220	
		US T N/B 4.375 01/31/32	2,500,000.000	2,504,003.900	
		US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	588,421.860	
		US T N/B 4.375 05/15/34	4,100,000.000	4,073,333.960	
		US T N/B 4.375 05/15/36	3,500,000.000	3,448,320.330	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,300,000.000	1,240,789.050	
		US T N/B 4.375 05/15/41	300,000.000	283,511.710	
		US T N/B 4.375 07/15/27	2,400,000.000	2,405,692.620	
		US T N/B 4.375 08/15/43	2,700,000.000	2,499,134.760	
		US T N/B 4.375 08/31/28	2,500,000.000	2,507,666.020	
		US T N/B 4.375 11/15/39	760,000.000	728,946.860	
		US T N/B 4.375 11/30/28	2,700,000.000	2,708,701.180	
		US T N/B 4.375 11/30/30	2,600,000.000	2,608,023.440	
		US T N/B 4.375 12/31/29	4,100,000.000	4,115,455.070	
		US T N/B 4.5 02/15/36	2,630,000.000	2,638,835.150	
		US T N/B 4.5 02/15/44	1,000,000.000	937,070.310	

		US T N/B 4.5 05/31/29	3,000,000.000	3,020,917.980	
		US T N/B 4.5 08/15/39	1,330,000.000	1,295,762.880	
		US T N/B 4.5 11/15/33	6,100,000.000	6,121,207.010	
		US T N/B 4.5 11/15/54	5,600,000.000	5,109,015.620	
		US T N/B 4.5 12/31/31	2,500,000.000	2,519,775.400	
		US T N/B 4.625 02/15/35	7,600,000.000	7,661,601.570	
		US T N/B 4.625 02/15/40	900,000.000	883,863.270	
		US T N/B 4.625 02/15/46	2,500,000.000	2,359,960.950	
		US T N/B 4.625 02/15/55	2,500,000.000	2,329,052.720	
		US T N/B 4.625 04/30/29	3,500,000.000	3,535,751.940	
		US T N/B 4.625 04/30/31	2,100,000.000	2,128,669.910	
		US T N/B 4.625 05/15/44	1,000,000.000	950,527.340	
		US T N/B 4.625 05/15/54	4,500,000.000	4,191,064.470	
		US T N/B 4.625 05/31/31	5,500,000.000	5,574,658.210	
		US T N/B 4.625 09/30/28	1,500,000.000	1,512,509.760	
		US T N/B 4.625 09/30/30	2,500,000.000	2,532,421.870	
		US T N/B 4.625 11/15/44	1,400,000.000	1,327,210.930	
		US T N/B 4.625 11/15/45	5,500,000.000	5,195,351.590	
		US T N/B 4.625 11/15/55	1,500,000.000	1,398,398.430	
		US T N/B 4.75 02/15/41	1,400,000.000	1,381,789.060	
		US T N/B 4.75 02/15/45	2,200,000.000	2,117,371.100	
		US T N/B 4.75 02/15/56	2,300,000.000	2,189,851.560	
		US T N/B 4.75 05/15/55	2,700,000.000	2,566,951.180	
		US T N/B 4.75 08/15/55	2,400,000.000	2,282,437.480	
		US T N/B 4.75 11/15/43	2,500,000.000	2,420,263.670	
		US T N/B 4.75 11/15/53	4,230,000.000	4,014,203.920	
		US T N/B 4.875 08/15/45	1,000,000.000	976,269.530	
		US T N/B 4.875 10/31/28	9,300,000.000	9,429,509.750	
		US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,556,494.150	
		US T N/B 5.0 05/15/37	300,000.000	311,783.200	
		US T N/B 5.0 05/15/45	1,000,000.000	992,363.280	
		US T N/B 5.0 05/15/56	300,000.000	297,164.060	
		US T N/B 5.25 11/15/28	2,100,000.000	2,148,234.370	
		US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,046,015.620	
		US T N/B 6.125 11/15/27	2,500,000.000	2,563,867.200	
		US T N/B 6.25 05/15/30	2,600,000.000	2,780,781.250	
アメリカ・ドル　小計			780,773,000.000 (126,586,726,490)	726,177,430.450 (117,735,146,800)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 0.125 01/31/28	930,000.000	876,948.040	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,250,000.000	1,836,100.860	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,752,000.000	1,486,441.610	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,650,000.000	1,504,456.180	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	870,000.000	202,916.250	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,350,000.000	937,279.300	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	780,000.000	269,057.930	

		UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,070,000.000	478,520.220	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,530,000.000	1,186,038.370	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,550,000.000	1,391,855.220	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	1,200,000.000	996,368.420	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,720,000.000	1,087,046.190	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	870,000.000	248,698.760	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,410,000.000	1,370,605.580	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	780,000.000	323,743.920	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,230,000.000	712,066.610	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	950,000.000	473,757.820	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	2,800,000.000	1,199,506.020	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,750,000.000	1,654,386.650	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,200,000.000	524,598.780	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	900,000.000	460,447.100	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	950,000.000	414,770.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,050,000.000	758,066.160	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,070,000.000	553,840.490	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,300,000.000	976,040.000	
		UK TREASURY 3.25 01/31/33	1,700,000.000	1,572,186.140	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,000,000.000	769,300.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	400,000.000	268,756.830	
		UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,050,000.000	926,730.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,120,000.000	837,706.500	
		UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,670,000.000	1,234,574.390	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	970,000.000	739,674.990	
		UK TREASURY 4.0 05/22/29	1,000,000.000	991,924.700	
		UK TREASURY 4.0 10/22/31	2,050,000.000	2,006,126.520	
		UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,050,000.000	792,576.640	
		UK TREASURY 4.125 03/07/31	1,000,000.000	987,852.650	
		UK TREASURY 4.125 03/07/33	1,200,000.000	1,167,525.360	
		UK TREASURY 4.125	2,490,000.000	2,476,732.150	

	07/22/29			
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,600,000.000	1,519,096.670	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,020,000.000	1,008,679.680	
	UK TREASURY 4.25 07/31/34	1,600,000.000	1,547,029.880	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	837,844.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,090,000.000	1,092,340.550	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,040,000.000	933,388.630	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	730,000.000	616,786.790	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	950,000.000	787,399.900	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	822,119.330	
	UK TREASURY 4.375 01/31/40	1,650,000.000	1,512,956.640	
	UK TREASURY 4.375 03/07/28	2,220,000.000	2,225,301.130	
	UK TREASURY 4.375 03/07/30	1,300,000.000	1,301,166.620	
	UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,500,000.000	1,236,750.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/35	2,630,000.000	2,571,413.070	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,230,000.000	1,235,891.570	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,750,000.000	1,722,302.400	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	880,000.000	795,344.000	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,030,000.000	1,025,086.710	
	UK TREASURY 4.625 03/07/37	1,300,000.000	1,257,750.000	
	UK TREASURY 4.75 10/22/35	1,350,000.000	1,336,932.000	
	UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,990,000.000	1,833,893.560	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	1,729,984.080	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,130,000.000	1,090,450.000	
	UK TREASURY 4.875 07/31/36	930,000.000	923,955.000	
	UK TREASURY 5.25 01/31/41	800,000.000	796,296.400	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,100,000.000	1,146,851.860	
イギリス・ポンド　小計		84,072,000.000 (18,236,057,520)	69,602,233.820 (15,097,420,538)	
イスラエル・	ISRAEL FIXED BOND	1,450,000.000	1,463,709.750	

	シュケル	02/28/29			
		ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	2,960,000.000	3,026,490.480	
		ISRAEL FIXED BOND 07/31/28	1,300,000.000	1,319,384.300	
		ISRAEL FIXED BOND 07/31/31	1,000,000.000	1,014,192.000	
		ISRAEL FIXED BOND 08/31/29	1,500,000.000	1,553,683.500	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,810,000.000	1,661,078.630	
		ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,490,000.000	1,321,047.410	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,655,000.000	2,109,641.760	
		ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,620,000.000	1,229,779.260	
		ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,300,000.000	1,269,798.400	
		ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,820,000.000	1,717,392.040	
		ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	2,000,000.000	2,012,088.000	
		ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,475,000.000	1,729,536.320	
	イスラエル・シュケル　小計		22,380,000.000 (1,202,716,866)	21,427,821.850 (1,151,546,146)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,190,000.000	993,685.700	
		AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	730,000.000	629,741.800	
		AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,580,000.000	1,315,065.600	
		AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,390,000.000	2,078,439.600	
		AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,010,000.000	508,615.800	
		AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,100,000.000	1,773,933.000	
		AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	900,000.000	865,134.000	
		AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,890,000.000	1,762,595.100	
		AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	800,000.000	607,000.000	
		AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	2,000,000.000	1,704,500.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,260,000.000	1,231,511.400	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,200,000.000	1,155,432.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,670,000.000	1,583,928.200	
		AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	770,000.000	549,972.500	
		AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,150,000.000	1,031,561.500	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,600,000.000	1,551,536.000	
		AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	920,000.000	767,804.400	
		AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,780,000.000	1,625,389.200	
		AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	800,000.000	724,256.000	
		AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,370,000.000	1,284,046.200	
		AUSTRALIAN 4.25 03/21/36	1,080,000.000	1,031,518.800	
		AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	580,000.000	562,037.400	

	AUSTRALIAN 4.25 10/21/36	750,000.000	713,152.500	
	AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	1,360,000.000	1,301,737.600	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	960,000.000	953,520.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	670,000.000	609,110.400	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/37	1,360,000.000	1,341,381.600	
オーストラリア・ドル　小計		33,870,000.000 (3,808,342,800)	30,256,606.300 (3,402,052,812)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.32 02/25/29	22,000,000.000	22,040,829.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.4 11/25/28	17,000,000.000	17,050,116.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28	53,000,000.000	53,195,532.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27	10,000,000.000	10,034,142.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30	46,000,000.000	46,123,137.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	30,000,000.000	30,135,786.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28	42,000,000.000	42,205,556.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.49 12/25/31	20,500,000.000	20,515,063.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.54 01/25/31	35,000,000.000	35,173,729.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.55 07/25/30	5,000,000.000	5,038,270.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.56 06/15/33	8,000,000.000	8,000,376.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35	38,000,000.000	37,858,009.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	63,500,000.000	63,821,024.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30	36,000,000.000	36,340,070.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.65 05/15/35	9,000,000.000	8,980,839.450	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 03/25/33	5,000,000.000	5,036,353.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 12/25/32	5,000,000.000	5,035,560.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 05/25/35	10,000,000.000	10,004,358.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.72 05/15/36	12,000,000.000	11,981,213.760	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.74 10/15/29	18,000,000.000	18,230,392.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.75 02/25/36	14,000,000.000	14,019,537.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32	39,000,000.000	39,621,110.100	

		CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 11/15/35	11,000,000.000	11,052,598.700	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32	43,000,000.000	43,707,840.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.83 08/25/35	12,000,000.000	12,114,158.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	12,500,000.000	12,767,110.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	11,000,000.000	11,199,109.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.92 01/15/55	13,000,000.000	12,095,054.660	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 11/25/34	20,000,000.000	20,638,636.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	29,000,000.000	29,617,772.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	30,000,000.000	31,129,650.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	39,000,000.000	40,302,701.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	28,500,000.000	29,928,685.050	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	7,000,000.000	7,275,683.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	26,500,000.000	27,979,182.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	13,000,000.000	13,361,286.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.38 01/15/56	3,500,000.000	3,586,344.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	15,000,000.000	15,229,915.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	7,500,000.000	7,708,737.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,500,000.000	20,768,068.250	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	5,000,000.000	5,328,903.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	22,500,000.000	23,612,463.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	20,500,000.000	21,117,072.550	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,500,000.000	15,445,426.100	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	11,000,000.000	11,546,247.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	10,500,000.000	10,776,020.850	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	12,220,000.000	12,816,959.220	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,590,000.000	7,908,876.390	

		2.62 09/25/29			
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	28,100,000.000	30,296,585.430	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	39,000,000.000	40,896,870.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	10,500,000.000	11,204,796.750	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	5,000,000.000	5,350,077.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	8,400,000.000	8,769,400.080	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	2,300,000.000	2,467,252.780	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	8,000,000.000	8,403,586.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	13,000,000.000	13,563,200.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	29,500,000.000	31,106,251.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	3,000,000.000	3,240,189.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	15,000,000.000	16,331,926.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	7,000,000.000	7,532,501.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	42,000,000.000	43,727,002.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	13,500,000.000	15,648,867.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	12,000,000.000	12,441,475.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	4,000,000.000	4,319,622.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	6,800,000.000	7,975,414.680	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	7,600,000.000	9,032,175.160	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	13,500,000.000	13,956,343.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	6,900,000.000	8,350,482.810	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	19,000,000.000	22,952,286.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	9,000,000.000	11,223,319.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.69 05/17/28	10,000,000.000	10,523,748.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	5,800,000.000	7,406,315.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	15,000,000.000	19,226,572.500	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	15,800,000.000	20,361,316.220	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	4,000,000.000	5,302,691.200	
オフショア・人民元　小計		1,337,510,000.000 (31,942,280,069)	1,391,065,785.140 (33,221,293,974)	
カナダ・ドル	CANADA 0.5 12/01/30	2,070,000.000	1,852,067.040	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,720,000.000	1,606,528.430	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,530,000.000	1,416,808.920	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,250,000.000	1,146,333.340	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,650,000.000	1,050,984.820	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,030,000.000	1,014,744.900	
	CANADA 2.0 06/01/32	900,000.000	841,169.280	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,860,000.000	1,289,765.660	
	CANADA 2.25 02/01/28	1,200,000.000	1,190,545.140	
	CANADA 2.25 06/01/29	940,000.000	922,838.830	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,000,000.000	976,045.660	
	CANADA 2.5 05/01/28	1,900,000.000	1,889,416.500	
	CANADA 2.5 11/01/27	300,000.000	299,230.600	
	CANADA 2.5 12/01/32	2,000,000.000	1,912,427.310	
	CANADA 2.75 03/01/30	1,000,000.000	989,957.860	
	CANADA 2.75 03/01/31	1,900,000.000	1,869,219.560	
	CANADA 2.75 06/01/33	400,000.000	386,558.570	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,100,000.000	1,101,232.440	
	CANADA 2.75 09/01/30	2,130,000.000	2,101,990.680	
	CANADA 2.75 12/01/48	550,000.000	459,020.500	
	CANADA 2.75 12/01/55	1,460,000.000	1,162,712.190	
	CANADA 2.75 12/01/64	1,060,000.000	814,362.830	
	CANADA 3.0 03/01/32	500,000.000	495,027.270	
	CANADA 3.0 06/01/34	1,570,000.000	1,530,002.580	
	CANADA 3.25 06/01/35	2,150,000.000	2,119,271.850	
	CANADA 3.25 06/01/36	1,000,000.000	978,128.440	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,650,000.000	1,663,029.330	
	CANADA 3.25 12/01/33	700,000.000	696,203.030	
	CANADA 3.25 12/01/34	1,570,000.000	1,552,821.740	
	CANADA 3.25 12/01/35	2,650,000.000	2,601,924.690	
	CANADA 3.5 03/01/28	700,000.000	707,858.130	
	CANADA 3.5 03/01/34	700,000.000	707,185.570	
	CANADA 3.5 09/01/29	1,400,000.000	1,421,052.700	
	CANADA 3.5 12/01/45	650,000.000	623,655.590	
	CANADA 3.5 12/01/57	810,000.000	748,733.410	
	CANADA 4.0 03/01/29	1,890,000.000	1,940,830.680	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	589,261.370	
	CANADA 5.0 06/01/37	450,000.000	508,108.300	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,050,000.000	1,131,195.300	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,000,000.000	1,149,922.430	
カナダ・ドル　小計		49,960,000.000 (5,716,423,200)	47,458,173.470 (5,430,164,208)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 07/01/31	240,000.000	237,431.950	

	SINGAPORE 1.875 03/01/50	310,000.000	293,104.930	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	260,000.000	244,529.960	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	510,000.000	516,456.600	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	540,000.000	551,070.000	
	SINGAPORE 2.5 04/01/30	420,000.000	431,633.910	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	230,000.000	234,324.000	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	350,000.000	363,649.920	
	SINGAPORE 2.75 03/01/35	180,000.000	189,449.960	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	490,000.000	534,827.650	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	430,000.000	463,754.950	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	230,000.000	237,704.970	
	SINGAPORE 2.875 08/01/28	830,000.000	851,874.650	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	700,000.000	731,066.000	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	460,000.000	476,100.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	407,000.000	485,144.310	
	SINGAPORE 3.25 06/01/54	240,000.000	291,553.200	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	100,000.000	109,449.980	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	450,000.000	489,599.910	
シンガポール・ドル　小計		7,377,000.000 (924,706,950)	7,732,726.850 (969,297,311)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,200,000.000	3,757,477.020	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,560,000.000	4,438,603.520	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	4,540,000.000	4,309,517.630	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,720,000.000	3,501,726.600	
	SWEDEN 2.25 05/11/35	4,450,000.000	4,282,368.500	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,120,000.000	2,086,616.530	
	SWEDEN 2.5 10/15/36	2,650,000.000	2,569,971.430	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,420,000.000	3,634,963.400	
スウェーデン・クローナ　小計		29,660,000.000 (495,618,600)	28,581,244.630 (477,592,598)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	2,510,000.000	2,188,103.860	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,110,000.000	1,955,009.310	
	DENMARK 0.5 11/15/27	2,850,000.000	2,781,840.820	
	DENMARK 0.5 11/15/29	1,940,000.000	1,817,796.730	
	DENMARK 2.0 11/15/28	1,300,000.000	1,287,416.940	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,400,000.000	2,320,847.520	
	DENMARK 2.25 11/15/35	3,100,000.000	2,928,570.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	4,970,000.000	5,740,029.920	
デンマーク・クローネ　小計		23,180,000.000 (573,009,600)	21,019,615.100 (519,604,885)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,440,000.000	1,357,257.370	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	920,000.000	817,420.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	310,000.000	205,851.650	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	807,733.640	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	570,000.000	477,309.050	

	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	250,000.000	164,506.330	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	450,000.000	441,831.580	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	960,000.000	915,777.640	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	920,000.000	911,244.500	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	470,000.000	457,451.000	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	540,000.000	552,003.120	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	370,000.000	370,141.590	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	490,000.000	473,256.380	
ニュージーランド・ドル　小計		8,600,000.000 (801,864,000)	7,951,783.850 (741,424,326)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,270,000.000	1,951,467.280	
	NORWAY 1.375 08/19/30	2,910,000.000	2,588,357.700	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,570,000.000	3,294,542.170	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,860,000.000	2,752,864.400	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,850,000.000	2,532,050.950	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,390,000.000	3,124,779.780	
	NORWAY 3.5 10/06/42	1,630,000.000	1,471,082.330	
	NORWAY 3.625 04/13/34	2,890,000.000	2,763,143.450	
	NORWAY 3.625 05/31/39	2,300,000.000	2,139,385.250	
	NORWAY 3.75 06/12/35	1,549,000.000	1,485,659.570	
	NORWAY 4.125 06/03/36	1,300,000.000	1,277,835.000	
ノルウェー・クローネ　小計		27,519,000.000 (455,714,640)	25,381,167.880 (420,312,140)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 01/25/28	2,300,000.000	2,173,306.840	
	POLAND 01/25/29	900,000.000	813,852.140	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,970,000.000	2,607,449.510	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,350,000.000	2,853,429.160	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,550,000.000	2,522,354.860	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,060,000.000	2,023,393.800	
	POLAND 2.75 10/25/29	3,000,000.000	2,871,247.880	
	POLAND 4.0 07/25/31	3,300,000.000	3,203,958.180	
	POLAND 4.5 01/25/31	1,300,000.000	1,298,691.390	
	POLAND 4.5 07/25/30	2,750,000.000	2,758,882.500	
	POLAND 4.75 07/25/29	4,550,000.000	4,626,248.900	
	POLAND 5.0 01/25/30	3,100,000.000	3,170,520.660	
	POLAND 5.0 10/25/34	2,630,000.000	2,609,688.790	
	POLAND 5.0 10/25/35	3,450,000.000	3,389,742.690	
	POLAND 5.25 04/25/36	900,000.000	895,748.360	
	POLAND 5.75 04/25/29	500,000.000	521,284.250	
	POLAND 6.0 10/25/33	4,100,000.000	4,351,863.000	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,750,000.000	2,936,791.000	
ポーランド・ズロチ　小計		46,460,000.000 (1,980,413,252)	45,628,453.910 (1,944,967,602)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,931,327.680	

	MALAYSIA 3.336 05/15/30	1,000,000.000	999,991.980	
	MALAYSIA 3.519 04/20/28	800,000.000	804,651.680	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	900,000.000	904,331.880	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,073,000.000	2,093,282.430	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	700,000.000	692,536.250	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,000,000.000	1,015,983.100	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,051,000.000	1,070,163.600	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,530,000.000	1,557,416.680	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,500,000.000	1,515,045.750	
	MALAYSIA 3.917 07/15/55	400,000.000	389,003.160	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	1,888,000.000	1,925,310.270	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,050,000.000	1,053,194.730	
	MALAYSIA 4.18 05/16/44	1,000,000.000	1,031,019.800	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	800,000.000	830,292.480	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,050,000.000	1,099,794.670	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	2,120,000.000	2,257,224.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,100,000.000	1,144,053.020	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	520,000.000	537,334.040	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,520,000.000	1,623,422.470	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	600,000.000	655,874.520	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	1,200,000.000	1,329,721.080	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,400,000.000	1,526,019.170	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,930,000.000	2,126,681.660	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	910,000.000	1,031,493.280	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	950,000.000	1,067,950.000	
マレーシア・リンギット　小計		30,992,000.000 (1,231,662,370)	32,213,119.580 (1,280,191,249)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 02/21/36	5,000,000.000	4,668,450.000	
	MEXICAN BONDS 02/28/30	35,000,000.000	35,339,460.100	
	MEXICAN BONDS 03/01/29	26,000,000.000	26,438,329.580	
	MEXICAN BONDS 03/02/28	7,000,000.000	7,130,690.000	
	MEXICAN BONDS 04/15/32	11,000,000.000	10,670,965.800	
	MEXICAN BONDS 04/29/55	5,400,000.000	4,594,395.430	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	2,000,000.000	1,871,623.680	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	33,140,000.000	31,040,451.410	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	22,690,000.000	19,363,036.290	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	11,700,000.000	12,460,347.420	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	25,100,000.000	24,486,668.430	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	27,070,000.000	23,184,013.230	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	17,991,000.000	16,777,899.430	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	12,996,000.000	11,198,551.690	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	6,701,000.000	6,807,400.810	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	9,400,000.000	8,853,313.190	

メキシコ・ペソ　小計			258,188,000.000 (2,389,891,403)	244,885,596.490 (2,266,759,035)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30		500,000.000	452,340.000	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31		1,330,000.000	1,165,843.420	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28		950,000.000	893,617.500	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40		770,000.000	464,079.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36		450,000.000	330,165.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29		600,000.000	566,316.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28		670,000.000	649,967.000	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51		650,000.000	332,523.950	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20		350,000.000	104,134.620	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32		840,000.000	750,666.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47		490,000.000	330,985.320	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86		150,000.000	68,025.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49		200,000.000	141,034.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17		390,000.000	221,929.500	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34		1,110,000.000	1,052,087.410	
	AUSTRIA 2.5 10/20/29		500,000.000	495,343.310	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33		1,100,000.000	1,088,978.000	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34		380,000.000	373,692.000	
	AUSTRIA 2.9 05/23/29		300,000.000	301,289.160	
	AUSTRIA 2.95 02/20/35		700,000.000	684,950.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44		670,000.000	621,527.170	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53		320,000.000	281,725.600	
	AUSTRIA 3.2 02/20/36		350,000.000	346,920.000	
	AUSTRIA 3.2 07/15/39		300,000.000	289,980.000	
	AUSTRIA 3.45 10/20/30		550,000.000	562,650.000	
	AUSTRIA 3.75 03/20/56		400,000.000	388,840.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62		280,000.000	275,032.020	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37		700,000.000	748,701.590	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27		580,000.000	600,762.950	
	BELGIUM 0.0 10/22/27		750,000.000	725,640.260	
	BELGIUM 0.0 10/22/31		1,000,000.000	853,403.300	
	BELGIUM 0.1 06/22/30		650,000.000	582,855.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32		1,000,000.000	850,600.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40		580,000.000	362,572.650	
	BELGIUM 0.65 06/22/71		870,000.000	252,641.760	
	BELGIUM 0.8 06/22/28		450,000.000	432,765.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29		950,000.000	900,106.350	
	BELGIUM 1.0 06/22/31		700,000.000	636,080.210	
	BELGIUM 1.25 04/22/33		1,000,000.000	883,532.200	
	BELGIUM 1.4 06/22/53		770,000.000	408,273.070	
	BELGIUM 1.45 06/22/37		500,000.000	400,993.170	
	BELGIUM 1.6 06/22/47		420,000.000	266,546.780	
	BELGIUM 1.7 06/22/50		580,000.000	353,073.900	
	BELGIUM 1.9 06/22/38		1,400,000.000	1,150,509.420	
	BELGIUM 2.15 06/22/66		530,000.000	304,909.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/57		450,000.000	283,732.910	
	BELGIUM 2.6 10/22/30		500,000.000	492,867.310	
	BELGIUM 2.7 10/22/29		900,000.000	896,525.550	

		BELGIUM 2.75 04/22/39	750,000.000	669,592.720	
		BELGIUM 2.85 10/22/34	700,000.000	672,446.980	
		BELGIUM 3.0 06/22/33	850,000.000	837,213.630	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	640,000.000	624,537.580	
		BELGIUM 3.1 06/22/35	1,600,000.000	1,552,719.520	
		BELGIUM 3.3 06/22/54	390,000.000	320,291.400	
		BELGIUM 3.45 06/22/43	500,000.000	460,323.930	
		BELGIUM 3.5 06/22/55	420,000.000	355,362.340	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	500,000.000	472,343.150	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	350,000.000	366,329.560	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	530,000.000	546,760.240	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	780,000.000	869,631.740	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,360,000.000	1,422,604.880	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,660,000.000	1,633,722.200	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	500,000.000	492,170.000	
		BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,000,000.000	985,160.000	
		BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,340,000.000	1,329,883.000	
		BUNDESOBL 2.2 10/10/30	2,200,000.000	2,153,536.000	
		BUNDESOBL 2.4 04/18/30	1,700,000.000	1,681,521.000	
		BUNDESOBL 2.4 10/19/28	1,350,000.000	1,342,372.500	
		BUNDESOBL 2.5 10/11/29	1,000,000.000	994,430.000	
		BUNDESSCHAT 2.0 12/16/27	800,000.000	792,920.000	
		BUNDESSCHAT 2.1 03/15/28	1,300,000.000	1,288,235.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,100,000.000	1,000,362.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	900,000.000	795,609.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,280,000.000	1,097,157.120	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,570,000.000	1,207,926.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,500,000.000	1,112,985.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,150,000.000	1,031,607.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,620,000.000	1,453,561.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,400,000.000	1,218,994.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	900,000.000	783,676.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,807,000.000	767,958.730	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,960,000.000	836,743.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,249,000.000	889,974.280	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,159,500.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,250,000.000	1,176,754.680	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,600,000.000	1,506,132.800	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	950,000.000	904,913.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,210,000.000	1,170,554.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,770,000.000	1,731,075.930	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,950,000.000	1,798,650.250	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	550,000.000	430,947.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,070,000.000	1,342,903.690	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,250,000.000	1,173,287.500	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,770,000.000	1,222,432.800	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,000,000.000	692,410.000	

		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,600,000.000	1,570,240.000	
		DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	1,300,000.000	1,236,196.000	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,060,000.000	1,024,447.600	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,900,000.000	1,836,483.000	
		DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,700,000.000	1,676,625.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,800,000.000	1,735,236.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,600,000.000	1,542,704.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,350,000.000	1,175,080.500	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,130,000.000	1,819,262.820	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	1,300,000.000	1,049,126.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 11/15/32	1,200,000.000	1,176,096.000	
		DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,250,000.000	1,137,325.000	
		DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,000,000.000	911,100.000	
		DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,410,000.000	1,383,703.500	
		DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,600,000.000	1,559,552.000	
		DEUTSCHLAND 2.6 08/15/35	1,400,000.000	1,355,298.000	
		DEUTSCHLAND 2.9 02/15/36	1,600,000.000	1,582,096.000	
		DEUTSCHLAND 2.9 08/15/56	950,000.000	827,934.500	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,350,000.000	1,322,622.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	750,000.000	809,927.470	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,740,000.000	1,920,472.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,700,000.000	2,808,783.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,480,000.000	1,671,142.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,120,000.000	1,297,878.400	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,490,000.000	1,661,379.800	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,300,000.000	1,355,757.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	700,000.000	781,599.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,220,000.000	1,265,615.800	
		FINLAND 0.0 09/15/30	280,000.000	248,713.560	
		FINLAND 0.125 04/15/36	80,000.000	58,613.890	
		FINLAND 0.125 04/15/52	206,000.000	79,491.070	
		FINLAND 0.125 09/15/31	400,000.000	346,118.900	
		FINLAND 0.25 09/15/40	550,000.000	342,879.750	
		FINLAND 0.5 04/15/43	140,000.000	83,305.030	
		FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	487,776.730	
		FINLAND 0.5 09/15/28	220,000.000	209,969.580	
		FINLAND 0.5 09/15/29	280,000.000	260,730.800	
		FINLAND 0.75 04/15/31	300,000.000	271,368.780	
		FINLAND 1.125 04/15/34	400,000.000	343,942.000	
		FINLAND 1.375 04/15/47	300,000.000	193,200.130	
		FINLAND 1.5 09/15/32	550,000.000	501,936.880	
		FINLAND 2.5 04/15/30	450,000.000	444,352.500	
		FINLAND 2.625 07/04/42	560,000.000	485,851.650	

		FINLAND 2.75 04/15/38	600,000.000	556,221.100	
		FINLAND 2.875 04/15/29	750,000.000	752,250.000	
		FINLAND 2.95 04/15/55	250,000.000	207,075.000	
		FINLAND 3.0 09/15/33	370,000.000	367,164.210	
		FINLAND 3.0 09/15/34	850,000.000	836,434.000	
		FINLAND 3.0 09/15/35	200,000.000	195,140.000	
		FINLAND 3.2 04/15/45	210,000.000	192,444.000	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,150,000.000	1,779,447.500	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,800,000.000	3,446,448.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,280,000.000	1,998,339.620	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,600,000.000	3,039,530.400	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,080,000.000	2,880,807.160	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,010,000.000	1,248,430.580	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	980,000.000	240,073.050	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,520,000.000	805,680.180	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,530,000.000	2,449,988.750	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,000,000.000	3,853,114.190	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,350,000.000	1,010,147.500	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,350,000.000	562,009.720	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,390,000.000	2,277,048.600	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,650,000.000	1,392,934.120	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,290,000.000	1,024,647.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/38	800,000.000	595,440.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,270,000.000	3,032,961.780	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	770,000.000	436,080.300	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	450,000.000	219,201.750	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,510,000.000	1,937,937.110	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,600,000.000	1,058,184.000	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,961,000.000	1,811,620.150	
		FRANCE OAT 2.4 09/24/28	1,900,000.000	1,882,833.500	
		FRANCE OAT 2.4 09/24/29	2,300,000.000	2,266,190.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,130,000.000	3,073,971.430	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,000,000.000	789,558.000	
		FRANCE OAT 2.5 09/24/27	3,300,000.000	3,291,642.750	
		FRANCE OAT 2.7 02/25/31	1,900,000.000	1,866,668.300	
		FRANCE OAT 2.75 02/25/29	1,850,000.000	1,844,340.850	
		FRANCE OAT 2.75 02/25/30	2,800,000.000	2,777,741.960	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,090,000.000	3,090,500.580	
		FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,800,000.000	3,704,078.500	
		FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,608,000.000	1,210,647.120	
		FRANCE OAT 3.0 06/25/49	1,700,000.000	1,348,021.370	
		FRANCE OAT 3.0 11/25/34	2,300,000.000	2,200,649.770	
		FRANCE OAT 3.2 05/25/35	2,200,000.000	2,123,630.300	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,500,000.000	1,294,210.500	
		FRANCE OAT 3.5 11/25/33	3,200,000.000	3,203,104.000	
		FRANCE OAT 3.5 11/25/35	5,800,000.000	5,697,920.000	
		FRANCE OAT 3.6 05/25/42	1,900,000.000	1,760,920.000	
		FRANCE OAT 3.75 05/25/56	1,470,000.000	1,263,743.410	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,150,000.000	1,042,114.900	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,470,000.000	1,308,497.710	

		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,900,000.000	2,904,471.800	
		FRANCE OAT 4.1 05/25/46	930,000.000	896,799.000	
		FRANCE OAT 4.4 05/25/57	1,000,000.000	963,700.000	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,810,000.000	1,881,409.930	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,280,000.000	2,467,434.240	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,090,000.000	3,304,235.880	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,810,000.000	2,057,064.270	
		IRISH 0.0 10/18/31	430,000.000	370,982.470	
		IRISH 0.2 10/18/30	480,000.000	430,702.610	
		IRISH 0.35 10/18/32	230,000.000	196,105.180	
		IRISH 0.4 05/15/35	280,000.000	221,387.460	
		IRISH 0.55 04/22/41	260,000.000	171,909.430	
		IRISH 0.9 05/15/28	370,000.000	358,800.210	
		IRISH 1.1 05/15/29	250,000.000	239,289.310	
		IRISH 1.3 05/15/33	550,000.000	493,826.850	
		IRISH 1.35 03/18/31	480,000.000	449,869.770	
		IRISH 1.5 05/15/50	535,000.000	350,843.370	
		IRISH 1.7 05/15/37	450,000.000	384,757.740	
		IRISH 2.0 02/18/45	360,000.000	282,254.400	
		IRISH 2.4 05/15/30	560,000.000	552,489.360	
		IRISH 2.6 10/18/34	450,000.000	434,088.670	
		IRISH 3.0 10/18/43	300,000.000	277,510.120	
		IRISH 3.1 06/18/36	400,000.000	396,036.000	
		IRISH 3.15 10/18/55	190,000.000	168,521.930	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	230,000.000	220,731.000	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	700,000.000	658,350.000	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	800,000.000	765,040.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,900,000.000	1,674,134.650	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,650,000.000	1,489,877.810	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,100,000.000	826,650.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	550,000.000	482,515.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,600,000.000	1,473,280.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,600,000.000	1,569,600.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,155,790.020	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,400,000.000	1,320,069.800	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,332,000.000	1,089,043.200	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	440,000.000	281,600.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,200,000.000	1,102,638.600	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,850,000.000	1,741,343.950	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	750,000.000	437,661.930	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,500,000.000	1,119,000.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,150,000.000	1,137,259.430	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,000,000.000	993,948.000	
		ITALY BTPS 2.1 08/26/27	900,000.000	893,790.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	400,000.000	257,200.000	
		ITALY BTPS 2.2 02/28/28	500,000.000	495,300.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,000,000.000	873,900.000	
		ITALY BTPS 2.35 01/15/29	600,000.000	592,320.000	
		ITALY BTPS 2.4 03/15/29	1,700,000.000	1,678,410.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,600,000.000	1,501,991.040	

		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,190,000.000	838,950.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	500,000.000	476,150.000	
		ITALY BTPS 2.65 06/15/28	1,200,000.000	1,196,520.000	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,200,000.000	1,198,800.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,130,000.000	875,411.000	
		ITALY BTPS 2.7 10/01/30	1,100,000.000	1,083,060.000	
		ITALY BTPS 2.7 10/15/27	850,000.000	849,745.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	750,000.000	519,375.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	997,100.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	900,000.000	899,874.450	
		ITALY BTPS 2.85 02/01/31	800,000.000	790,400.000	
		ITALY BTPS 2.95 07/01/30	600,000.000	597,480.000	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,280,000.000	1,154,176.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,300,000.000	1,303,813.550	
		ITALY BTPS 3.0 10/01/29	1,500,000.000	1,500,825.000	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	500,000.000	450,661.750	
		ITALY BTPS 3.15 03/15/33	1,000,000.000	984,800.000	
		ITALY BTPS 3.15 11/15/31	1,400,000.000	1,395,520.000	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	1,430,000.000	1,343,056.000	
		ITALY BTPS 3.25 07/15/32	700,000.000	697,410.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	300,000.000	255,693.000	
		ITALY BTPS 3.25 11/15/32	1,000,000.000	992,900.000	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,700,000.000	1,667,989.000	
		ITALY BTPS 3.4 04/01/28	950,000.000	959,880.000	
		ITALY BTPS 3.45 02/01/36	1,900,000.000	1,857,820.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,180,000.000	1,026,057.480	
		ITALY BTPS 3.45 07/15/27	500,000.000	503,800.000	
		ITALY BTPS 3.45 07/15/31	1,800,000.000	1,823,040.000	
		ITALY BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.000	1,014,800.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	740,000.000	753,146.610	
		ITALY BTPS 3.6 10/01/35	1,000,000.000	992,800.000	
		ITALY BTPS 3.65 08/01/35	900,000.000	898,290.000	
		ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,110,000.000	1,135,974.000	
		ITALY BTPS 3.8 07/01/36	500,000.000	500,650.000	
		ITALY BTPS 3.8 08/01/28	1,000,000.000	1,019,400.000	
		ITALY BTPS 3.85 02/01/35	1,200,000.000	1,219,680.000	
		ITALY BTPS 3.85 07/01/34	500,000.000	509,750.000	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	780,575.400	
		ITALY BTPS 3.85 10/01/40	1,400,000.000	1,362,200.000	
		ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,450,000.000	1,490,020.000	
		ITALY BTPS 3.95 10/01/41	850,000.000	828,665.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	700,000.000	713,790.000	
		ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,000,000.000	1,027,000.000	
		ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,350,000.000	1,401,705.000	
		ITALY BTPS 4.0 11/15/30	700,000.000	724,780.000	
		ITALY BTPS 4.05 10/30/37	650,000.000	661,570.000	
		ITALY BTPS 4.1 02/01/29	1,000,000.000	1,029,700.000	
		ITALY BTPS 4.1 04/30/46	600,000.000	580,560.000	
		ITALY BTPS 4.15 10/01/39	1,100,000.000	1,113,200.000	
		ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,000,000.000	1,044,800.000	

		ITALY BTPS 4.3 10/01/54	950,000.000	914,375.000	
		ITALY BTPS 4.35 11/01/33	930,000.000	982,080.000	
		ITALY BTPS 4.4 05/01/33	940,000.000	996,870.000	
		ITALY BTPS 4.45 09/01/43	900,000.000	922,050.000	
		ITALY BTPS 4.5 10/01/53	750,000.000	747,600.000	
		ITALY BTPS 4.65 10/01/55	450,000.000	455,715.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,400,000.000	1,455,622.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	750,000.000	796,096.270	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	430,000.000	473,086.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	860,000.000	946,946.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,710,000.000	1,881,684.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,890,000.000	2,025,702.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	820,000.000	933,406.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,092,899.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,470,000.000	1,539,531.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,100,000.000	1,030,217.950	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,250,000.000	858,732.500	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,300,000.000	521,146.600	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,000,000.000	896,164.240	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	380,000.000	330,328.960	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	700,000.000	651,026.950	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	447,000.000	308,062.850	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	500,000.000	436,550.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	400,000.000	392,939.760	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,360,000.000	1,310,529.320	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	890,000.000	639,901.540	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/30	550,000.000	545,471.020	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/31	800,000.000	789,680.000	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,520,000.000	1,481,050.760	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/33	1,000,000.000	970,180.000	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/34	500,000.000	481,050.000	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/35	200,000.000	190,760.000	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,030,000.000	906,564.270	
		NETHERLANDS 3.25 01/15/44	670,000.000	646,032.030	
		NETHERLANDS 3.5 01/15/56	450,000.000	439,065.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,030,000.000	1,063,603.230	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,300,000.000	1,394,250.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	520,000.000	542,100.000	
		PORTUGUESE 0.3 10/17/31	100,000.000	87,382.000	
		PORTUGUESE 0.475 10/18/30	350,000.000	317,544.350	
		PORTUGUESE 0.7 10/15/27	200,000.000	195,422.450	
		PORTUGUESE 0.9 10/12/35	300,000.000	242,665.500	
		PORTUGUESE 1.0 04/12/52	280,000.000	145,805.090	

		PORTUGUESE 1.15 04/11/42	300,000.000	206,887.110	
		PORTUGUESE 1.65 07/16/32	850,000.000	787,451.360	
		PORTUGUESE 1.95 06/15/29	1,000,000.000	978,600.000	
		PORTUGUESE 2.125 10/17/28	950,000.000	939,532.810	
		PORTUGUESE 2.25 04/18/34	50,000.000	46,820.680	
		PORTUGUESE 2.875 10/14/33	500,000.000	491,050.000	
		PORTUGUESE 2.875 10/20/34	200,000.000	194,861.800	
		PORTUGUESE 3.0 06/15/35	380,000.000	371,421.670	
		PORTUGUESE 3.25 06/13/36	300,000.000	296,014.970	
		PORTUGUESE 3.5 06/18/38	370,000.000	367,382.060	
		PORTUGUESE 3.625 06/12/54	480,000.000	441,552.000	
		PORTUGUESE 3.875 02/15/30	550,000.000	570,542.500	
		PORTUGUESE 4.1 02/15/45	650,000.000	665,535.000	
		PORTUGUESE 4.1 04/15/37	630,000.000	665,698.500	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.0 10/09/30	500,000.000	458,300.000	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.0 10/13/51	250,000.000	124,402.500	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 2.0 10/17/47	100,000.000	68,333.670	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.0 11/06/31	230,000.000	227,868.270	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625 01/16/29	300,000.000	305,216.430	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/23/35	800,000.000	811,082.080	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/27/40	510,000.000	493,119.000	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 4.0 10/19/32	500,000.000	521,113.450	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,850,000.000	1,775,685.500	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,490,000.000	1,301,813.000	
		SPAIN 0.5 04/30/30	2,600,000.000	2,383,947.020	
		SPAIN 0.5 10/31/31	2,100,000.000	1,847,488.120	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,280,000.000	1,192,370.620	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,359,349.530	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,650,000.000	1,617,726.000	
		SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	941,000.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	1,160,000.000	872,052.850	
		SPAIN 1.0 07/30/42	1,150,000.000	755,090.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	930,000.000	488,627.530	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,000,000.000	716,242.660	
		SPAIN 1.25 10/31/30	769,000.000	718,361.350	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,200,000.000	1,173,541.450	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,700,000.000	1,655,885.000	

	SPAIN 1.45 04/30/29	730,000.000	704,909.790	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,000,000.000	984,917.700	
	SPAIN 1.45 10/31/71	674,000.000	305,092.490	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,800,000.000	1,589,117.710	
	SPAIN 1.9 10/31/52	730,000.000	468,533.170	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,410,846.430	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,610,000.000	1,524,670.000	
	SPAIN 2.4 05/31/28	1,100,000.000	1,093,598.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,200,000.000	1,163,076.880	
	SPAIN 2.6 05/31/31	700,000.000	685,475.000	
	SPAIN 2.7 01/31/30	1,200,000.000	1,193,820.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,300,000.000	1,041,964.820	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,220,000.000	1,031,514.140	
	SPAIN 3.0 01/31/33	800,000.000	792,880.000	
	SPAIN 3.1 07/30/31	1,200,000.000	1,207,248.480	
	SPAIN 3.15 04/30/33	1,000,000.000	998,882.000	
	SPAIN 3.15 04/30/35	1,000,000.000	983,187.470	
	SPAIN 3.2 10/31/35	1,200,000.000	1,178,280.000	
	SPAIN 3.25 04/30/34	1,450,000.000	1,446,462.060	
	SPAIN 3.3 04/30/36	600,000.000	591,820.210	
	SPAIN 3.45 07/30/43	800,000.000	750,622.510	
	SPAIN 3.45 07/30/66	890,000.000	757,127.860	
	SPAIN 3.45 10/31/34	1,300,000.000	1,311,372.920	
	SPAIN 3.5 01/31/41	1,100,000.000	1,057,940.430	
	SPAIN 3.5 05/31/29	1,350,000.000	1,376,709.750	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,320,000.000	1,347,588.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	1,200,000.000	1,220,178.840	
	SPAIN 3.95 10/31/56	700,000.000	665,541.610	
	SPAIN 4.0 10/31/54	500,000.000	484,288.280	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,180,000.000	1,247,998.910	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,000,000.000	1,096,274.400	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,080,000.000	1,208,088.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,001,080.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,200,000.000	1,383,707.880	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,800,000.000	2,064,913.740	
	SPAIN 6.0 01/31/29	800,000.000	863,816.480	
ユーロ　小計		437,638,000.000 (80,857,996,880)	402,264,376.130 (74,322,366,134)	
韓国・ウォン	KOREA TREASURY BOND (TAX) 3.75 12/10/33	800,000,000.000	777,432,424.000	
	KOREA TREASURY BOND (TAX) 2.0 03/10/46	500,000,000.000	340,949,555.000	
	KOREA TREASURY BOND (TAX) 4.0 12/10/31	500,000,000.000	498,127,485.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.125 09/10/39	1,000,000,000.000	682,754,610.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.375 06/10/30	800,000,000.000	725,505,288.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	1,100,000,000.000	1,012,761,233.000	

		KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/50	2,030,000,000.000	1,151,608,403.400	
		KOREA TREASURY BOND 1.5 09/10/40	700,000,000.000	490,792,862.000	
		KOREA TREASURY BOND 1.5 12/10/30	900,000,000.000	810,074,466.000	
		KOREA TREASURY BOND 1.875 03/10/51	1,500,000,000.000	915,671,280.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.0 06/10/31	500,000,000.000	455,028,645.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.25 06/10/28	700,000,000.000	682,149,006.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.375 12/10/28	1,800,000,000.000	1,744,801,290.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.625 03/10/48	500,000,000.000	374,323,860.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.625 09/10/55	2,350,000,000.000	1,651,421,069.500	
		KOREA TREASURY BOND 2.75 09/10/45	500,000,000.000	393,231,170.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.75 09/10/54	600,000,000.000	436,693,926.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.875 09/10/44	500,000,000.000	403,214,180.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.0 12/10/34	700,000,000.000	641,816,616.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/29	1,700,000,000.000	1,678,150,155.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/54	630,000,000.000	508,495,428.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 06/10/33	1,000,000,000.000	946,707,150.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 09/10/42	500,000,000.000	433,657,715.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 12/10/35	700,000,000.000	646,594,641.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.375 03/10/31	1,000,000,000.000	973,265,990.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.5 03/10/56	1,780,000,000.000	1,508,125,185.200	
		KOREA TREASURY BOND 3.5 06/10/29	800,000,000.000	794,325,256.000	
		KOREA TREASURY BOND 4.25 06/10/36	700,000,000.000	701,904,700.000	
		KOREA TREASURY BOND 4.25 12/10/32	500,000,000.000	504,447,200.000	
	韓国・ウォン　小計		27,290,000,000.000 (2,940,470,210)	22,884,030,789.100 (2,465,731,433)	
国債証券　合計			280,143,894,849.800 (280,143,894,850)	261,445,871,191 (261,445,871,191)	
合計				261,445,871,191	

		(261,445,871,191)	

(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	282銘柄	44.34	45.03
イギリス・ポンド	国債証券	64銘柄	5.69	5.77
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	0.43	0.44
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	1.28	1.30
オフショア・人民元	国債証券	75銘柄	12.51	12.71
カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	2.05	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	0.18	0.18
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	18銘柄	0.73	0.74
マレーシア・リンギット	国債証券	26銘柄	0.48	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	0.85	0.87
ユーロ	国債証券	404銘柄	27.99	28.43
韓国・ウォン	国債証券	29銘柄	0.93	0.94

(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

「（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7月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,776,803,000
コール・ローン	847,415,374
国債証券	338,115,125,839
未収利息	2,936,266,910
前払費用	358,296,780
流動資産合計	344,033,907,903
資産合計	344,033,907,903
負債の部	
流動負債	
未払金	948,481,531
未払解約金	18,900,000
流動負債合計	967,381,531
負債合計	967,381,531
純資産の部	
元本等	
元本	124,119,072,500
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	218,947,453,872
元本等合計	343,066,526,372
純資産合計	343,066,526,372
負債純資産合計	344,033,907,903

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　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7月13日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	116,051,110,604円
同期中追加設定元本額	24,498,441,933円
同期中一部解約元本額	16,430,480,037円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	9,647,328,199円
たわらノーロード　先進国債券	27,765,837,368円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	6,123,926,855円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	77,535,909円
たわらノーロード　バランス（標準型）	587,738,486円
たわらノーロード　バランス（積極型）	177,597,467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）	21,407,689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）	968,576,261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）	1,903,380,645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）	1,015,928,894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）	771,633,604円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	2,113,286円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	13,349,868円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	150,732,245円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	43,728,534円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	40,997,653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
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,856,547,614円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	5,496,480,404円
Ｏｎｅグローバルバランス	226,860,999円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	771,236,833円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,608,980,983円
ＤＩＡＭ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	952,794,623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）	342,790,836円
投資のソムリエ	1,497,551,610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＞	333,957,986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＞	1,644,079,463円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	972,346,415円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,575,677,196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）	34,234,518円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	10,880,068円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	135,916,102円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	1,267,895,773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）	62,022,007円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	40,456,339円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	22,654,833円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,246,223,452円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	9,989,141円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	3,743,263円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	35,424,741円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	397,892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）	343,213,624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）	604,190,928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）	619,194,181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）	4,888,414,291円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	1,310,023,549円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	3,841,656,650円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	6,996,568円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,606,891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（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	1,052,120円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限	145,217,596円

定）	
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	174,892,502円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,114,497円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,868,305円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,965,725円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,709円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	630,807,695円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	948,275,150円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,920,254,962円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	26,695,887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）	73,456,857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）	470,076,873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）	99,831,227円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	144,694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）	99,795,365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）	89,063,256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）	116,872,369円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,600,971円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	63,637,337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＞	3,091,692,284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＞	6,564,790,882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］	5,927,954,504円
計	124,119,072,500円
２．　受益権の総数	124,119,072,500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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△6,920,358,920
合計	△6,920,358,920

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	2.7640円
（1万口当たり純資産額）	(27,640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7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,634,709.500	

		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,640,931.250	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,680,000.000	2,589,271.010	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,937,420.710	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,491,368.350	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,350,000.000	4,664,740.220	
		US T N/B 0.625 08/15/30	3,836,000.000	3,314,543.750	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,715,511.700	
		US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,818,371.850	
		US T N/B 0.75 01/31/28	5,678,000.000	5,386,558.920	
		US T N/B 0.875 11/15/30	7,200,000.000	6,236,296.840	
		US T N/B 1.0 07/31/28	5,270,000.000	4,940,213.300	
		US T N/B 1.125 02/15/31	3,267,000.000	2,842,034.780	
		US T N/B 1.125 02/29/28	6,000,000.000	5,711,484.360	
		US T N/B 1.125 05/15/40	1,000,000.000	623,261.720	
		US T N/B 1.125 08/15/40	2,460,000.000	1,517,416.410	
		US T N/B 1.125 08/31/28	4,230,000.000	3,965,294.550	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,310,000.000	3,149,413.280	
		US T N/B 1.25 04/30/28	2,700,000.000	2,562,837.890	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,380,000.000	2,038,239.830	
		US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,920,062.500	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,500,000.000	3,306,337.890	
		US T N/B 1.25 08/15/31	6,360,000.000	5,475,935.120	
		US T N/B 1.25 09/30/28	1,413,000.000	1,324,880.680	
		US T N/B 1.375 08/15/50	2,500,000.000	1,199,365.220	
		US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,418,108.770	
		US T N/B 1.375 11/15/31	1,000,000.000	860,058.590	
		US T N/B 1.375 11/15/40	2,000,000.000	1,273,242.180	
		US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,295,429.660	
		US T N/B 1.5 02/15/30	4,330,000.000	3,936,917.170	
		US T N/B 1.5 11/30/28	3,500,000.000	3,285,556.640	
		US T N/B 1.625 05/15/31	6,340,000.000	5,603,841.800	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,460,000.000	3,201,716.380	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,932,000.000	2,522,640.950	
		US T N/B 1.75 01/31/29	6,400,000.000	6,018,625.020	
		US T N/B 1.75 08/15/41	2,480,000.000	1,636,025.000	
		US T N/B 1.75 11/15/29	4,250,000.000	3,924,111.300	
		US T N/B 1.875 02/15/32	7,780,000.000	6,833,028.120	
		US T N/B 1.875 02/15/41	308,000.000	210,492.730	
		US T N/B 1.875 02/15/51	3,068,000.000	1,668,944.070	
		US T N/B 1.875 02/28/29	3,700,000.000	3,484,865.220	
		US T N/B 1.875 11/15/51	4,370,000.000	2,349,216.370	
		US T N/B 2.0 02/15/50	2,800,000.000	1,598,078.120	
		US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,238,280.620	
		US T N/B 2.0 11/15/41	2,850,000.000	1,942,620.100	
		US T N/B 2.25 02/15/52	2,350,000.000	1,384,939.450	
		US T N/B 2.25 05/15/41	3,420,000.000	2,455,787.110	
		US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	4,154,703.110	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,570,000.000	1,645,101.170	
		US T N/B 2.25 08/15/49	2,940,000.000	1,792,251.560	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,188,505.450	

		US T N/B 2.375 02/15/42	1,700,000.000	1,220,115.220	
		US T N/B 2.375 03/31/29	5,150,000.000	4,906,079.100	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,584,518.920	
		US T N/B 2.375 05/15/51	4,760,000.000	2,915,221.090	
		US T N/B 2.375 11/15/49	2,690,000.000	1,679,673.810	
		US T N/B 2.5 02/15/45	1,200,000.000	826,265.620	
		US T N/B 2.5 02/15/46	3,170,000.000	2,145,446.100	
		US T N/B 2.5 05/15/46	1,534,000.000	1,034,101.740	
		US T N/B 2.625 02/15/29	5,200,000.000	4,996,773.440	
		US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,929,511.510	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,439,268.750	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,167,871.100	
		US T N/B 2.75 07/31/27	828,000.000	816,196.000	
		US T N/B 2.75 08/15/32	6,340,000.000	5,792,432.010	
		US T N/B 2.75 08/15/42	2,000,000.000	1,503,671.880	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,547,410.930	
		US T N/B 2.75 11/15/42	2,056,000.000	1,537,020.610	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,556,367.170	
		US T N/B 2.875 04/30/29	4,500,000.000	4,339,951.150	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,060,000.000	3,964,843.740	
		US T N/B 2.875 05/15/32	6,050,000.000	5,589,632.810	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,890,000.000	2,181,159.740	
		US T N/B 2.875 05/15/49	2,512,000.000	1,750,108.440	
		US T N/B 2.875 05/15/52	8,329,000.000	5,646,313.720	
		US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,896,095.890	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,071,492.180	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,580,000.000	1,132,971.060	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,200,000.000	876,703.120	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	1,914,728.500	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,010,000.000	2,153,325.760	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,481,000.000	1,160,270.930	
		US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	963,922.260	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,180,448.440	
		US T N/B 3.0 08/15/48	2,510,000.000	1,804,258.580	
		US T N/B 3.0 08/15/52	5,240,000.000	3,640,776.570	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,800,000.000	1,352,531.250	
		US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	741,914.060	
		US T N/B 3.125 02/15/42	2,360,000.000	1,889,290.620	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,211,306.240	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,086,682.800	
		US T N/B 3.125 08/15/44	1,590,000.000	1,222,933.570	
		US T N/B 3.125 08/31/27	4,540,000.000	4,488,570.330	
		US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	3,008,560.530	
		US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	4,078,520.710	
		US T N/B 3.125 11/15/41	3,020,000.000	2,429,448.420	
		US T N/B 3.25 05/15/42	1,560,000.000	1,264,788.280	
		US T N/B 3.25 06/30/27	2,700,000.000	2,678,187.260	
		US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,404,228.510	
		US T N/B 3.375 05/15/33	12,230,000.000	11,480,434.770	
		US T N/B 3.375 05/15/44	5,100,000.000	4,088,964.830	

		US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,398,392.190	
		US T N/B 3.375 09/15/27	4,000,000.000	3,964,375.000	
		US T N/B 3.375 09/15/28	1,000,000.000	982,539.060	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,650,000.000	2,801,375.000	
		US T N/B 3.5 01/15/29	2,600,000.000	2,554,906.250	
		US T N/B 3.5 01/31/28	5,680,000.000	5,620,315.630	
		US T N/B 3.5 01/31/30	2,700,000.000	2,632,605.460	
		US T N/B 3.5 02/15/29	2,000,000.000	1,964,218.760	
		US T N/B 3.5 02/15/33	2,164,000.000	2,052,587.800	
		US T N/B 3.5 02/15/39	700,000.000	622,125.000	
		US T N/B 3.5 02/28/31	4,184,000.000	4,046,058.750	
		US T N/B 3.5 03/15/29	2,600,000.000	2,552,468.750	
		US T N/B 3.5 04/30/28	4,500,000.000	4,444,804.710	
		US T N/B 3.5 04/30/30	10,100,000.000	9,829,943.370	
		US T N/B 3.5 09/30/29	3,500,000.000	3,422,138.680	
		US T N/B 3.5 10/15/28	3,000,000.000	2,953,242.180	
		US T N/B 3.5 11/15/28	7,500,000.000	7,379,003.920	
		US T N/B 3.5 11/30/30	2,500,000.000	2,421,386.720	
		US T N/B 3.5 12/15/28	1,500,000.000	1,474,980.460	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,358,248.430	
		US T N/B 3.625 02/15/53	5,857,000.000	4,591,453.270	
		US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,466,093.750	
		US T N/B 3.625 03/31/30	5,500,000.000	5,379,042.950	
		US T N/B 3.625 05/15/53	4,210,000.000	3,297,285.130	
		US T N/B 3.625 05/31/28	3,500,000.000	3,462,880.850	
		US T N/B 3.625 08/15/28	279,000.000	275,703.220	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,232,101.150	
		US T N/B 3.625 08/31/29	5,000,000.000	4,909,472.640	
		US T N/B 3.625 08/31/30	2,800,000.000	2,730,328.130	
		US T N/B 3.625 09/30/30	3,000,000.000	2,924,179.680	
		US T N/B 3.625 09/30/31	2,500,000.000	2,419,091.800	
		US T N/B 3.625 10/31/30	6,700,000.000	6,526,218.750	
		US T N/B 3.625 12/31/30	3,700,000.000	3,599,695.290	
		US T N/B 3.75 01/31/31	1,200,000.000	1,173,000.000	
		US T N/B 3.75 02/28/33	5,850,000.000	5,631,996.120	
		US T N/B 3.75 04/15/28	4,600,000.000	4,564,242.170	
		US T N/B 3.75 05/15/28	1,000,000.000	991,835.940	
		US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,434,921.870	
		US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,138,750.010	
		US T N/B 3.75 08/15/27	7,200,000.000	7,169,062.460	
		US T N/B 3.75 08/15/41	4,920,000.000	4,310,381.240	
		US T N/B 3.75 08/31/31	2,000,000.000	1,947,656.240	
		US T N/B 3.75 10/31/32	2,500,000.000	2,412,597.650	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,241,741.390	
		US T N/B 3.75 11/30/32	1,100,000.000	1,061,005.850	
		US T N/B 3.75 12/31/28	4,000,000.000	3,955,078.110	
		US T N/B 3.75 12/31/30	2,600,000.000	2,542,464.830	
		US T N/B 3.875 02/15/43	2,000,000.000	1,744,257.810	
		US T N/B 3.875 03/15/28	6,000,000.000	5,968,359.360	
		US T N/B 3.875 03/31/31	4,500,000.000	4,418,789.040	

		US T N/B 3.875 04/15/29	4,000,000.000	3,962,812.480	
		US T N/B 3.875 04/30/30	2,500,000.000	2,465,722.650	
		US T N/B 3.875 05/15/29	7,000,000.000	6,933,554.670	
		US T N/B 3.875 05/15/43	1,800,000.000	1,565,859.380	
		US T N/B 3.875 06/15/28	3,000,000.000	2,981,367.180	
		US T N/B 3.875 06/30/30	2,000,000.000	1,971,015.620	
		US T N/B 3.875 07/15/28	9,200,000.000	9,138,906.290	
		US T N/B 3.875 07/31/30	2,200,000.000	2,167,171.860	
		US T N/B 3.875 08/15/33	9,200,000.000	8,890,398.460	
		US T N/B 3.875 08/15/34	7,000,000.000	6,711,250.000	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,600,000.000	1,440,281.240	
		US T N/B 3.875 08/31/32	6,500,000.000	6,325,947.290	
		US T N/B 3.875 09/30/29	6,240,000.000	6,170,409.390	
		US T N/B 3.875 09/30/32	2,000,000.000	1,945,039.060	
		US T N/B 3.875 10/15/27	4,000,000.000	3,985,703.120	
		US T N/B 3.875 11/30/27	4,300,000.000	4,282,363.290	
		US T N/B 3.875 11/30/29	5,800,000.000	5,730,671.900	
		US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,579,156.250	
		US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,765,601.550	
		US T N/B 3.875 12/31/32	1,700,000.000	1,650,693.350	
		US T N/B 4.0 01/31/29	3,819,000.000	3,797,145.150	
		US T N/B 4.0 01/31/31	6,262,000.000	6,184,703.430	
		US T N/B 4.0 01/31/33	3,316,000.000	3,240,677.590	
		US T N/B 4.0 02/15/34	3,317,000.000	3,219,044.830	
		US T N/B 4.0 02/28/30	6,400,000.000	6,344,374.970	
		US T N/B 4.0 02/29/28	4,700,000.000	4,684,853.490	
		US T N/B 4.0 03/31/30	4,000,000.000	3,963,515.640	
		US T N/B 4.0 04/30/32	6,000,000.000	5,891,132.820	
		US T N/B 4.0 05/31/30	3,000,000.000	2,970,878.910	
		US T N/B 4.0 06/30/28	3,500,000.000	3,486,123.060	
		US T N/B 4.0 06/30/32	3,000,000.000	2,942,753.910	
		US T N/B 4.0 07/31/29	2,400,000.000	2,383,687.480	
		US T N/B 4.0 07/31/30	3,500,000.000	3,463,769.540	
		US T N/B 4.0 07/31/32	5,000,000.000	4,901,757.800	
		US T N/B 4.0 10/31/29	2,800,000.000	2,778,289.050	
		US T N/B 4.0 11/15/35	9,015,000.000	8,644,539.840	
		US T N/B 4.0 11/15/42	2,300,000.000	2,044,080.080	
		US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	3,993,937.490	
		US T N/B 4.0 12/15/27	4,400,000.000	4,388,656.270	
		US T N/B 4.125 02/15/36	8,800,000.000	8,509,875.000	
		US T N/B 4.125 02/29/32	3,000,000.000	2,967,480.480	
		US T N/B 4.125 03/31/29	3,800,000.000	3,789,089.850	
		US T N/B 4.125 03/31/31	2,200,000.000	2,183,070.310	
		US T N/B 4.125 03/31/32	3,500,000.000	3,460,078.120	
		US T N/B 4.125 05/31/31	4,000,000.000	3,968,750.000	
		US T N/B 4.125 05/31/32	4,800,000.000	4,741,218.760	
		US T N/B 4.125 06/15/29	9,600,000.000	9,571,125.020	
		US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,495,703.120	
		US T N/B 4.125 07/31/31	8,500,000.000	8,427,617.230	
		US T N/B 4.125 08/15/44	2,000,000.000	1,778,789.060	

		US T N/B 4.125 08/31/30	1,741,000.000	1,730,356.770	
		US T N/B 4.125 09/30/27	4,000,000.000	3,998,281.240	
		US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,337,782.030	
		US T N/B 4.125 10/31/29	4,000,000.000	3,984,140.640	
		US T N/B 4.125 10/31/31	2,500,000.000	2,476,025.400	
		US T N/B 4.125 11/15/27	8,000,000.000	7,993,281.280	
		US T N/B 4.125 11/15/32	4,000,000.000	3,942,500.000	
		US T N/B 4.125 11/30/29	4,000,000.000	3,983,828.120	
		US T N/B 4.125 11/30/31	6,714,000.000	6,647,515.680	
		US T N/B 4.25 01/15/28	5,500,000.000	5,503,437.500	
		US T N/B 4.25 01/31/30	3,000,000.000	2,998,593.750	
		US T N/B 4.25 02/15/28	4,300,000.000	4,302,855.450	
		US T N/B 4.25 02/15/54	11,300,000.000	9,885,513.680	
		US T N/B 4.25 02/28/29	3,930,000.000	3,931,995.690	
		US T N/B 4.25 02/28/31	2,334,000.000	2,329,213.470	
		US T N/B 4.25 05/15/35	8,000,000.000	7,842,343.750	
		US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	906,507.800	
		US T N/B 4.25 06/30/29	3,000,000.000	3,000,761.730	
		US T N/B 4.25 06/30/31	2,800,000.000	2,792,125.000	
		US T N/B 4.25 08/15/35	9,500,000.000	9,300,908.210	
		US T N/B 4.25 08/15/54	5,000,000.000	4,375,585.940	
		US T N/B 4.25 11/15/34	3,570,000.000	3,508,082.790	
		US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	1,872,148.440	
		US T N/B 4.375 01/31/32	4,548,000.000	4,555,283.890	
		US T N/B 4.375 02/15/38	500,000.000	490,351.560	
		US T N/B 4.375 05/15/34	7,000,000.000	6,954,472.620	
		US T N/B 4.375 05/15/36	7,500,000.000	7,389,257.850	
		US T N/B 4.375 05/15/40	994,000.000	948,726.400	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,750,000.000	1,653,818.350	
		US T N/B 4.375 07/15/27	3,500,000.000	3,508,301.750	
		US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,851,210.940	
		US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,510,732.430	
		US T N/B 4.375 11/15/39	500,000.000	479,570.310	
		US T N/B 4.375 11/30/28	4,690,000.000	4,705,114.270	
		US T N/B 4.375 11/30/30	3,000,000.000	3,009,257.820	
		US T N/B 4.375 12/31/29	3,800,000.000	3,814,324.200	
		US T N/B 4.5 02/15/36	2,102,000.000	2,109,061.410	
		US T N/B 4.5 02/15/44	1,300,000.000	1,218,191.400	
		US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,088,355.460	
		US T N/B 4.5 05/31/29	4,300,000.000	4,329,982.430	
		US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	954,772.640	
		US T N/B 4.5 11/15/33	7,100,000.000	7,124,683.570	
		US T N/B 4.5 11/15/54	4,500,000.000	4,105,458.990	
		US T N/B 4.5 12/31/31	2,000,000.000	2,015,820.320	
		US T N/B 4.625 02/15/35	8,200,000.000	8,266,464.850	
		US T N/B 4.625 02/15/40	1,390,000.000	1,365,077.720	
		US T N/B 4.625 02/15/46	2,180,000.000	2,057,885.940	
		US T N/B 4.625 04/30/29	4,250,000.000	4,293,413.070	
		US T N/B 4.625 04/30/31	3,000,000.000	3,040,957.020	
		US T N/B 4.625 05/15/44	2,000,000.000	1,901,054.680	

		US T N/B 4.625 05/15/54	4,600,000.000	4,284,199.230	
		US T N/B 4.625 05/31/31	2,000,000.000	2,027,148.440	
		US T N/B 4.625 09/30/28	4,600,000.000	4,638,363.260	
		US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,038,906.250	
		US T N/B 4.625 11/15/44	2,000,000.000	1,896,015.620	
		US T N/B 4.625 11/15/45	3,700,000.000	3,495,054.700	
		US T N/B 4.625 11/15/55	1,700,000.000	1,584,851.550	
		US T N/B 4.75 02/15/41	2,230,000.000	2,200,992.570	
		US T N/B 4.75 02/15/45	2,000,000.000	1,924,882.820	
		US T N/B 4.75 02/15/56	3,900,000.000	3,713,226.580	
		US T N/B 4.75 05/15/55	4,000,000.000	3,802,890.640	
		US T N/B 4.75 08/15/55	4,200,000.000	3,994,265.600	
		US T N/B 4.75 11/15/43	2,020,000.000	1,955,573.040	
		US T N/B 4.75 11/15/53	4,100,000.000	3,890,835.940	
		US T N/B 4.875 08/15/45	2,000,000.000	1,952,539.060	
		US T N/B 4.875 10/31/28	4,000,000.000	4,055,703.120	
		US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,556,494.150	
		US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	831,421.870	
		US T N/B 5.0 05/15/45	1,000,000.000	992,363.280	
		US T N/B 5.0 05/15/56	2,790,000.000	2,763,625.790	
		US T N/B 5.25 11/15/28	3,162,000.000	3,234,627.180	
		US T N/B 5.375 02/15/31	5,860,000.000	6,129,651.520	
		US T N/B 6.125 11/15/27	3,200,000.000	3,281,750.010	
		US T N/B 6.25 05/15/30	2,559,000.000	2,736,930.460	
アメリカ・ドル	小計		1,016,039,000.000 (164,730,403,070)	940,464,643.440 (152,477,532,640)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 0.125 01/31/28	2,190,000.000	2,065,071.180	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	3,570,000.000	2,913,280.050	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,990,000.000	1,688,366.910	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,680,000.000	1,531,809.910	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,160,000.000	503,792.090	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	3,521,000.000	2,444,563.290	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,340,000.000	462,227.720	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,035,000.000	462,867.670	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,135,000.000	1,655,027.410	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,030,000.000	1,822,881.360	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,370,000.000	1,967,827.630	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	3,250,000.000	2,054,011.700	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	1,166,000.000	333,313.520	
		UK TREASURY 1.25	1,210,000.000	1,176,193.440	

		07/22/27			
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,430,000.000	593,530.510	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,350,000.000	1,360,452.460	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	322,000.000	160,578.960	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	604,036.950	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,330,000.000	2,202,697.640	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	555,200.370	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	306,938.860	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,100,000.000	562,768.670	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,562,000.000	681,969.200	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,790,000.000	1,292,322.320	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	350,000.000	181,162.770	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,660,000.000	1,246,328.000	
		UK TREASURY 3.25 01/31/33	600,000.000	554,889.230	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,115,485.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	591,265.010	
		UK TREASURY 3.75 01/29/38	2,250,000.000	1,985,850.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,370,000.000	1,024,694.560	
		UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,330,678.990	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	991,316.980	
		UK TREASURY 4.0 05/22/29	800,000.000	793,539.770	
		UK TREASURY 4.0 10/22/31	2,200,000.000	2,152,916.260	
		UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,720,000.000	1,298,316.020	
		UK TREASURY 4.125 03/07/31	200,000.000	197,570.530	
		UK TREASURY 4.125 03/07/33	2,000,000.000	1,945,875.600	
		UK TREASURY 4.125 07/22/29	3,750,000.000	3,730,018.300	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,851,000.000	2,706,840.390	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,470,000.000	2,442,587.060	
		UK TREASURY 4.25 07/31/34	1,633,000.000	1,578,937.380	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,160,000.000	1,056,412.000	
		UK TREASURY 4.25	2,210,000.000	2,214,745.530	

		12/07/27			
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,401,000.000	2,154,871.290	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,830,000.000	1,546,191.530	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,147,000.000	950,681.770	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,163,000.000	937,377.240	
		UK TREASURY 4.375 01/31/40	1,300,000.000	1,192,026.440	
		UK TREASURY 4.375 03/07/28	1,550,000.000	1,553,701.240	
		UK TREASURY 4.375 03/07/30	3,020,000.000	3,022,710.140	
		UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,180,000.000	972,910.000	
		UK TREASURY 4.5 03/07/35	1,657,000.000	1,620,088.010	
		UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,850,000.000	1,858,861.310	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,850,000.000	1,820,719.680	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,245,000.000	1,125,231.000	
		UK TREASURY 4.625 01/31/34	2,200,000.000	2,189,505.580	
		UK TREASURY 4.625 03/07/37	500,000.000	483,750.000	
		UK TREASURY 4.75 10/22/35	1,990,000.000	1,970,736.800	
		UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,852,000.000	1,706,719.020	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,595,000.000	1,623,132.130	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,430,000.000	1,379,950.000	
		UK TREASURY 4.875 07/31/36	250,000.000	248,375.000	
		UK TREASURY 5.25 01/31/41	1,350,000.000	1,343,750.180	
		UK TREASURY 5.375 01/31/56	293,000.000	283,244.930	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,180,000.000	1,230,259.260	
イギリス・ポンド　小計			109,528,000.000 (23,757,718,480)	89,755,951.750 (19,468,963,494)	
	イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,700,000.000	1,716,073.500	
		ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	2,250,000.000	2,300,541.750	
		ISRAEL FIXED BOND 07/31/28	400,000.000	405,964.400	
		ISRAEL FIXED BOND 07/31/31	2,240,000.000	2,271,790.080	
		ISRAEL FIXED BOND	700,000.000	725,052.300	

	08/31/29			
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	3,310,000.000	3,037,663.130	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	4,280,000.000	3,794,686.520	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,440,000.000	2,733,396.480	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	2,275,000.000	1,727,004.820	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,810,000.000	3,721,486.080	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,707,955.820	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	300,000.000	301,813.200	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	2,242,000.000	2,628,895.200	
イスラエル・シュケル　小計		28,757,000.000 (1,545,421,310)	27,072,323.280 (1,454,885,604)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,500,000.000	1,252,545.000	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	2,320,000.000	2,001,371.200	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,950,000.000	2,455,344.000	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,110,000.000	965,300.400	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,490,000.000	750,334.200	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	4,578,000.000	3,867,173.940	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	880,000.000	845,908.800	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,060,000.000	1,921,135.400	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	728,400.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,350,000.000	1,150,537.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	830,000.000	811,233.700	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,540,576.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,750,000.000	2,608,265.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	778,532.500	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,070,000.000	959,800.700	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,400,000.000	2,327,304.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	550,000.000	459,013.500	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,820,000.000	1,661,914.800	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	880,000.000	796,681.600	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	221,000.000	207,134.460	
	AUSTRALIAN 4.25 03/21/36	2,700,000.000	2,578,797.000	
	AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	1,950,000.000	1,889,608.500	
	AUSTRALIAN 4.25 10/21/36	2,031,000.000	1,931,216.970	
	AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	557,000.000	533,138.120	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,068,000.000	1,060,791.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	800,000.000	727,296.000	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/37	870,000.000	858,089.700	
	AUSTRALIAN 5.0 06/21/36	900,000.000	910,683.000	
オーストラリア・ドル　小計		43,285,000.000 (4,866,965,400)	38,578,126.990 (4,337,724,599)	

	オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.26 05/25/29	30,000,000.000	29,968,625.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.32 02/25/29	7,000,000.000	7,012,991.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.4 11/25/28	9,000,000.000	9,026,532.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28	9,000,000.000	9,033,203.700	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27	47,000,000.000	47,160,467.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30	46,000,000.000	46,123,137.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	79,000,000.000	79,357,569.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28	57,000,000.000	57,278,969.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.49 12/25/31	14,000,000.000	14,010,287.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.5 04/15/31	30,000,000.000	30,089,301.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.54 01/25/31	4,000,000.000	4,019,854.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.55 07/25/30	10,000,000.000	10,076,541.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.56 06/15/33	45,000,000.000	45,002,115.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35	25,000,000.000	24,906,585.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	47,440,000.000	47,679,832.920	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30	37,000,000.000	37,349,516.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.65 05/15/35	12,000,000.000	11,974,452.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 03/25/33	3,000,000.000	3,021,812.100	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 12/25/32	23,000,000.000	23,163,576.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 05/25/35	34,050,000.000	34,064,838.990	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.72 05/15/36	42,100,000.000	42,034,091.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.74 10/15/29	27,000,000.000	27,345,589.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.75 02/25/36	14,300,000.000	14,319,955.650	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32	8,000,000.000	8,127,407.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 11/15/35	6,000,000.000	6,028,690.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND	35,000,000.000	35,576,149.000	

		1.79 03/25/32			
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.83 08/25/35	21,000,000.000	21,199,777.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	21,000,000.000	21,448,744.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	36,000,000.000	36,651,632.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 1.92 01/15/55	4,550,000.000	4,233,269.120	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 11/25/34	8,000,000.000	8,255,454.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	32,740,000.000	33,437,443.850	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	31,000,000.000	32,167,305.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	5,410,000.000	5,590,708.060	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	31,590,000.000	33,173,584.580	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	30,000,000.000	31,181,502.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	26,000,000.000	27,451,273.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	29,000,000.000	29,805,947.700	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.38 01/15/56	22,700,000.000	23,260,004.460	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	6,910,000.000	7,075,798.540	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,321,881.700	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	31,410,000.000	31,820,732.860	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	31,000,000.000	33,039,201.700	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	17,000,000.000	17,840,527.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	11,300,000.000	11,640,142.430	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	19,300,000.000	20,558,394.740	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	28,000,000.000	29,390,449.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	24,000,000.000	24,630,904.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	31,000,000.000	32,514,381.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,756,228.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	19,500,000.000	20,962,213.350	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	23,850,000.000	25,714,361.650	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	7,600,000.000	7,969,646.520	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	16,000,000.000	17,073,976.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,500,000.000	21,935,317.750	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	7,000,000.000	7,307,833.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,654,467.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	23,109,862.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,476,554.100	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,544,492.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	19,300,000.000	20,845,215.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	4,200,000.000	4,572,939.420	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	11,100,000.000	11,944,395.870	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	27,100,000.000	28,214,327.610	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	20,400,000.000	23,647,178.160	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	22,000,000.000	22,809,371.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	28,000,000.000	30,237,359.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,519,417.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	10,800,000.000	12,835,196.280	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 11/22/28	37,000,000.000	38,922,172.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	9,000,000.000	9,780,745.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,125,359.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	25,000,000.000	26,584,740.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	15,820,000.000	19,145,599.710	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	16,100,000.000	19,449,043.110	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	10,450,000.000	13,031,520.970	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.000	5,152,012.000	

		3.59 08/03/27			
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	11,600,000.000	14,812,631.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	13,590,000.000	17,419,274.680	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	16,300,000.000	21,005,661.670	
		CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,300,000.000	13,654,429.840	
	オフショア・人民元　小計		1,724,810,000.000 (41,191,739,939)	1,797,654,699.490 (42,931,409,768)	
	カナダ・ドル	CANADA 0.5 12/01/30	3,550,000.000	3,176,250.220	
		CANADA 1.25 06/01/30	1,940,000.000	1,812,014.610	
		CANADA 1.5 06/01/31	3,070,000.000	2,842,878.020	
		CANADA 1.5 12/01/31	1,840,000.000	1,687,402.670	
		CANADA 1.75 12/01/53	3,447,000.000	2,195,602.810	
		CANADA 2.0 06/01/28	3,030,000.000	2,985,123.390	
		CANADA 2.0 06/01/32	960,000.000	897,247.230	
		CANADA 2.0 12/01/51	1,760,000.000	1,220,423.420	
		CANADA 2.25 02/01/28	620,000.000	615,114.980	
		CANADA 2.25 06/01/29	1,300,000.000	1,276,266.480	
		CANADA 2.25 12/01/29	900,000.000	878,441.100	
		CANADA 2.5 05/01/28	1,100,000.000	1,093,872.710	
		CANADA 2.5 12/01/32	820,000.000	784,095.190	
		CANADA 2.75 03/01/30	1,750,000.000	1,732,426.250	
		CANADA 2.75 03/01/31	380,000.000	373,843.910	
		CANADA 2.75 06/01/33	1,740,000.000	1,681,529.790	
		CANADA 2.75 08/01/28	870,000.000	868,055.810	
		CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,051,176.410	
		CANADA 2.75 09/01/30	3,050,000.000	3,009,892.760	
		CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	417,291.370	
		CANADA 2.75 12/01/55	1,450,000.000	1,154,748.390	
		CANADA 2.75 12/01/64	550,000.000	422,546.730	
		CANADA 3.0 03/01/32	2,500,000.000	2,475,136.340	
		CANADA 3.0 06/01/34	1,259,000.000	1,226,925.630	
		CANADA 3.0 09/01/31	380,000.000	377,041.520	
		CANADA 3.25 06/01/35	3,208,000.000	3,162,150.740	
		CANADA 3.25 06/01/36	3,792,000.000	3,709,063.030	
		CANADA 3.25 09/01/28	500,000.000	503,948.280	
		CANADA 3.25 12/01/33	1,263,000.000	1,256,149.180	
		CANADA 3.25 12/01/34	1,070,000.000	1,058,292.520	
		CANADA 3.25 12/01/35	2,110,000.000	2,071,721.170	
		CANADA 3.5 03/01/28	3,130,000.000	3,165,137.060	
		CANADA 3.5 03/01/34	1,450,000.000	1,464,884.410	
		CANADA 3.5 09/01/29	1,300,000.000	1,319,548.940	
		CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	863,523.120	
		CANADA 3.5 12/01/57	1,150,000.000	1,063,016.590	
		CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,745,720.730	
		CANADA 4.0 06/01/41	197,000.000	203,657.000	
		CANADA 5.0 06/01/37	1,650,000.000	1,863,063.800	

	CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	689,490.460	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,010,000.000	1,161,421.660	
カナダ・ドル　小計		64,886,000.000 (7,424,256,120)	61,556,136.430 (7,043,253,130)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 07/01/31	1,290,000.000	1,276,196.770	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	710,000.000	671,304.850	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	540,000.000	507,869.940	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	910,000.000	921,520.600	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	600,000.000	612,300.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	244,512.000	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	880,000.000	914,319.820	
	SINGAPORE 2.75 03/01/35	360,000.000	378,899.920	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	470,000.000	512,997.950	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	819,659.910	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	640,769.910	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	202,940.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	520,000.000	543,077.600	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	120,000.000	124,200.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	153,000.000	182,376.100	
	SINGAPORE 3.25 06/01/54	160,000.000	194,368.800	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	550,000.000	601,974.890	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	595,000.000	647,359.880	
シンガポール・ドル　小計		9,678,000.000 (1,213,137,300)	9,996,648.940 (1,253,079,945)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,220,000.000	3,775,369.750	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	5,290,000.000	5,149,169.430	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	6,160,000.000	5,847,275.010	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	6,550,000.000	6,165,674.510	
	SWEDEN 2.25 05/11/35	1,140,000.000	1,097,056.200	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	5,530,000.000	5,442,919.550	
	SWEDEN 2.5 10/15/36	3,440,000.000	3,336,113.850	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,670,000.000	4,963,531.890	
スウェーデン・クローナ　小計		37,000,000.000 (618,270,000)	35,777,110.190 (597,835,511)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,980,000.000	5,213,092.050	
	DENMARK 0.25 11/15/52	5,063,000.000	2,408,324.110	
	DENMARK 0.5 11/15/27	2,850,000.000	2,781,840.820	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,040,000.000	3,785,514.850	
	DENMARK 2.25 11/15/33	3,240,000.000	3,133,144.140	
	DENMARK 2.25 11/15/35	2,994,000.000	2,828,431.800	
	DENMARK 4.5 11/15/39	5,519,000.000	6,374,089.560	
デンマーク・クローネ　小計		29,686,000.000 (733,837,920)	26,524,437.330 (655,684,091)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,050,000.000	989,666.810	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	2,610,000.000	2,318,985.000	
	NEW ZEALAND 1.75	400,000.000	265,615.040	

	05/15/41			
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,110,000.000	985,257.510	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	510,000.000	427,065.990	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	760,000.000	500,099.240	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	736,385.960	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	1,080,000.000	1,030,249.850	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	860,000.000	851,815.530	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	730,000.000	710,509.000	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	610,000.000	623,559.080	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	450,000.000	450,172.210	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	200,000.000	193,165.870	
ニュージーランド・ドル　小計		11,120,000.000 (1,036,828,800)	10,082,547.090 (940,096,691)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,850,000.000	2,450,080.060	
	NORWAY 1.375 08/19/30	8,610,000.000	7,658,336.700	
	NORWAY 1.75 09/06/29	5,120,000.000	4,724,945.640	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,526,000.000	2,431,376.040	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,230,000.000	1,092,779.880	
	NORWAY 3.0 08/15/33	5,000,000.000	4,608,819.740	
	NORWAY 3.5 10/06/42	2,366,000.000	2,135,325.630	
	NORWAY 3.625 04/13/34	1,570,000.000	1,501,084.850	
	NORWAY 3.625 05/31/39	5,052,000.000	4,699,206.200	
	NORWAY 3.75 06/12/35	1,810,000.000	1,735,986.970	
ノルウェー・クローネ　小計		36,134,000.000 (598,379,040)	33,037,941.710 (547,108,315)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.25 10/25/30	6,420,000.000	5,636,305.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	6,600,000.000	5,621,681.310	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	5,005,143.400	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,958,000.000	3,887,666.340	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,914,165.250	
	POLAND 4.0 07/25/31	950,000.000	922,351.590	
	POLAND 4.5 01/25/31	2,200,000.000	2,197,785.430	
	POLAND 4.5 07/25/30	3,300,000.000	3,310,659.000	
	POLAND 4.75 07/25/29	4,220,000.000	4,290,718.760	
	POLAND 5.0 01/25/30	6,993,000.000	7,152,080.950	
	POLAND 5.0 10/25/34	3,250,000.000	3,224,900.580	
	POLAND 5.0 10/25/35	4,150,000.000	4,077,516.590	
	POLAND 5.25 04/25/36	1,300,000.000	1,293,858.740	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,990,000.000	2,074,711.310	
	POLAND 6.0 10/25/33	4,862,000.000	5,160,672.660	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,400,000.000	2,563,017.600	
ポーランド・ズロチ　小計		59,653,000.000 (2,542,780,709)	58,333,234.510 (2,486,524,121)	
マレーシア・リ	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,931,327.670	

ンギット				
	MALAYSIA 3.476 07/02/35	4,080,000.000	4,036,831.880	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	3,100,000.000	3,114,920.920	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,019,568.200	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,400,000.000	1,385,072.500	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,306,281.630	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,690,267.930	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,100,000.000	1,119,711.340	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	661,000.000	667,630.160	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	1,050,000.000	1,070,749.890	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,480,000.000	1,484,503.040	
	MALAYSIA 4.18 05/16/44	700,000.000	721,713.860	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,070,000.000	2,148,381.780	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	900,000.000	942,681.150	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,820,000.000	1,937,805.680	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,248,057.840	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,643,002.170	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	250,000.000	267,010.270	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	2,190,000.000	2,393,941.980	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	800,000.000	886,480.720	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,500,000.000	3,815,047.950	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	500,000.000	550,953.800	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,240,000.000	1,405,551.270	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,798,652.640	
マレーシア・リンギット　小計		39,161,000.000 (1,556,309,049)	40,586,146.270 (1,612,946,215)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 02/28/30	11,500,000.000	11,611,536.890	
	MEXICAN BONDS 03/01/29	47,823,000.000	48,629,239.810	
	MEXICAN BONDS 03/02/28	18,000,000.000	18,336,060.000	
	MEXICAN BONDS 04/15/32	10,000,000.000	9,700,878.000	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	20,500,000.000	19,184,142.720	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,790,000.000	18,536,226.120	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	34,838,000.000	29,729,813.090	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	12,805,000.000	13,637,158.010	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	34,648,000.000	33,801,358.100	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	41,193,000.000	35,279,610.520	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	30,235,000.000	28,196,308.660	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	16,487,000.000	14,206,719.120	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	15,419,000.000	15,663,828.270	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,442,000.000	16,427,605.190	
メキシコ・ペソ　小計		330,680,000.000 (3,060,906,352)	312,940,484.500 (2,896,702,301)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,157,990.400	

		AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,630,000.000	1,428,815.620	
		AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	464,079.000	
		AUSTRIA 0.25 10/20/36	710,000.000	520,927.000	
		AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,434,667.200	
		AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	120,979.620	
		AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,214,000.000	1,177,701.400	
		AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	301,829.420	
		AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	92,233.500	
		AUSTRIA 0.9 02/20/32	850,000.000	759,602.500	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	650,000.000	439,062.150	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	86,165.000	
		AUSTRIA 1.85 05/23/49	921,000.000	649,461.570	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	221,929.500	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,580,000.000	1,497,565.870	
		AUSTRIA 2.8 09/20/32	500,000.000	493,550.000	
		AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,138,477.000	
		AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	442,530.000	
		AUSTRIA 2.9 05/23/29	798,000.000	801,429.160	
		AUSTRIA 2.95 02/20/35	1,470,000.000	1,438,395.000	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	510,208.870	
		AUSTRIA 3.15 10/20/53	200,000.000	176,078.500	
		AUSTRIA 3.2 02/20/36	1,100,000.000	1,090,320.000	
		AUSTRIA 3.2 07/15/39	491,000.000	474,600.600	
		AUSTRIA 3.75 03/20/56	127,000.000	123,456.700	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	480,000.000	471,483.450	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	530,000.000	566,874.050	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	637,015.890	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	996,545.960	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	740,000.000	631,518.440	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	930,000.000	833,931.000	
		BELGIUM 0.35 06/22/32	1,450,000.000	1,233,370.000	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	681,000.000	425,710.300	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	470,000.000	136,484.620	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	903,998.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	531,000.000	503,112.070	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,440,000.000	1,308,507.880	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	780,000.000	689,155.110	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	816,546.130	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	400,993.180	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	583,864.370	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	1,020,000.000	620,923.050	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	400,000.000	328,716.980	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	258,885.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	245,901.830	
		BELGIUM 2.6 10/22/30	500,000.000	492,867.310	
		BELGIUM 2.7 10/22/29	850,000.000	846,718.590	
		BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	285,692.900	
		BELGIUM 2.85 10/22/34	2,070,000.000	1,988,521.790	
		BELGIUM 3.0 06/22/33	800,000.000	787,965.780	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	1,180,000.000	1,151,491.160	

		BELGIUM 3.1 06/22/35	800,000.000	776,359.760	
		BELGIUM 3.3 06/22/54	620,000.000	509,181.200	
		BELGIUM 3.4 06/22/36	1,623,000.000	1,596,590.650	
		BELGIUM 3.45 06/22/42	660,000.000	612,707.640	
		BELGIUM 3.45 06/22/43	640,000.000	589,214.630	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	604,599.200	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	1,140,000.000	1,193,187.720	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	880,000.000	907,828.310	
		BELGIUM 4.35 06/22/56	380,000.000	372,235.580	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	870,000.000	969,973.870	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,673,652.800	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,580,000.000	2,539,158.600	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,050,000.000	2,017,897.000	
		BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,300,000.000	1,280,435.000	
		BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,200,000.000	1,182,192.000	
		BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,200,000.000	2,183,390.000	
		BUNDESOBL 2.2 10/10/30	800,000.000	783,104.000	
		BUNDESOBL 2.4 04/18/30	1,900,000.000	1,879,347.000	
		BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,000,000.000	1,988,700.000	
		BUNDESOBL 2.5 04/16/31	1,900,000.000	1,877,827.000	
		BUNDESOBL 2.5 10/11/29	1,500,000.000	1,491,645.000	
		BUNDESSCHAT 2.0 12/16/27	300,000.000	297,345.000	
		BUNDESSCHAT 2.1 03/15/28	700,000.000	693,665.000	
		BUNDESSCHAT 2.5 06/14/28	1,850,000.000	1,844,857.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,837,028.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,340,000.000	1,184,573.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,800,000.000	1,542,877.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,260,000.000	969,418.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,441,000.000	1,811,197.590	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,230,000.000	2,000,421.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,690,000.000	2,413,629.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	650,000.000	565,961.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,100,000.000	1,828,579.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,540,000.000	1,079,477.140	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,140,000.000	486,677.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,927,000.000	762,552.440	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,565,325.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	852,000.000	802,075.990	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,630,000.000	1,534,372.790	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	57,000.000	54,294.780	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	2,050,888.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,592,000.000	1,556,990.320	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	190,000.000	175,253.100	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	3,709,000.000	2,906,149.860	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	3,040,000.000	1,972,187.070	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,980,000.000	1,858,487.400	
		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,167,000.000	805,976.880	

		DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,400,000.000	969,374.000	
		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,700,000.000	1,668,380.000	
		DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	2,900,000.000	2,757,668.000	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,150,000.000	3,044,349.000	
		DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	827,000.000	799,353.390	
		DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	2,100,000.000	2,071,125.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	3,800,000.000	3,663,276.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,950,000.000	1,880,170.500	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,320,000.000	2,019,397.600	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	1,913,215.360	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	2,860,000.000	2,308,077.200	
		DEUTSCHLAND 2.5 11/15/32	1,600,000.000	1,568,128.000	
		DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,000,000.000	909,860.000	
		DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	803,000.000	731,613.300	
		DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,476,000.000	1,448,472.600	
		DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,700,000.000	1,657,024.000	
		DEUTSCHLAND 2.6 08/15/35	1,102,000.000	1,066,813.140	
		DEUTSCHLAND 2.9 02/15/36	2,352,000.000	2,325,681.120	
		DEUTSCHLAND 2.9 08/15/56	1,100,000.000	958,661.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,480,000.000	1,449,985.600	
		DEUTSCHLAND 3.4 05/15/47	500,000.000	490,535.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,230,000.000	1,328,281.050	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,080,000.000	1,192,017.600	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,055,000.000	1,097,505.950	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,720,000.000	1,942,138.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	1,865,700.200	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,720,000.000	1,917,834.400	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,140,000.000	2,231,784.600	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,640,000.000	1,831,174.800	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,250,000.000	1,296,737.500	
		FINLAND 0.0 09/15/30	110,000.000	97,708.890	
		FINLAND 0.125 04/15/36	693,000.000	507,742.880	
		FINLAND 0.125 04/15/52	660,000.000	254,680.140	
		FINLAND 0.125 09/15/31	1,100,000.000	951,826.960	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	180,791.130	
		FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	226,113.620	
		FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	390,221.380	
		FINLAND 0.5 09/15/28	530,000.000	505,835.800	
		FINLAND 0.5 09/15/29	715,000.000	665,794.710	
		FINLAND 0.75 04/15/31	500,000.000	452,281.300	
		FINLAND 1.125 04/15/34	770,000.000	662,088.350	
		FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	180,320.120	
		FINLAND 1.5 09/15/32	750,000.000	684,459.380	

		FINLAND 2.625 07/04/42	400,000.000	347,036.870	
		FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	343,003.020	
		FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	320,483.390	
		FINLAND 2.875 04/15/29	400,000.000	401,200.000	
		FINLAND 2.95 04/15/55	251,000.000	207,903.300	
		FINLAND 3.0 09/15/33	1,100,000.000	1,091,569.280	
		FINLAND 3.0 09/15/34	300,000.000	295,212.000	
		FINLAND 3.0 09/15/35	400,000.000	390,280.000	
		FINLAND 3.2 04/15/45	200,000.000	183,280.000	
		FINLAND 3.55 04/15/41	90,000.000	88,420.250	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,590,000.000	2,971,263.500	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,610,000.000	3,274,125.600	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,980,000.000	3,488,329.680	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,870,000.000	1,578,867.180	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	1,390,000.000	1,300,104.530	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,250,000.000	776,387.180	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	1,790,000.000	438,500.770	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	3,790,000.000	2,008,899.910	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	5,680,000.000	5,500,370.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,290,000.000	4,132,464.950	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,000,000.000	429,850.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,156,000.000	481,246.840	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,000,000.000	3,810,960.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,730,000.000	2,304,672.820	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,067,000.000	2,436,118.100	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/38	4,000,000.000	2,977,200.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,280,000.000	3,969,748.130	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,620,000.000	1,483,805.680	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,075,000.000	1,010,763.620	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	3,050,000.000	2,354,863.820	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,289,661.750	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,650,000.000	2,448,135.330	
		FRANCE OAT 2.4 09/24/28	700,000.000	693,675.500	
		FRANCE OAT 2.4 09/24/29	847,000.000	834,549.100	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,584,663.170	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/43	2,150,000.000	1,697,549.700	
		FRANCE OAT 2.5 09/24/27	4,300,000.000	4,289,110.250	
		FRANCE OAT 2.7 02/25/31	4,200,000.000	4,126,319.400	
		FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,710,000.000	3,698,651.110	
		FRANCE OAT 2.75 02/25/30	4,300,000.000	4,265,818.010	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,840,000.000	4,840,784.080	
		FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,120,000.000	3,041,243.400	
		FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,550,000.000	1,166,979.500	
		FRANCE OAT 3.0 06/25/49	2,150,000.000	1,704,850.550	
		FRANCE OAT 3.0 11/25/34	3,200,000.000	3,061,773.590	
		FRANCE OAT 3.2 05/25/35	2,050,000.000	1,978,837.320	
		FRANCE OAT 3.25 02/25/32	4,000,000.000	3,999,400.000	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	996,000.000	859,355.770	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/55	1,300,000.000	1,021,135.370	
		FRANCE OAT 3.5 11/25/33	9,100,000.000	9,108,827.000	

		FRANCE OAT 3.5 11/25/35	1,000,000.000	982,400.000	
		FRANCE OAT 3.6 05/25/42	1,300,000.000	1,204,840.000	
		FRANCE OAT 3.75 05/25/56	1,600,000.000	1,375,503.040	
		FRANCE OAT 3.8 06/25/37	1,000,000.000	993,300.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,386,465.870	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,060,000.000	1,833,677.060	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,340,000.000	1,342,066.280	
		FRANCE OAT 4.4 05/25/57	1,450,000.000	1,397,365.000	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,190,000.000	1,236,949.070	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,668,000.000	6,133,954.940	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	3,742,662.000	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,526,000.000	1,734,298.380	
		IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	314,053.980	
		IRISH 0.4 05/15/35	820,000.000	648,348.980	
		IRISH 0.55 04/22/41	610,000.000	403,325.950	
		IRISH 0.9 05/15/28	810,000.000	785,481.520	
		IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	698,724.770	
		IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	260,381.430	
		IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	506,103.490	
		IRISH 1.5 05/15/50	624,000.000	409,207.960	
		IRISH 1.7 05/15/37	547,000.000	467,694.410	
		IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	658,593.600	
		IRISH 2.4 05/15/30	970,000.000	956,990.490	
		IRISH 2.6 10/18/34	771,000.000	743,738.590	
		IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	259,009.440	
		IRISH 3.15 10/18/55	200,000.000	177,391.530	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,401,162.000	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,786,950.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,520,000.000	1,339,307.720	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,510,000.000	1,363,463.930	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	2,786,000.000	2,093,679.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,500,000.000	1,315,950.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,243,080.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,880,000.000	1,844,280.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,430,000.000	1,271,369.020	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,744,377.950	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	2,003,000.000	1,637,652.800	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,210,000.000	774,400.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,828,542.340	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,340,000.000	1,261,297.780	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,670,000.000	974,527.230	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	857,900.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	960,000.000	949,364.400	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,689,711.600	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	860,000.000	498,456.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,060,000.000	681,580.000	
		ITALY BTPS 2.2 02/28/28	1,996,000.000	1,977,237.600	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	750,000.000	655,425.000	
		ITALY BTPS 2.35 01/15/29	200,000.000	197,440.000	
		ITALY BTPS 2.4 03/15/29	1,800,000.000	1,777,140.000	

		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	980,000.000	919,969.510	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,180,000.000	831,900.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,700,000.000	1,618,910.000	
		ITALY BTPS 2.65 06/15/28	442,000.000	440,718.200	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	320,000.000	319,680.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	550,000.000	426,085.000	
		ITALY BTPS 2.7 10/01/30	1,000,000.000	984,600.000	
		ITALY BTPS 2.7 10/15/27	1,500,000.000	1,499,550.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,200,000.000	831,000.000	
		ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,800,000.000	1,794,780.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,939,729.370	
		ITALY BTPS 2.85 02/01/31	2,500,000.000	2,470,000.000	
		ITALY BTPS 2.95 07/01/30	1,200,000.000	1,194,960.000	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	720,000.000	649,224.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,710,000.000	1,715,016.280	
		ITALY BTPS 3.0 10/01/29	1,000,000.000	1,000,550.000	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,560,000.000	1,406,064.660	
		ITALY BTPS 3.15 03/15/33	1,800,000.000	1,772,640.000	
		ITALY BTPS 3.15 06/01/31	2,200,000.000	2,196,920.000	
		ITALY BTPS 3.15 11/15/31	1,400,000.000	1,395,520.000	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	694,000.000	651,804.800	
		ITALY BTPS 3.25 07/15/32	700,000.000	697,410.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,176,187.800	
		ITALY BTPS 3.25 11/15/32	2,100,000.000	2,085,090.000	
		ITALY BTPS 3.3 06/15/33	1,300,000.000	1,288,300.000	
		ITALY BTPS 3.35 07/01/29	1,400,000.000	1,415,960.000	
		ITALY BTPS 3.4 04/01/28	2,050,000.000	2,071,320.000	
		ITALY BTPS 3.45 02/01/36	620,000.000	606,236.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,140,000.000	991,275.870	
		ITALY BTPS 3.45 07/15/27	1,200,000.000	1,209,120.000	
		ITALY BTPS 3.45 07/15/31	2,500,000.000	2,532,000.000	
		ITALY BTPS 3.5 02/15/31	396,000.000	401,860.800	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,300,000.000	2,340,861.110	
		ITALY BTPS 3.6 10/01/35	2,000,000.000	1,985,600.000	
		ITALY BTPS 3.65 08/01/35	3,700,000.000	3,692,970.000	
		ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,700,000.000	1,739,780.000	
		ITALY BTPS 3.8 08/01/28	300,000.000	305,820.000	
		ITALY BTPS 3.85 02/01/35	1,000,000.000	1,016,400.000	
		ITALY BTPS 3.85 07/01/34	1,280,000.000	1,304,960.000	
		ITALY BTPS 3.85 10/01/40	1,600,000.000	1,556,800.000	
		ITALY BTPS 3.85 12/15/29	2,300,000.000	2,363,480.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,240,000.000	1,264,428.000	
		ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,106,000.000	1,135,862.000	
		ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,400,000.000	1,453,620.000	
		ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,035,400.000	
		ITALY BTPS 4.05 10/30/37	900,000.000	916,020.000	
		ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	823,760.000	
		ITALY BTPS 4.1 04/30/46	1,000,000.000	967,600.000	
		ITALY BTPS 4.15 10/01/39	1,260,000.000	1,275,120.000	
		ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,300,000.000	1,358,240.000	

		ITALY BTPS 4.3 10/01/54	900,000.000	866,250.000	
		ITALY BTPS 4.35 11/01/33	1,400,000.000	1,478,400.000	
		ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,300,000.000	1,378,650.000	
		ITALY BTPS 4.45 09/01/43	1,730,000.000	1,772,385.000	
		ITALY BTPS 4.5 10/01/53	1,270,000.000	1,265,936.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,480,000.000	1,538,800.400	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,549,734.080	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	860,000.000	946,172.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,590,000.000	1,750,749.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,050,000.000	1,155,420.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,860,000.000	2,117,238.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,560,000.000	1,757,652.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,105,073.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,240,000.000	1,161,336.590	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	860,000.000	590,807.960	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,646,000.000	659,851.770	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,075,397.080	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,300,000.000	1,130,072.770	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,160,000.000	1,078,844.650	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,160,000.000	799,447.210	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,800,000.000	1,571,580.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,300,000.000	1,277,054.220	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	630,000.000	607,083.430	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	890,000.000	639,901.530	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/30	580,000.000	575,223.980	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,081,556.800	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/33	250,000.000	242,545.000	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/34	2,000,000.000	1,924,200.000	
		NETHERLANDS 2.5 07/15/35	888,000.000	846,974.400	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,351,000.000	1,189,095.460	
		NETHERLANDS 2.75 07/15/36	430,000.000	415,058.570	
		NETHERLANDS 3.25 01/15/44	590,000.000	568,893.880	
		NETHERLANDS 3.5 01/15/56	490,000.000	478,093.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	990,000.000	1,022,298.240	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,520,000.000	2,702,700.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	490,000.000	510,825.000	
		PORTUGUESE 0.3 10/17/31	514,000.000	449,143.480	
		PORTUGUESE 1.0 04/12/52	50,000.000	26,036.620	
		PORTUGUESE 1.15 04/11/42	600,000.000	413,774.230	
		PORTUGUESE 1.95 06/15/29	500,000.000	489,300.000	
		PORTUGUESE 2.125 10/17/28	1,900,000.000	1,879,065.650	
		PORTUGUESE 2.25 04/18/34	2,400,000.000	2,247,392.880	

		PORTUGUESE 2.875 10/14/33	500,000.000	491,050.000	
		PORTUGUESE 2.875 10/20/34	400,000.000	389,723.600	
		PORTUGUESE 3.0 06/15/35	501,000.000	489,690.150	
		PORTUGUESE 3.375 06/15/40	400,000.000	385,008.000	
		PORTUGUESE 3.625 06/12/54	235,000.000	216,176.500	
		PORTUGUESE 3.875 02/15/30	98,000.000	101,660.300	
		PORTUGUESE 4.1 02/15/45	400,000.000	409,560.000	
		PORTUGUESE 4.1 04/15/37	2,170,000.000	2,292,961.530	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.625 01/21/31	730,000.000	686,261.760	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 2.0 10/17/47	500,000.000	341,668.390	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625 01/16/29	200,000.000	203,477.620	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625 11/04/37	500,000.000	489,987.960	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/23/35	1,020,000.000	1,034,129.650	
		SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 4.0 10/19/32	900,000.000	938,004.210	
		SPAIN 0.0 01/31/28	2,680,000.000	2,572,344.400	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,950,000.000	1,703,715.000	
		SPAIN 0.5 04/30/30	2,700,000.000	2,475,637.290	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,830,000.000	1,704,717.380	
		SPAIN 0.7 04/30/32	2,150,000.000	1,885,549.360	
		SPAIN 0.8 07/30/27	2,400,000.000	2,353,056.000	
		SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,599,700.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,202,831.510	
		SPAIN 1.0 07/30/42	1,640,000.000	1,076,824.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,499,000.000	787,583.500	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,420,000.000	1,017,064.560	
		SPAIN 1.25 10/31/30	2,000,000.000	1,868,300.000	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,470,000.000	1,437,588.280	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,431,853.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	350,000.000	337,970.450	
		SPAIN 1.45 10/31/27	842,000.000	829,300.700	
		SPAIN 1.45 10/31/71	1,010,000.000	457,186.080	
		SPAIN 1.85 07/30/35	2,091,000.000	1,846,025.060	
		SPAIN 1.9 10/31/52	470,000.000	301,658.320	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,070,000.000	1,033,976.490	
		SPAIN 2.35 03/31/29	500,000.000	492,250.000	
		SPAIN 2.35 07/30/33	517,000.000	489,599.000	
		SPAIN 2.4 05/31/28	1,500,000.000	1,491,270.000	
		SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,667,076.860	
		SPAIN 2.6 05/31/31	300,000.000	293,775.000	

		SPAIN 2.7 01/31/30	1,300,000.000	1,293,305.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,160,000.000	929,753.220	
		SPAIN 2.9 10/31/46	2,900,000.000	2,451,959.850	
		SPAIN 3.0 01/31/33	2,000,000.000	1,982,200.000	
		SPAIN 3.1 07/30/31	2,000,000.000	2,012,080.800	
		SPAIN 3.15 04/30/33	3,356,000.000	3,352,248.000	
		SPAIN 3.15 04/30/35	1,800,000.000	1,769,737.450	
		SPAIN 3.2 10/31/35	1,000,000.000	981,900.000	
		SPAIN 3.25 04/30/34	1,820,000.000	1,815,559.280	
		SPAIN 3.3 04/30/36	900,000.000	887,730.310	
		SPAIN 3.45 07/30/43	1,440,000.000	1,351,120.500	
		SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	952,790.100	
		SPAIN 3.45 10/31/34	2,150,000.000	2,168,809.060	
		SPAIN 3.5 01/31/41	800,000.000	769,411.220	
		SPAIN 3.5 05/31/29	2,600,000.000	2,651,441.000	
		SPAIN 3.55 10/31/33	2,337,000.000	2,385,843.300	
		SPAIN 3.9 07/30/39	260,000.000	264,372.080	
		SPAIN 3.95 10/31/56	420,000.000	399,324.960	
		SPAIN 4.0 10/31/54	900,000.000	871,718.910	
		SPAIN 4.2 01/31/37	2,885,000.000	3,051,251.580	
		SPAIN 4.7 07/30/41	700,000.000	767,392.080	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,136,526.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,748,312.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,110,000.000	1,279,929.780	
		SPAIN 5.75 07/30/32	2,135,000.000	2,449,217.110	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,116,350.370	
ユーロ　小計			567,535,000.000 (104,857,766,600)	520,981,224.230 (96,256,490,989)	
韓国・ウォン		KOREA TREASURY BOND (TAX) 4.0 12/10/31	2,800,000,000.000	2,789,513,916.000	
		KOREA TREASURY BOND 1.5 09/10/36	2,100,000,000.000	1,627,363,962.000	
		KOREA TREASURY BOND 1.875 03/10/51	3,360,000,000.000	2,051,103,667.200	
		KOREA TREASURY BOND 2.0 03/10/49	700,000,000.000	455,589,967.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.25 06/10/28	2,500,000,000.000	2,436,246,450.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.375 12/10/28	2,500,000,000.000	2,423,335,125.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.625 03/10/30	900,000,000.000	860,246,712.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.625 03/10/48	3,259,600,000.000	2,440,292,108.110	
		KOREA TREASURY BOND 2.625 09/10/55	3,835,000,000.000	2,694,978,638.950	
		KOREA TREASURY BOND 2.75 12/10/28	1,400,000,000.000	1,369,059,538.000	
		KOREA TREASURY BOND 2.875 09/10/44	2,000,000,000.000	1,612,856,720.000	

		KOREA TREASURY BOND 3.0 12/10/34	900,000,000.000	825,192,792.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/29	1,000,000,000.000	987,147,150.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/53	3,000,000,000.000	2,427,178,800.000	
		KOREA TREASURY BOND 3.25 12/10/35	1,500,000,000.000	1,385,559,945.000	
		KOREA TREASURY BOND 4.25 12/10/32	1,000,000,000.000	1,008,894,400.000	
		KOREA TREASURY BOND 4.75 12/10/30	1,830,000,000.000	1,885,418,805.000	
	韓国・ウォン　小計		34,584,600,000.000 (3,726,456,065)	29,279,978,696.260 (3,154,888,425)	
国債証券　合計			363,461,176,154.200 (363,461,176,154)	338,115,125,839 (338,115,125,839)	
合計				338,115,125,839 (338,115,125,839)	

(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	275銘柄	44.45	45.10
イギリス・ポンド	国債証券	66銘柄	5.67	5.76
イスラエル・シュケル	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	1.26	1.28
オフショア・人民元	国債証券	81銘柄	12.51	12.70
カナダ・ドル	国債証券	41銘柄	2.05	2.08
シンガポール・ドル	国債証券	18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	0.18
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.19	0.19
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	0.72	0.74
マレーシア・リンギット	国債証券	24銘柄	0.47	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.84	0.86
ユーロ	国債証券	398銘柄	28.06	28.47
韓国・ウォン	国債証券	17銘柄	0.92	0.93

(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。

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7月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	38,162,022,454
コール・ローン	1,363,237,517
株式	2,822,331,159,341
投資信託受益証券	2,992,192,914
投資証券	39,792,722,613
派生商品評価勘定	654,331,062
未収入金	71,754,685
未収配当金	1,633,097,767
差入委託証拠金	10,694,174,076
流動資産合計	2,917,694,692,429
資産合計	2,917,694,692,429
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,881,466
未払解約金	1,156,016,400
流動負債合計	1,187,897,866
負債合計	1,187,897,866
純資産の部	
元本等	
元本	209,201,845,654
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,707,304,948,909
元本等合計	2,916,506,794,563
純資産合計	2,916,506,794,563
負債純資産合計	2,917,694,692,429

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年7月13日現在
1．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	196,381,307,430円
同期中追加設定元本額	19,771,530,915円
同期中一部解約元本額	6,950,992,691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	32,054,184円
インデックスオープン・先進国株式	43,709,661円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,747,020,354円
たわらノーロード　先進国株式	96,234,745,489円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,761,925,617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）	63,431,043円
たわらノーロード　バランス（標準型）	798,829,342円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,407,495,048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）	70,393,993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）	346,138,688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）	457,016,820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）	720,339,619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）	774,155円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	20,932,175円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	10,847,985円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	24,607,919円
たわらノーロード　全世界株式	21,104,896,728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
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	57,331,497,994円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	4,405,866,026円
Ｏｎｅグローバルバランス	63,866,259円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	105,977,904円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	626,001,838円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	917,103,000円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	49,529,289円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	174,696,900円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	106,516,770円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	158,539,047円
ＤＩＡＭ　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	2,209,293,486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＞	502,751,188円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	151,232,245円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	399,735,980円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	295,749,271円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	470,119,330円
ワールドアセットバランス（基本コース）	38,755,655円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	93,853,272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）	56,762,643円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,309,355円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	197,601,818円

４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	174,773,439円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	151,099,905円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	88,925,973円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	81,836,054円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	66,301,509円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	37,156,002円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	255,007,027円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	16,561,111円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	21,454,685円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	660,593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）	5,566,101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）	8,173,309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）	14,528,629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）	11,143,075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）	6,265,841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）	16,161,985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）	11,963,870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）	211,811,280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）	11,983,205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）	837,244,624円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,027,481,420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）	2,573,627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）	8,959,472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）	1,603,990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）	6,141,035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）	22,183,579円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	792,564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）	36,597,513円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	103,662,320円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	389,778,513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）	10,770,513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	48,098,271円

投資家限定）	
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）	1,850,019円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	87,736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）	20,256,483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）	2,453,575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）	6,027,232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）	9,043,012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）	17,778,931円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	10,881,258円
コア資産形成ファンド	3,498,355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＞	3,299,647,130円
Ｏｎｅ外国株式インデックスファンド	122,300,354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＞	636,973,649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］	1,505,532,662円
計	209,201,845,654円
２．　受益権の総数	209,201,845,654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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその	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

差額	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7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	235,399,496,142
投資信託受益証券	△110,720,124
投資証券	886,927,984
合計	236,175,704,002

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	14,096,771	－	14,097,999	△1,228
イギリス・ポンド	14,096,771	－	14,097,999	△1,228
買建	1,214,148,461	－	1,214,196,486	48,025
アメリカ・ドル	987,105,143	－	987,131,021	25,878
オーストラリア・ドル	25,629,434	－	25,633,743	4,309
カナダ・ドル	41,987,148	－	41,990,488	3,340
ユーロ	159,426,736	－	159,441,234	14,498
合計	1,228,245,232	－	1,228,294,485	46,797

（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7月13日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	51,553,535,780	－	52,175,938,579	622,402,799
合計	51,553,535,780	－	52,175,938,579	622,402,799

（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7月13日現在
1口当たり純資産額	13.9411円
（1万口当たり純資産額）	（139,411円）

附属明細表
第１　有価証券明細表
（１）株式

2026年7月13日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	2,019,073	245.340	495,359,369.820	
	ABBOTT LABORATORIES	365,145	93.930	34,298,069.850	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	196,084	287.560	56,385,915.040	
	ADVANCED MICRO DEVICES	340,250	557.890	189,822,072.500	
	ADOBE INC	84,028	223.640	18,792,021.920	
	CHUBB LTD	71,817	347.830	24,980,107.110	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	45,147	299.530	13,522,880.910	
	ALLSTATE CORP	53,455	251.610	13,449,812.550	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	65,844	226.420	14,908,398.480	
AMGEN INC	112,890	363.390	41,023,097.100	
AMERICAN EXPRESS CO	110,609	350.580	38,777,303.220	
AMERICAN ELECTRIC POWER	112,689	135.430	15,261,471.270	
AFLAC INC	96,261	121.910	11,735,178.510	
AMERICAN INTL GROUP	114,176	79.170	9,039,313.920	
ANALOG DEVICES	102,108	395.650	40,399,030.200	
COMFORT SYSTEMS USA INC	7,434	1,756.090	13,054,773.060	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	127,012	142.810	18,138,583.720	
VALERO ENERGY CORP	62,618	280.690	17,576,246.420	
APPLE INC	3,062,506	315.320	965,669,391.920	
APPLIED MATERIALS INC	165,868	602.500	99,935,470.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	99,892	80.410	8,032,315.720	
AMEREN CORP	58,769	112.940	6,637,370.860	
AUTODESK INC	43,162	208.450	8,997,118.900	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	83,467	241.920	20,192,336.640	
AUTOZONE INC	3,422	3,072.640	10,514,574.080	
AVERY DENNISON CORP	15,877	160.710	2,551,592.670	
BALL CORP	51,188	61.690	3,157,787.720	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	290,122	493.710	143,236,132.620	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	141,767	151.920	21,537,242.640	
BECTON DICKINSON & CO	60,659	151.940	9,216,528.460	
AMETEK INC	47,821	233.980	11,189,157.580	
VERIZON COMM INC	875,009	42.120	36,855,379.080	
WR BERKLEY CORP	47,466	72.190	3,426,570.540	
BEST BUY CO INC	40,496	82.800	3,353,068.800	
YUM! BRANDS INC	56,238	163.540	9,197,162.520	
FIRSTENERGY CORP	116,401	47.920	5,577,935.920	
BOEING CO	156,060	222.280	34,689,016.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	308,522	44.770	13,812,529.940	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	25,595	193.500	4,952,632.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	36,292	243.200	8,826,214.400	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	4,439	1,296.170	5,753,698.630	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	422,005	57.580	24,299,047.900	
ONEOK INC	130,263	89.920	11,713,248.960	
UNITED RENTALS INC	13,076	1,095.550	14,325,411.800	
SEMPRA	137,609	94.200	12,962,767.800	
FEDEX CORP	46,333	314.690	14,580,531.770	
VERISIGN INC	16,703	270.110	4,511,647.330	
AMPHENOL CORP	257,033	159.060	40,883,668.980	
QUANTA SERVICES INC	31,029	658.560	20,434,458.240	

MASTEC INC	12,794	372.890	4,770,754.660	
CSX CORP	386,402	49.410	19,092,122.820	
CONSTELLATION BRANDS INC	30,084	134.060	4,033,061.040	
CARDINAL HEALTH INC	49,763	235.800	11,734,115.400	
CARLISLE COS INC	8,371	330.090	2,763,183.390	
CARNIVAL CORP LTD	261,654	26.830	7,020,176.820	
CASEY'S GENERAL STORES INC	7,897	819.830	6,474,197.510	
CATERPILLAR INC	97,107	952.410	92,485,677.870	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	16,461	131.700	2,167,913.700	
JPMORGAN CHASE & CO	559,467	336.470	188,243,861.490	
CHURCH & DWIGHT CO INC	47,891	96.360	4,614,776.760	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32,053	179.280	5,746,461.840	
CINTAS CORP	71,020	179.640	12,758,032.800	
CISCO SYSTEMS INC	824,874	121.310	100,065,464.940	
CLOROX COMPANY	25,012	96.560	2,415,158.720	
COCA-COLA CO/THE	808,150	83.490	67,472,443.500	
COPART INC	183,663	27.515	5,053,487.440	
COEUR MINING INC	203,453	15.980	3,251,178.940	
COLGATE-PALMOLIVE CO	157,014	92.240	14,482,971.360	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	45,093	376.110	16,959,928.230	
CIENA CORP	29,237	460.720	13,470,070.640	
NRG ENERGY, INC.	40,981	140.420	5,754,552.020	
COMCAST CORP-CL A	742,651	23.570	17,504,284.070	
CONSOLIDATED EDISON INC	76,947	111.120	8,550,350.640	
CMS ENERGY CORP	61,821	75.400	4,661,303.400	
COOPER COS INC	41,316	70.700	2,921,041.200	
CORNING INC	166,369	190.890	31,758,178.410	
HEICO CORP-CL A	14,337	254.070	3,642,601.590	
CUMMINS INC	28,593	675.950	19,327,438.350	
CURTISS-WRIGHT CORP	7,986	754.760	6,027,513.360	
DR HORTON INC	54,313	151.580	8,232,764.540	
DANAHER CORP	132,128	199.050	26,300,078.400	
MOODY'S CORP	31,208	487.280	15,207,034.240	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	96,679	42.570	4,115,625.030	
TARGET CORP	94,042	135.140	12,708,835.880	
DEERE & CO	50,789	586.860	29,806,032.540	
MORGAN STANLEY	247,137	222.280	54,933,612.360	
REPUBLIC SERVICES INC	42,963	219.200	9,417,489.600	
COSTAR GROUP INC	84,266	28.390	2,392,311.740	
DECKERS OUTDOOR CORP	29,843	105.990	3,163,059.570	
THE WALT DISNEY CO	369,664	95.620	35,347,271.680	
DOLLAR TREE INC	38,951	124.910	4,865,369.410	
DOVER CORP	28,812	215.330	6,204,087.960	
OMNICOM GROUP	64,516	81.930	5,285,795.880	
DTE ENERGY CO	42,598	150.270	6,401,201.460	

DUKE ENERGY CORP	160,388	125.480	20,125,486.240	
DARDEN RESTAURANTS INC	23,659	204.250	4,832,350.750	
EBAY INC	88,439	117.200	10,365,050.800	
BANK OF AMERICA CORP	1,416,742	59.670	84,536,995.140	
CITIGROUP INC	356,399	140.790	50,177,415.210	
EATON CORP PLC	81,141	407.280	33,047,106.480	
CADENCE DESIGN SYS INC	57,120	384.170	21,943,790.400	
ECOLAB INC	53,427	274.310	14,655,560.370	
ELECTRONIC ARTS INC	46,324	206.410	9,561,736.840	
SALESFORCE INC	168,374	163.320	27,498,841.680	
ERIE INDEMNITY CO	4,706	251.810	1,185,017.860	
EMERSON ELECTRIC CO	116,342	138.880	16,157,576.960	
ATMOS ENERGY CORP	33,172	176.200	5,844,906.400	
ENTERGY CORP	94,996	115.050	10,929,289.800	
EOG RESOURCES INC	113,261	134.100	15,188,300.100	
EQUIFAX INC	26,113	166.440	4,346,247.720	
EQT CORP	122,739	48.850	5,995,800.150	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	51,478	82.660	4,255,171.480	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	28,659	172.020	4,929,921.180	
NEXTERA ENERGY INC	435,734	87.960	38,327,162.640	
FAIR ISAAC CORP	4,652	1,250.900	5,819,186.800	
FASTENAL CO	241,833	46.490	11,242,816.170	
FIFTH THIRD BANCORP	185,702	57.070	10,598,013.140	
M&T BANK CORP	29,858	242.340	7,235,787.720	
FISERV INC	114,716	50.450	5,787,422.200	
FORD MOTOR CO	823,528	14.000	11,529,392.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	298,163	61.520	18,342,987.760	
FLEX LTD	75,823	135.800	10,296,763.400	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,770	2,092.590	3,703,884.300	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	52,875	253.090	13,382,133.750	
GENERAL DYNAMICS CORP	47,501	375.060	17,815,725.060	
GENERAL MILLS INC	108,036	36.220	3,913,063.920	
GENUINE PARTS CO	27,885	125.620	3,502,913.700	
GILEAD SCIENCES INC	259,984	129.830	33,753,722.720	
MCKESSON CORP	25,733	805.960	20,739,768.680	
NVIDIA CORP	4,815,572	210.960	1,015,893,069.120	
GRACO INC	36,793	74.000	2,722,682.000	
GE AEROSPACE	218,268	359.270	78,417,144.360	
WW GRAINGER INC	8,993	1,375.760	12,372,209.680	
HALLIBURTON CO	174,094	34.390	5,987,092.660	
MONSTER BEVERAGE CORP	149,257	97.390	14,536,139.230	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	61,622	1,055.180	65,022,301.960	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	38,546	290.770	11,208,020.420	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	18,620	96.960	1,805,395.200	
HEICO CORP	10,407	350.920	3,652,024.440	
HERSHEY FOODS CORP	30,749	173.660	5,339,871.340	
HP INC	182,679	24.220	4,424,485.380	

F5 INC	12,072	430.390	5,195,668.080	
UNITED THERAPEUTICS CORP	8,650	547.060	4,732,069.000	
HOME DEPOT INC	208,058	343.300	71,426,311.400	
CENTERPOINT ENERGY INC	137,066	43.540	5,967,853.640	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,572	552.030	3,627,941.160	
HUBBELL INC	11,173	490.940	5,485,272.620	
HUMANA INC	24,900	392.220	9,766,278.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,087	279.960	4,223,756.520	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	421,929	17.870	7,539,871.230	
COHERENT CORP	38,473	324.500	12,484,488.500	
BIOGEN INC	30,654	199.150	6,104,744.100	
IDEX CORP	16,502	222.160	3,666,084.320	
ILLINOIS TOOL WORKS	57,221	268.810	15,381,577.010	
INTUIT INC	57,242	274.960	15,739,260.320	
IDEXX LABORATORIES INC	16,673	563.570	9,396,402.610	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	45,948	479.700	22,041,255.600	
INTEL CORP	917,020	109.840	100,725,476.800	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	52,909	77.530	4,102,034.770	
INTERNATIONAL PAPER CO	108,812	37.930	4,127,239.160	
JABIL CIRCUIT INC	22,492	330.290	7,428,882.680	
INCYTE CORP	36,988	116.710	4,316,869.480	
EMCOR GROUP INC	9,483	781.780	7,413,619.740	
JOHNSON & JOHNSON	502,577	256.980	129,152,237.460	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	57,091	138.780	7,923,088.980	
KLA CORPORATION	271,150	231.520	62,776,648.000	
DEVON ENERGY CORP	225,955	42.230	9,542,079.650	
KEYCORP	192,791	23.300	4,492,030.300	
KIMBERLY-CLARK CORP	70,313	112.410	7,903,884.330	
KROGER CO	114,966	60.540	6,960,041.640	
LAM RESEARCH CORP	260,931	350.330	91,411,957.230	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,512	634.600	6,036,315.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	17,694	228.770	4,047,856.380	
LENNAR CORP	42,935	84.270	3,618,132.450	
ELI LILLY & CO	167,590	1,188.580	199,194,122.200	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	154,755	112.470	17,405,294.850	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,215	134.290	7,817,692.350	
LOCKHEED MARTIN CORP	43,478	523.220	22,748,559.160	
LOEWS CORP	35,267	114.990	4,055,352.330	
LOWE'S COS INC	115,849	211.630	24,517,123.870	
DOMINION ENERGY INC	182,410	70.080	12,783,292.800	
MCCORMICK & CO INC	50,907	52.450	2,670,072.150	
MCDONALD'S CORPORATION	148,185	274.600	40,691,601.000	
S&P GLOBAL INC	63,394	430.500	27,291,117.000	

EVEREST GROUP LTD	8,099	370.580	3,001,327.420	
MARKEL GROUP INC	2,702	1,949.750	5,268,224.500	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	119,668	92.210	11,034,586.280	
MARSH & MCLENNAN COS	101,475	178.310	18,094,007.250	
MASCO CORP	45,618	77.840	3,550,905.120	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	12,497	577.720	7,219,766.840	
METLIFE INC	116,995	91.650	10,722,591.750	
MEDTRONIC PLC	265,677	83.870	22,282,329.990	
CVS HEALTH CORP	266,404	104.150	27,745,976.600	
MERCK & CO. INC.	516,786	123.540	63,843,742.440	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	81,106	95.960	7,782,931.760	
MICROSOFT CORP	1,471,791	385.100	566,786,714.100	
MICRON TECH INC	235,331	979.300	230,459,648.300	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	114,202	88.590	10,117,155.180	
3M CO	110,526	157.520	17,410,055.520	
ENTEGRIS INC	32,728	145.350	4,757,014.800	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34,449	422.880	14,567,793.120	
ILLUMINA INC	30,724	190.200	5,843,704.800	
INSMED INC	43,039	115.610	4,975,738.790	
XCEL ENERGY INC	130,650	80.060	10,459,839.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19,683	177.110	3,486,056.130	
NETAPP INC	40,052	168.870	6,763,581.240	
NEWMONT CORP	224,428	95.290	21,385,744.120	
NVR INC	548	6,479.390	3,550,705.720	
NIKE INC-CL B	252,846	44.370	11,218,777.020	
NORDSON CORP	10,461	286.600	2,998,122.600	
NORFOLK SOUTHERN CORP	47,142	327.470	15,437,590.740	
EVERSOURCE ENERGY	79,691	74.820	5,962,480.620	
NISOURCE INC	105,928	46.900	4,968,023.200	
TAPESTRY INC	42,978	140.730	6,048,293.940	
NORTHERN TRUST CORP	36,485	183.550	6,696,821.750	
NORTHROP GRUMMAN CORP	27,740	539.630	14,969,336.200	
WELLS FARGO & CO	640,034	87.160	55,785,363.440	
NUCOR CORP	46,149	227.370	10,492,898.130	
CHENIERE ENERGY INC	43,236	258.640	11,182,559.040	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	124,666	201.520	25,122,692.320	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	149,419	52.890	7,902,770.910	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	39,038	227.625	8,886,024.750	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	176,606	86.280	15,237,565.680	
ORACLE CORP	360,500	140.640	50,700,720.000	
PACCAR INC	109,559	124.570	13,647,764.630	
PTC INC	25,446	124.740	3,174,134.040	
EXELON CORP	214,119	46.800	10,020,769.200	

PARKER HANNIFIN CORP	26,107	961.270	25,095,875.890	
PAYCHEX INC	69,211	107.540	7,442,950.940	
PPL CORPORATION	158,459	35.780	5,669,663.020	
PEPSICO INC	285,694	137.380	39,248,641.720	
PENTAIR PLC	35,336	76.190	2,692,249.840	
PFIZER INC	1,176,234	24.170	28,429,575.780	
CONOCOPHILLIPS	252,689	109.040	27,553,208.560	
PG&E CORP	445,717	17.170	7,652,960.890	
ALTRIA GROUP INC	349,369	71.790	25,081,200.510	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	83,119	251.910	20,938,507.290	
BROWN & BROWN INC	64,590	67.660	4,370,159.400	
GARMIN LTD	34,361	243.110	8,353,502.710	
PPG INDUSTRIES INC	48,069	116.760	5,612,536.440	
COSTCO WHOLESALE CORP	92,596	916.250	84,841,085.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	46,737	118.550	5,540,671.350	
QUEST DIAGNOSTICS	22,778	207.440	4,725,068.320	
PROCTER & GAMBLE CO	485,538	147.040	71,393,507.520	
PROGRESSIVE CORP	121,236	230.720	27,971,569.920	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	104,578	80.550	8,423,757.900	
PULTE GROUP INC	38,191	124.750	4,764,327.250	
GLOBAL PAYMENTS INC	50,003	76.040	3,802,228.120	
QUALCOMM INC	222,997	189.160	42,182,112.520	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	37,191	168.120	6,252,550.920	
RELIANCE INC	10,580	379.220	4,012,147.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	21,556	664.520	14,324,393.120	
RESMED INC	31,500	203.870	6,421,905.000	
US BANCORP	324,391	62.410	20,245,242.310	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	74,749	101.060	7,554,133.940	
ROSS STORES INC	65,030	222.880	14,493,886.400	
ROLLINS INC	59,922	44.470	2,664,731.340	
ROPER TECHNOLOGIES INC	22,280	355.900	7,929,452.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	23,385	472.120	11,040,526.200	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	52,772	285.370	15,059,545.640	
RPM INTERNATIONAL INC	26,441	105.100	2,778,949.100	
ACCENTURE PLC-CL A	129,265	135.230	17,480,505.950	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	270,317	58.830	15,902,749.110	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18,910	289.650	5,477,281.500	
AXON ENTERPRISE INC	16,148	565.800	9,136,538.400	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	43,946	338.920	14,894,178.320	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	109,688	41.980	4,604,702.240	
BOOKING HOLDINGS INC	163,340	178.390	29,138,222.600	
SLB LTD	310,327	47.760	14,821,217.520	

SCHWAB (CHARLES) CORP	345,023	103.120	35,578,771.760	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	40,666	91.340	3,714,432.440	
ELEVANCE HEALTH INC	45,380	416.230	18,888,517.400	
CENCORA INC	38,352	303.440	11,637,530.880	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	46,819	112.230	5,254,496.370	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	48,976	333.990	16,357,494.240	
CENTENE CORP	104,991	67.350	7,071,143.850	
SNAP-ON INC	10,624	401.940	4,270,210.560	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	71,227	115.370	8,217,458.990	
EDISON INTERNATIONAL	81,655	75.200	6,140,456.000	
SOUTHERN CO	232,889	95.610	22,266,517.290	
TRUIST FINANCIAL CORP	261,788	51.670	13,526,585.960	
AT&T INC	1,464,551	21.130	30,945,962.630	
CHEVRON CORP	385,230	176.400	67,954,572.000	
STATE STREET CORP	57,489	180.220	10,360,667.580	
STARBUCKS CORP	238,343	106.010	25,266,741.430	
STEEL DYNAMICS INC	27,961	228.420	6,386,851.620	
STRYKER CORP	71,389	329.780	23,542,664.420	
NETFLIX INC	879,150	73.370	64,503,235.500	
GEN DIGITAL INC	108,241	25.910	2,804,524.310	
SYNOPSYS INC	37,643	445.500	16,769,956.500	
SYSCO CORP	100,556	83.830	8,429,609.480	
INTUITIVE SURGICAL INC	74,477	406.780	30,295,754.060	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	245,473	32.950	8,088,335.350	
TERADYNE INC	32,525	359.600	11,695,990.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	190,219	311.460	59,245,609.740	
TEXTRON INC	38,875	90.910	3,534,126.250	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	77,874	527.050	41,043,491.700	
TRACTOR SUPPLY CO	106,564	30.430	3,242,742.520	
TRIMBLE INC	48,211	52.820	2,546,505.020	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,175	309.480	2,529,999.000	
TYSON FOODS INC	56,217	57.830	3,251,029.110	
UNION PACIFIC CORP	124,018	286.960	35,588,205.280	
RTX CORP	281,276	195.930	55,110,406.680	
UNITEDHEALTH GROUP INC	189,518	424.620	80,473,133.160	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	52,711	485.390	25,585,392.290	
VULCAN MATERIALS CO	27,770	295.250	8,199,092.500	
WALMART INC	914,544	113.900	104,166,561.600	
WASTE MANAGEMENT INC	83,039	233.330	19,375,489.870	
WATERS CORP	20,901	376.430	7,867,763.430	
WATSCO INC	7,083	383.860	2,718,880.380	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	14,539	353.710	5,142,589.690	
WESTERN DIGITAL CORP	72,349	582.585	42,149,442.160	
WABTEC CORP	35,994	261.210	9,401,992.740	

NASDAQ INC	94,302	88.080	8,306,120.160	
CME GROUP INC	74,932	240.270	18,003,911.640	
WILLIAMS COS INC	252,765	75.020	18,962,430.300	
WILLIAMS-SONOMA INC	25,542	221.750	5,663,938.500	
DICK'S SPORTING GOODS INC	13,092	217.980	2,853,794.160	
ALLIANT ENERGY CORP	51,637	76.400	3,945,066.800	
WEC ENERGY GROUP INC	68,860	114.960	7,916,145.600	
STRATEGY INC-CL A	54,158	94.640	5,125,513.120	
TJX COMPANIES INC	231,778	151.340	35,077,282.520	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	241,849	7.320	1,770,334.680	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	32,128	62.000	1,991,936.000	
TPG INC-CVR	42,879	0.010	428.790	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	28,128	298.760	8,403,521.280	
CBRE GROUP INC	61,907	139.530	8,637,883.710	
REGIONS FINANCIAL CORP	175,370	31.020	5,439,977.400	
DOMINO'S PIZZA INC	5,925	299.460	1,774,300.500	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9,572	1,352.740	12,948,427.280	
CRH PLC	140,824	104.710	14,745,681.040	
T-MOBILE US INC	102,826	187.610	19,291,185.860	
LAS VEGAS SANDS CORP	58,121	46.690	2,713,669.490	
DEXCOM INC	79,725	74.960	5,976,186.000	
EXPEDIA GROUP INC	24,767	270.830	6,707,646.610	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	116.920	3,620,895.480	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,656	506.760	9,454,114.560	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	116,878	135.260	15,808,918.280	
LIVE NATION	33,805	179.790	6,077,800.950	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	272,180	35.250	9,594,345.000	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	16,804	126.000	2,117,304.000	
TRANSDIGM GROUP INC	11,750	1,291.350	15,173,362.500	
MASTERCARD INC	170,622	526.740	89,873,432.280	
LEIDOS HOLDINGS INC	26,042	107.020	2,787,014.840	
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	149.870	5,082,391.440	
FIRST SOLAR INC	21,246	227.830	4,840,476.180	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	26,430	147.470	3,897,632.100	
SUPER MICRO COMPUTER INC	120,317	28.310	3,406,174.270	
DELTA AIR LINES INC	34,941	87.390	3,053,493.990	
INTERACTIVE BROKERS GROUP INC	91,011	94.090	8,563,224.990	
INSULET CORP	13,390	161.280	2,159,539.200	
LULULEMON ATHLETICA INC	21,544	119.260	2,569,337.440	

MERCADOLIBRE INC	9,454	1,852.220	17,510,887.880	
ULTA BEAUTY INC	8,638	469.200	4,052,949.600	
MSCI INC	15,204	604.710	9,194,010.840	
ECHOSTAR CORP	27,136	96.000	2,605,056.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	325,316	181.620	59,083,891.920	
VISA INC	350,509	348.970	122,317,125.730	
KEURIG DR PEPPER INC	267,013	31.670	8,456,301.710	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	41,490	130.690	5,422,328.100	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,372	283.740	17,697,431.280	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	391,550	32.120	12,576,586.000	
XYLEM INC	50,406	121.220	6,110,215.320	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	55,397	56.350	3,121,620.950	
FABRINET	7,484	471.130	3,525,936.920	
HCA HEALTHCARE INC	32,021	406.590	13,019,418.390	
VERISK ANALYTICS INC	28,116	185.390	5,212,425.240	
CORPAY INC	13,937	353.640	4,928,680.680	
NXP SEMICONDUCTOR NV	52,562	292.260	15,361,770.120	
TARGA RESOURCES CORP	44,143	273.350	12,066,489.050	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	22,166	268.070	5,942,039.620	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	47,078	66.620	3,136,336.360	
DOLLAR GENERAL CORP	46,691	118.920	5,552,493.720	
FORTINET INC	131,974	157.510	20,787,224.740	
HYATT HOTELS CORP	9,487	191.140	1,813,345.180	
NEBIUS GROUP NV	41,742	219.650	9,168,630.300	
TESLA INC	587,196	407.760	239,435,040.960	
GENERAL MOTORS CO	190,561	77.850	14,835,173.850	
XPO LOGISTICS INC	23,951	207.880	4,978,933.880	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	16,613	317.030	5,266,819.390	
PHILLIPS 66	82,619	188.360	15,562,114.840	
META PLATFORMS INC	458,229	669.210	306,651,429.090	
IQVIA HOLDINGS INC	36,118	207.850	7,507,126.300	
DIAMONDBACK ENERGY INC	39,671	183.390	7,275,264.690	
SERVICENOW INC	220,948	107.710	23,798,309.080	
PALO ALTO NETWORKS INC	169,625	325.910	55,282,483.750	
WORKDAY INC	42,662	138.950	5,927,884.900	
ABBVIE INC	369,382	248.080	91,636,286.560	
ZOETIS INC	90,719	75.560	6,854,727.640	
NEWS CORP/NEW-CL A	74,879	27.370	2,049,438.230	
CDW CORP	26,509	144.390	3,827,634.510	
HOWMET AEROSPACE INC	82,891	270.850	22,451,027.350	
COMPASS GROUP PLC	357,196	32.260	11,523,142.960	
TWILIO INC	30,284	214.560	6,497,735.040	
BLOOM ENERGY CORP	55,814	244.610	13,652,662.540	
OKTA INC	33,875	138.630	4,696,091.250	

BAKER HUGHES CO	208,416	57.560	11,996,424.960	
TECHNIPFMC LTD	83,671	71.850	6,011,761.350	
CNH INDUSTRIAL NV	197,606	10.450	2,064,982.700	
BROADCOM INC	938,361	399.970	375,316,249.170	
ARES MANAGEMENT CORP	43,107	121.810	5,250,863.670	
MONGODB INC	16,697	342.080	5,711,709.760	
BURLINGTON STORES INC	12,574	327.720	4,120,751.280	
VEEVA SYSTEMS INC	32,022	190.120	6,088,022.640	
EVERGY INC	48,779	85.710	4,180,848.090	
ALLEGION PLC	18,940	136.630	2,587,772.200	
STERIS PLC	21,164	216.000	4,571,424.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	30,259	479.770	14,517,360.430	
KKR & CO INC	128,333	96.940	12,440,601.020	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	11,993	96.330	1,155,285.690	
ZOOM COMMUNICATIONS INC	51,232	89.760	4,598,584.320	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	46,923	335.480	15,741,728.040	
CIGNA GROUP	54,639	293.460	16,034,360.940	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	30,052	165.300	4,967,595.600	
DELL TECHNOLOGIES INC	62,449	434.970	27,163,441.530	
DOW INC	145,651	29.030	4,228,248.530	
AMCOR PLC	91,979	43.180	3,971,653.220	
FOX CORP-A	44,561	54.120	2,411,641.320	
FOX CORP-B	27,507	48.750	1,340,966.250	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	204,744	187.180	38,323,981.920	
CLOUDFLARE INC	64,526	268.400	17,318,778.400	
TRADEWEB MARKETS INC	24,737	97.860	2,420,762.820	
CARRIER GLOBAL CORP	156,129	69.340	10,825,984.860	
OTIS WORLDWIDE CORP	83,060	73.090	6,070,855.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	368,438	74.540	27,463,368.520	
CORTEVA INC	140,971	85.680	12,078,395.280	
AST SPACEMOBILE INC	49,318	73.320	3,615,995.760	
BLACKSTONE INC	153,592	123.090	18,905,639.280	
CARLYLE GROUP INC	55,171	44.710	2,466,695.410	
DATADOG INC	65,725	257.540	16,926,816.500	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	45,665	910.340	41,570,676.100	
VERTIV HOLDINGS CO	75,128	318.860	23,955,314.080	
INGERSOLL RAND INC	79,632	78.850	6,278,983.200	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	95,719	64.700	6,193,019.300	
CIRCLE INTERNET GROUP INC	30,911	66.140	2,044,453.540	
REVOLUTION MEDICINES INC	33,656	186.880	6,289,633.280	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	173,819	17.480	3,038,356.120	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDING LTD	34,968	257.790	9,014,400.720	
FTAI AVIATION LTD	20,450	227.350	4,649,307.500	
AON PLC	42,810	356.940	15,280,601.400	

SOFI TECHNOLOGIES INC	255,173	18.780	4,792,148.940	
WARNER BROS DISCOVERY INC	492,714	26.590	13,101,265.260	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	11,625	397.820	4,624,657.500	
COINBASE GLOBAL INC	43,801	159.070	6,967,425.070	
ROCKET COS INC	193,900	14.390	2,790,221.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	57,758	83.420	4,818,172.360	
AIRBNB INC	87,646	148.620	13,025,948.520	
CONSTELLATION ENERGY CORP	63,717	251.380	16,017,179.460	
IREN LTD	65,395	41.140	2,690,350.300	
ASTERA LABS INC	28,584	412.970	11,804,334.480	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	60,836	30.550	1,858,539.800	
APPLOVIN CORP	47,450	506.980	24,056,201.000	
REDDIT INC	24,095	195.340	4,706,717.300	
ROYALTY PHARMA PLC	83,460	56.430	4,709,647.800	
ROBLOX CORP	123,872	55.350	6,856,315.200	
EXPAND ENERGY CORP	51,803	87.250	4,519,811.750	
BLACKROCK INC	30,807	1,036.110	31,919,440.770	
SNOWFLAKE INC	68,079	261.450	17,799,254.550	
DOORDASH INC	77,894	191.820	14,941,627.080	
ARISTA NETWORKS INC	223,290	186.960	41,746,298.400	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	88,471	120.340	10,646,600.140	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	455,106	126.790	57,702,889.740	
HONEYWELL AEROSPACE INC	65,844	220.750	14,535,063.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	52,125	49.530	2,581,751.250	
MEDLINE INC	76,732	41.040	3,149,081.280	
JACOBS SOLUTIONS INC	23,919	125.830	3,009,727.770	
MARVELL TECHNOLOGY INC	178,157	235.810	42,011,202.170	
LINDE PLC	96,776	529.790	51,270,957.040	
ROBINHOOD MARKETS INC	155,596	111.970	17,422,084.120	
IONQ INC	70,744	42.860	3,032,087.840	
TOAST INC	93,856	29.320	2,751,857.920	
GE VERNOVA INC	56,291	1,091.570	61,445,566.870	
GRAB HOLDINGS LTD	445,513	3.930	1,750,866.090	
SYNCHRONY FINANCIAL	70,641	72.440	5,117,234.040	
VERALTO CORP	47,699	92.700	4,421,697.300	
SAMSARA INC	67,082	36.720	2,463,251.040	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	41,459	96.130	3,985,453.670	
BUNGE GLOBAL SA	27,820	114.320	3,180,382.400	
KENVUE INC	396,743	19.480	7,728,553.640	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	90,573	70.340	6,370,904.820	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	35,245	322.050	11,350,652.250	
TE CONNECTIVITY PLC	61,795	200.360	12,381,246.200	

	SMURFIT WESTROCK PLC	110,186	44.230	4,873,526.780	
	SHARKNINJA INC	18,042	152.650	2,754,111.300	
	FERGUSON ENTERPRISES INC	40,472	227.460	9,205,761.120	
	LABCORP HOLDINGS INC	17,928	276.810	4,962,649.680	
	ROCKET LAB CORP	107,596	81.040	8,719,579.840	
	APTIV PLC	43,097	60.570	2,610,385.290	
	COREWEAVE INC	56,394	88.880	5,012,298.720	
	AMRIZE LTD	101,552	50.750	5,153,764.000	
	PINNACLE FINANCIAL PARTNERS INC	33,602	100.470	3,375,992.940	
	EXXONMOBIL HOLDINGS CORP	867,201	138.880	120,436,874.880	
	FEDEX FREIGHT HOLDING CO INC	22,425	149.530	3,353,210.250	
	QNITY ELECTRONICS INC	43,012	143.800	6,185,125.600	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	28,625	110.660	3,167,642.500	
	SPACE EXPLORATION TECHNOLOGIES CORP	109,224	145.300	15,870,247.200	
	LUMENTUM HOLDINGS INC	14,781	802.010	11,854,509.810	
	TRANSUNION	39,291	75.020	2,947,610.820	
	BLOCK INC	108,820	77.300	8,411,786.000	
	DUPONT DE NEMOURS INC	26,798	134.680	3,609,154.640	
	CARVANA CO	136,080	65.830	8,958,146.400	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	40,260	105.840	4,261,118.400	
	NATERA INC	27,136	269.950	7,325,363.200	
	KRAFT HEINZ CO	197,902	24.850	4,917,864.700	
	FORTIVE CORP	61,432	62.200	3,821,070.400	
	WASTE CONNECTIONS INC	54,243	171.070	9,279,350.010	
	ALPHABET INC-CL A	1,214,935	357.180	433,950,483.300	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	275,822	48.540	13,388,399.880	
	PAYPAL HOLDINGS INC	174,416	46.320	8,078,949.120	
	SEA LTD ADR	79,292	111.140	8,812,512.880	
	ALPHABET INC-CL C	964,659	355.030	342,482,884.770	
	EVERPURE INC-A	65,520	79.330	5,197,701.600	
	ZSCALER INC	23,062	139.270	3,211,844.740	
	ATLASSIAN CORP PLC	36,837	88.860	3,273,335.820	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	17,132	130.730	2,239,666.360	
	VISTRA CORP	70,177	158.860	11,148,318.220	
アメリカ・ドル　小計		76,294,056		13,451,567,300.520 (2,180,902,606,437)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	72,481	37.780	2,738,332.180	
	SEVERN TRENT PLC	59,179	29.600	1,751,698.400	
	BARCLAYS PLC	2,823,408	5.126	14,472,789.400	
	BT GROUP PLC	1,171,195	1.900	2,225,270.500	
	BUNZL PLC	61,315	26.880	1,648,147.200	
	AVIVA PLC	643,467	6.614	4,255,890.730	

DIAGEO PLC	461,394	15.240	7,031,644.560	
SCHRODERS PLC	168,541	5.865	988,492.960	
NATIONAL GRID PLC	1,045,429	12.260	12,816,959.540	
KINGFISHER PLC	336,026	2.752	924,743.550	
BAE SYSTEMS PLC	615,526	18.510	11,393,386.260	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	419,673	44.620	18,725,809.260	
HALMA PLC	76,539	36.400	2,786,019.600	
NEXT PLC	24,259	146.400	3,551,517.600	
IMPERIAL BRANDS PLC	150,861	27.130	4,092,858.930	
ANGLO AMERICAN PLC	220,325	36.210	7,977,968.250	
HSBC HOLDINGS PLC	3,583,435	14.710	52,712,328.850	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,077,905	2.910	3,136,703.550	
CENTRICA PLC	963,585	1.710	1,647,730.350	
UNILEVER PLC	458,995	45.990	21,109,180.050	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	143,835	13.440	1,933,142.400	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	74,161	19.880	1,474,320.680	
PEARSON PLC	116,743	12.680	1,480,301.240	
PRUDENTIAL PLC	531,270	10.430	5,541,146.100	
RIO TINTO PLC	220,198	67.530	14,869,970.940	
VODAFONE GROUP PLC	3,849,443	1.101	4,238,236.740	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	134,013	50.180	6,724,772.340	
RELX PLC	369,379	24.170	8,927,890.430	
RENTOKIL INITIAL PLC	492,609	4.400	2,167,479.600	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,759,419	14.384	25,307,482.890	
NATWEST GROUP PLC	1,679,747	6.624	11,126,644.120	
SSE PLC	258,385	24.260	6,268,420.100	
BP PLC	3,259,442	4.826	15,730,067.090	
THE SAGE GROUP PLC	186,583	8.290	1,546,773.070	
SMITHS GROUP PLC	70,278	25.080	1,762,572.240	
SPIRAX GROUP PLC	18,173	65.550	1,191,240.150	
STANDARD CHARTERED PLC	368,111	21.250	7,822,358.750	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,302,005	1.121	13,790,547.600	
TESCO PLC	1,344,395	4.718	6,342,855.610	
3I GROUP PLC	196,566	27.040	5,315,144.640	
SMITH & NEPHEW PLC	157,186	11.400	1,791,920.400	
GSK PLC	839,075	19.615	16,458,456.120	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	93,966	89.080	8,370,491.280	
ASTRAZENECA PLC	316,088	128.340	40,566,733.920	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	439,486	3.780	1,661,257.080	
INTERTEK GROUP PLC	29,397	58.100	1,707,965.700	
SAINSBURY (J) PLC	371,991	3.415	1,270,349.260	
ADMIRAL GROUP PLC	55,777	36.340	2,026,936.180	
EXPERIAN PLC	181,172	26.170	4,741,271.240	

	FRESNILLO PLC NPR	40,047	26.360	1,055,638.920	
	INFORMA PLC	259,912	8.934	2,322,053.800	
	GLENCORE PLC	1,951,650	5.105	9,963,173.250	
	COCA-COLA HBC AG	40,130	49.320	1,979,211.600	
	STANDARD LIFE PLC	135,828	8.685	1,179,666.180	
	AIRTEL AFRICA PLC	194,933	3.266	636,651.170	
	M&G PLC	454,395	3.478	1,580,385.810	
	ENDEAVOUR MINING PLC	46,892	36.760	1,723,749.920	
	HALEON PLC	1,841,743	3.618	6,663,426.170	
	SHELL PLC	1,171,974	30.385	35,610,429.990	
	WISE GROUP PLC	153,846	9.520	1,464,613.920	
	SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	86,319	55.260	4,769,987.940	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	253,295	4.760	1,205,684.200	
イギリス・ポンド　小計		50,923,395		468,298,892.500 (101,578,712,772)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	270,286	70.670	19,101,111.620	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	305,127	68.900	21,023,250.300	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,768	2,286.700	13,189,685.600	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	22,660	673.500	15,261,510.000	
	HAREL INSURANCE INVESTMENTS & FINANCES LTD	24,133	161.500	3,897,479.500	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	30.950	7,553,564.150	
	ICL GROUP LTD	161,905	14.570	2,358,955.850	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	50,192	168.600	8,462,371.200	
	NOVA LTD	6,546	1,422.500	9,311,685.000	
	ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD	29,169	249.500	7,277,665.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	214.700	6,321,626.800	
	AZRIELI GROUP	10,380	412.000	4,276,560.000	
	OPC ENERGY LTD	34,792	96.160	3,345,598.720	
イスラエル・シュケル　小計		1,194,459		121,381,064.240 (6,523,103,359)	
オーストラリア・ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	709,399	36.540	25,921,439.460	
	FORTESCUE LTD	330,859	18.470	6,110,965.730	
	TELSTRA GROUP LTD	824,041	4.900	4,037,800.900	
	LYNAS CORP LTD	171,192	16.630	2,846,922.960	
	ASX LTD	45,184	54.200	2,448,972.800	
	BHP GROUP LTD	1,062,241	58.280	61,907,405.480	
	COMPUTERSHARE LT	109,500	39.520	4,327,440.000	
	CSL LIMITED	100,489	122.890	12,349,093.210	
	REA GROUP LTD	9,317	149.140	1,389,537.380	
	TRANSURBAN GROUP	659,024	14.620	9,634,930.880	
	COCHLEAR LTD	12,995	121.620	1,580,451.900	
	ORIGIN ENERGY LTD	375,434	10.470	3,930,793.980	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	349,444	168.860	59,007,113.840	

	RIO TINTO LIMITED	76,617	164.490	12,602,730.330	
	APA GROUP	278,473	9.950	2,770,806.350	
	ARISTOCRAT LEISU	116,857	61.740	7,214,751.180	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444,982	8.190	3,644,402.580	
	PRO MEDICUS LTD	11,011	197.070	2,169,937.770	
	MACQUARIE GROUP LTD	76,331	254.490	19,425,476.190	
	SUNCORP GROUP LTD	235,880	18.760	4,425,108.800	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	643,442	39.610	25,486,737.620	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,494	10.410	1,868,532.540	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	313,634	25.470	7,988,257.980	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	291,421	20.480	5,968,302.080	
	SANTOS LTD	654,961	7.620	4,990,802.820	
	SONIC HEALTHCARE	88,200	21.240	1,873,368.000	
	WESFARMERS LTD	232,684	89.700	20,871,754.800	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	401,545	29.050	11,664,882.250	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	258,848	40.160	10,395,335.680	
	BRAMBLES LTD	276,036	18.740	5,172,914.640	
	PILBARA MINERALS LTD	657,319	4.630	3,043,386.970	
	EVOLUTION MINING LTD	441,358	11.630	5,132,993.540	
	CAR GROUP LTD	70,405	26.370	1,856,579.850	
	SGH LTD	39,806	44.270	1,762,211.620	
	XERO LTD	31,885	73.400	2,340,359.000	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	1,113,206	2.820	3,139,240.920	
	LOTTERY CORP LTD	486,416	5.480	2,665,559.680	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	627,081	36.050	22,606,270.050	
	MEDIBANK PVT LTD	629,748	5.040	3,173,929.920	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	76,399	44.020	3,363,083.980	
	SOUTH32 LTD(AUD)	867,426	4.020	3,487,052.520	
	COLES GROUP LTD	264,538	23.560	6,232,515.280	
	WISETECH GLOBAL LTD	38,698	34.000	1,315,732.000	
オーストラリア・ドル　小計		14,683,820		404,145,885.460 (45,442,163,361)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	104,626	207.940	21,755,930.440	
	BARRICK MINING CORP	345,227	51.900	17,917,281.300	
	BANK OF MONTREAL	142,910	253.390	36,211,964.900	
	BANK OF NOVA SCOTIA	255,687	124.140	31,740,984.180	
	NATIONAL BANK OF CANADA	80,178	229.930	18,435,327.540	
	BCE INC	68,397	30.280	2,071,061.160	
	BROOKFIELD CORP	416,157	61.980	25,793,410.860	
	BOMBARDIER INC 'B'	17,199	335.710	5,773,876.290	
	SAPUTO INC	56,192	41.530	2,333,653.760	
	DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	17,626	101.980	1,797,499.480	
	CGI INC	38,154	94.850	3,618,906.900	

CCL INDUSTRIES INC	27,743	90.090	2,499,366.870	
CAE INC	55,407	36.310	2,011,828.170	
CAMECO CORP	90,352	135.970	12,285,161.440	
ROGERS COMM-CL B	74,725	46.580	3,480,690.500	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	189,614	166.970	31,659,849.580	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	434,754	59.100	25,693,961.400	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	192.110	1,711,892.210	
CANADIAN UTILITIES LTD	31,617	52.630	1,664,002.710	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	106,683	176.190	18,796,477.770	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,184	74.330	2,763,886.720	
CELESTICA INC	24,243	509.880	12,361,020.840	
EMPIRE CO LTD	20,608	49.020	1,010,204.160	
KINROSS GOLD CORP	252,455	34.150	8,621,338.250	
RB GLOBAL INC	39,198	153.100	6,001,213.800	
FORTIS INC	105,011	81.230	8,530,043.530	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	149,612	39.260	5,873,767.120	
TELUS CORP	31,890	14.760	470,696.400	
GREAT WEST LIFECO INC	50,854	91.940	4,675,516.760	
IMPERIAL OIL LTD	32,165	170.770	5,492,817.050	
ENBRIDGE INC	458,286	77.340	35,443,839.240	
IGM FINANCIAL INC	12,478	84.000	1,048,152.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	347,046	58.520	20,309,131.920	
LOBLAW CO LTD	120,170	64.180	7,712,510.600	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	142,970	91.190	13,037,434.300	
MAGNA INTERNATIONAL INC	54,200	91.040	4,934,368.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	113,356	113.180	12,829,632.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,943	2,352.990	9,277,839.570	
METRO INC	40,887	93.640	3,828,658.680	
EMERA INC	64,335	75.560	4,861,152.600	
PAN AMERICAN SILVER CORP	87,130	61.840	5,388,119.200	
POWER CORP OF CANADA	108,654	91.040	9,891,860.160	
ROYAL BANK OF CANADA	291,515	298.810	87,107,597.150	
ATKINSREALIS GROUP INC	32,972	89.060	2,936,486.320	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	184,943	127.620	23,602,425.660	
STANTEC INC	22,549	98.080	2,211,605.920	
SUNCOR ENERGY INC	250,486	83.820	20,995,736.520	
LUNDIN MINING CORP	138,909	34.860	4,842,367.740	
TECK RESOURCES LTD-CL B	96,471	84.730	8,173,987.830	
THOMSON REUTERS CORP	29,819	126.670	3,777,172.730	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,754	229.830	4,080,401.820	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	345,709	170.860	59,067,839.740	
TC ENERGY CORP	219,961	95.370	20,977,680.570	
WESTON (GEORGE) LTD	36,807	100.980	3,716,770.860	

	INTACT FINANCIAL CORP	37,881	294.610	11,160,121.410	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	96,451	155.830	15,029,959.330	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,293	2,802.140	12,029,587.020	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	39,792	290.920	11,576,288.640	
	TOURMALINE OIL CORP	72,309	59.710	4,317,570.390	
	KEYERA CORP	54,385	57.380	3,120,611.300	
	WHITECAP RESOURCES INC	278,574	15.200	4,234,324.800	
	ALTAGAS LTD	59,998	53.660	3,219,492.680	
	PEMBINA PIPELINE CORP	119,897	67.270	8,065,471.190	
	DOLLARAMA INC	56,558	185.250	10,477,369.500	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	285,254	37.360	10,657,089.440	
	ARC RESOURCES LTD	112,620	31.090	3,501,355.800	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	73,200	29.830	2,183,556.000	
	TMX GROUP LTD	61,220	48.400	2,963,048.000	
	IVANHOE MINES LTD	179,721	10.760	1,933,797.960	
	NUTRIEN LTD	102,891	92.540	9,521,533.140	
	TFI INTERNATIONAL INC	17,141	208.850	3,579,897.850	
	WSP GLOBAL INC	28,163	172.830	4,867,411.290	
	IA FINANCIAL CORP INC	19,845	204.510	4,058,500.950	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	48,982	56.220	2,753,768.040	
	EQUINOX GOLD CORP	162,179	13.840	2,244,557.360	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	68,283	66.200	4,520,334.600	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	49.610	1,435,812.620	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	69,235	106.570	7,378,373.950	
	LUNDIN GOLD INC	22,677	78.230	1,774,021.710	
	SHOPIFY INC	256,861	173.510	44,567,952.110	
	FIRSTSERVICE CORP	7,857	202.940	1,594,499.580	
	HYDRO ONE LTD	68,595	58.570	4,017,609.150	
	ALAMOS GOLD INC	88,473	41.690	3,688,439.370	
カナダ・ドル　小計		9,049,006		893,578,758.480 (102,243,281,545)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	10.960	3,176,208.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.680	921,296.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	425,081	70.450	29,946,956.450	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	178,500	24.240	4,326,840.000	
	KEPPEL LTD	310,000	11.480	3,558,800.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	689,298	27.430	18,907,444.140	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,553,230	4.400	6,834,212.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	345,800	7.710	2,666,118.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	253,966	44.380	11,271,011.080	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	381,600	3.850	1,469,160.000	

	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	508,500	3.610	1,835,685.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.540	1,029,436.600	
シンガポール・ドル　小計		5,503,265		85,943,167.270 (10,772,976,017)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	30,835	82.620	2,547,587.700	
	NESTLE SA-REGISTERED	538,228	83.160	44,759,040.480	
	CIE FINANC RICHEMONT	111,046	182.200	20,232,581.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,599	264.000	2,006,136.000	
	SIKA INHABER	32,650	162.750	5,313,787.500	
	SGS SA-REG	32,234	94.680	3,051,915.120	
	NOVARTIS AG-REG SHS	383,167	124.280	47,619,994.760	
	BARRY CALLEBAUT AG	717	1,100.000	788,700.000	
	SWISSCOM AG-REG	5,126	618.500	3,170,431.000	
	ABB LTD	327,277	83.580	27,353,811.660	
	GEBERIT AG	6,586	521.400	3,433,940.400	
	LONZA GROUP AG-REG	14,580	586.000	8,543,880.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	217	9,250.000	2,007,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	94,700.000	1,894,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,936	3,433.000	6,646,288.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	30,974	614.200	19,024,230.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	7,648	341.000	2,607,968.000	
	HOLCIM LTD	105,046	74.140	7,788,110.440	
	SONOVA HOLDING AG	10,293	203.000	2,089,479.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	10,478	205.500	2,153,229.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	22,266	105.200	2,342,383.200	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6,261	203.000	1,270,983.000	
	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	16,170	214.000	3,460,380.000	
	SCHINDLER NAMEN	5,064	255.500	1,293,852.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,861	933.400	5,470,657.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	121.700	596,695.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	713.500	888,307.500	
	SWISS PRIME SITE AG	15,640	129.500	2,025,380.000	
	AVOLTA AG	21,652	52.850	1,144,308.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,868	685.400	3,336,527.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	44,986	72.760	3,273,181.360	
	SWISS RE LTD	63,364	132.600	8,402,066.400	
	BKW AG	3,194	132.500	423,205.000	
	ALCON INC	109,033	54.440	5,935,756.520	
	SANDOZ GROUP AG	85,536	67.780	5,797,630.080	
	BELIMO HOLDING AG	1,988	821.000	1,632,148.000	
	GALDERMA GROUP AG	38,378	172.850	6,633,637.300	
	UBS GROUP AG	663,723	42.060	27,916,189.380	
	ROCHE HOLDING AG	145,403	336.600	48,942,649.800	
	VAT GROUP AG	5,632	680.600	3,833,139.200	

スイス・フラン　小計		2,921,824		347,651,437.700 (69,568,529,198)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	528,528	191.100	101,001,700.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	289,975	167.200	48,483,820.000	
	ERICSSON LM-B SHS	553,049	110.200	60,945,999.800	
	LUNDBERGS B	14,872	553.500	8,231,652.000	
	SKF AB-B SHS	66,600	259.500	17,282,700.000	
	SANDVIK AB	220,531	390.900	86,205,567.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	300,082	200.900	60,286,473.800	
	SKANSKA AB-B SHS	62,329	253.600	15,806,634.400	
	SWEDBANK AB	172,346	364.000	62,733,944.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	138,616	99.360	13,772,885.760	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	288,078	143.400	41,310,385.200	
	TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	411.000	15,270,294.000	
	VOLVO AB-B SHS	327,975	336.900	110,494,777.500	
	TELE2 AB-B SHS	126,566	167.850	21,244,103.100	
	INDUSTRIVARDEN A	24,631	532.500	13,116,007.500	
	INDUSTRIVARDEN C	31,300	524.600	16,419,980.000	
	SAAB AB-B	63,945	546.500	34,945,942.500	
	SECURITAS AB-B SHS	99,643	162.700	16,211,916.100	
	INVESTOR AB-B SHS	359,667	394.400	141,852,664.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	166.000	17,375,054.000	
	ASSA ABLOY AB-B	208,377	335.300	69,868,808.100	
	TELIA CO AB	468,019	45.480	21,285,504.120	
	BOLIDEN AB	65,558	520.000	34,090,160.000	
	ALFA LAVAL AB	58,487	560.000	32,752,720.000	
	FASTIGHETS AB BALDER	117,966	53.060	6,259,275.960	
	INDUTRADE AB	58,393	210.400	12,285,887.200	
	NIBE INDUSTRIER AB	292,985	35.420	10,377,528.700	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	471.200	17,142,727.200	
	HEXAGON AB-B SHS	449,215	81.400	36,566,101.000	
	SAGAX AB	44,607	162.000	7,226,334.000	
	EPIROC AB-A	125,482	257.600	32,324,163.200	
	EPIROC AB-B	80,804	219.800	17,760,719.200	
	ESSITY AB-B	115,540	277.900	32,108,566.000	
	EQT AB	97,156	280.100	27,213,395.600	
	ADDTECH AB	47,848	329.200	15,751,561.600	
	OCTAVE INTELLIGENCE PLC	40,410	163.250	6,596,932.500	
	BEIJER REF AB	71,081	138.400	9,837,610.400	
	LIFCO AB	49,888	318.400	15,884,339.200	
	EVOLUTION AB	26,852	684.000	18,366,768.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	190.900	5,276,094.200	
スウェーデン・クローナ　小計		6,293,243		1,331,967,699.340 (22,257,180,256)	
デンマーク・ク	CARLSBERG AS-B	18,112	920.600	16,673,907.200	

ローネ					
	A P MOLLER A/S	851	15,745.000	13,398,995.000	
	AP MOLLER MAERSK A	296	15,370.000	4,549,520.000	
	DANSKE BANK A/S	126,706	367.500	46,564,455.000	
	GENMAB A/S	12,165	1,868.500	22,730,302.500	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	75,035	425.000	31,889,875.000	
	ROCKWOOL AS	16,770	205.200	3,441,204.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	674,469	322.250	217,347,635.250	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	195,996	175.350	34,367,898.600	
	COLOPLAST-B	25,816	401.000	10,352,216.000	
	DSV A/S	40,848	1,659.500	67,787,256.000	
	DEMANT A/S	17,700	272.200	4,817,940.000	
	TRYG A/S	79,447	154.400	12,266,616.800	
	PANDORA A/S	14,742	758.800	11,186,229.600	
	ORSTED A/S	106,744	146.900	15,680,693.600	
デンマーク・クローネ　小計		1,405,697		513,054,744.550 (12,682,713,285)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	384,915	8.850	3,406,497.750	
	CONTACT ENERGY L	183,385	9.200	1,687,142.000	
	FISHER & PAYKEL	116,144	40.250	4,674,796.000	
	INFRATIL LTD	218,942	15.500	3,393,601.000	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.670	1,356,876.360	
ニュージーランド・ドル　小計		1,142,694		14,518,913.110 (1,353,743,458)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	102,370	185.700	19,010,109.000	
	NORSK HYDRO ASA	280,113	85.060	23,826,411.780	
	TELENOR ASA	119,422	144.800	17,292,305.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	89,335	299.500	26,755,832.500	
	ORKLA ASA	156,830	105.700	16,576,931.000	
	EQUINOR ASA	141,794	329.500	46,721,123.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	444.500	13,074,523.000	
	AKER BP ASA	72,231	308.500	22,283,263.500	
	SALMAR ASA	12,897	462.400	5,963,572.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	41,223	271.800	11,204,411.400	
	DNB BANK ASA	173,149	298.800	51,736,921.200	
	VAR ENERGI ASA	184,231	42.060	7,748,755.860	
ノルウェー・クローネ　小計		1,403,009		262,194,160.640 (4,341,935,300)	
ユーロ	RYANAIR HOLDINGS	88,153	26.840	2,366,026.520	
	KERRY GROUP PLC-A	31,648	82.750	2,618,872.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	29,826	79.550	2,372,658.300	
	AIR LIQUIDE	131,640	174.300	22,944,852.000	
	AIRBUS SE	124,468	197.260	24,552,557.680	
	AXA SA	324,162	44.270	14,350,651.740	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	124,161	36.280	4,504,561.080	
	ADIDAS AG	35,785	181.850	6,507,502.250	
	GENERALI	167,223	42.060	7,033,399.380	

DASSAULT AVIATION SA	4,132	287.000	1,185,884.000	
DANONE	132,926	72.420	9,626,500.920	
SAFRAN SA	72,398	336.100	24,332,967.800	
INTESA SANPAOLO	2,927,862	6.259	18,325,488.250	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	66,066	58.140	3,841,077.240	
ACCOR SA	38,165	48.990	1,869,703.350	
BOUYGUES	46,470	46.700	2,170,149.000	
BPER BANCA SPA	330,915	13.978	4,625,529.870	
BNP PARIBAS	207,979	100.700	20,943,485.300	
THALES SA	20,059	223.300	4,479,174.700	
CAPGEMINI SA	30,992	88.960	2,757,048.320	
LOTUS BAKERIES NV	77	11,220.000	863,940.000	
UNICREDIT SPA	282,635	82.970	23,450,225.950	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	15,271	255.300	3,898,686.300	
D'IETEREN TRDG	4,146	172.900	716,843.400	
COMMERZBANK AG	134,133	38.640	5,182,899.120	
EIFFAGE	15,947	121.300	1,934,371.100	
FRESENIUS SE & CO KGAA	84,108	42.570	3,580,477.560	
PUBLICIS GROUPE	48,685	87.160	4,243,384.600	
IBERDROLA SA	1,274,623	20.900	26,639,620.700	
ENI SPA	377,838	20.755	7,842,027.690	
INDRA SISTEMAS SA	15,276	47.450	724,846.200	
JERONIMO MARTINS	45,606	16.380	747,026.280	
KESKO OYJ-B	56,685	19.270	1,092,319.950	
KBC GROUPE	47,056	120.200	5,656,131.200	
HANNOVER RUECK SE	11,943	250.000	2,985,750.000	
WARTSILA OYJ	101,897	30.240	3,081,365.280	
L'OREAL	49,413	381.000	18,826,353.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	52,023	489.900	25,486,067.700	
GEA GROUP AG	31,889	60.100	1,916,528.900	
BOLLORE	114,808	4.110	471,860.880	
MICHELIN(CGDE)-B	136,013	34.870	4,742,773.310	
CONTINENTAL AG	21,977	72.860	1,601,244.220	
DEUTSCHE POST AG-REG	188,184	56.300	10,594,759.200	
OMV AG	31,189	59.900	1,868,221.100	
VERBUND AG	16,118	57.300	923,561.400	
PERNOD-RICARD	42,072	64.200	2,701,022.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	33,246	27.180	903,626.280	
RENAULT SA	34,278	25.810	884,715.180	
REPSOL SA	228,703	23.120	5,287,613.360	
MERCK KGAA	25,862	139.700	3,612,921.400	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	93,273	75.800	7,070,093.400	
RWE AG	118,579	56.060	6,647,538.740	
SOCIETE GENERALE-A	131,179	74.260	9,741,352.540	
VINCI S.A.	96,469	119.000	11,479,811.000	

SODEXO	17,430	52.950	922,918.500	
SOFINA	3,443	226.400	779,495.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	114,637	269.650	30,911,867.050	
SAP SE	219,552	137.580	30,205,964.160	
TELEFONICA S.A	760,673	3.526	2,682,132.990	
TOTALENERGIES SE	412,031	68.380	28,174,679.780	
E.ON SE	476,410	18.960	9,032,733.600	
HENKEL AG & CO KGAA	25,036	70.150	1,756,275.400	
SIEMENS AG-REG	155,312	272.850	42,376,879.200	
UPM-KYMMENE OYJ	103,401	23.150	2,393,733.150	
ING GROEP NV-CVA	614,900	28.415	17,472,383.500	
BAYER AG	202,870	50.120	10,167,844.400	
STORA ENSO OYJ-R SHS	136,215	9.442	1,286,142.030	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,704	74.500	2,212,948.000	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	150,471	43.990	6,619,219.290	
BASF SE	184,768	47.550	8,785,718.400	
BEIERSDORF AG	18,636	77.820	1,450,253.520	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	77,021	26.480	2,039,516.080	
HOCHTIEF AG	3,095	455.200	1,408,844.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	28,177	171.100	4,821,084.700	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	42,494	41.930	1,781,773.420	
ASM INTERNATIONAL NV	9,599	910.400	8,738,929.600	
ORANGE	389,060	15.870	6,174,382.200	
SAMPO OYJ-A SHS	484,110	9.600	4,647,456.000	
ALLIANZ SE	79,532	421.600	33,530,691.200	
EDP SA	624,219	4.469	2,789,634.710	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	182,188	35.910	6,542,371.080	
HERMES INTL	5,368	1,641.500	8,811,572.000	
ENDESA S.A.	63,990	38.990	2,494,970.100	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	9.512	1,033,450.260	
ERSTE GROUP BANK AG	63,085	117.600	7,418,796.000	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	26,927	503.600	13,560,437.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	88,596	58.020	5,140,339.920	
DASSAULT SYSTEMES SA	134,189	18.235	2,446,936.410	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35,984	120.000	4,318,080.000	
RHEINMETALL STAMM	9,643	992.000	9,565,856.000	
HEINEKEN NV	57,687	75.800	4,372,674.600	
AKZO NOBEL	34,435	57.400	1,976,569.000	
ASML HOLDING NV	81,060	1,569.000	127,183,140.000	
AEGON LTD	232,433	7.700	1,789,734.100	
BANKINTER S.A.	139,390	15.360	2,141,030.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	44,646	70.980	3,168,973.080	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,181,006	22.480	26,549,014.880	
KERING	14,490	248.500	3,600,765.000	

ACCIONA S.A.	5,005	250.200	1,252,251.000	
FORTUM OYJ	95,817	19.545	1,872,743.260	
AGEAS	31,169	70.750	2,205,206.750	
UCB SA	25,044	237.100	5,937,932.400	
NEMETSCHEK SE	10,222	56.200	574,476.400	
CARREFOUR SA	125,695	16.490	2,072,710.550	
NATURGY ENERGY GROUP SA	84,865	28.040	2,379,614.600	
NOKIA OYJ	1,058,501	10.895	11,532,368.390	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	158,010	24.060	3,801,720.600	
WOLTERS KLUWER-CVA	47,174	60.500	2,854,027.000	
SANOFI	226,323	76.230	17,252,602.290	
STMICROELECTRONICS NV	131,433	62.000	8,148,846.000	
ELISA OYJ	34,206	36.180	1,237,573.080	
BANCO SANTANDER SA	2,981,707	12.138	36,191,959.560	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	85,537	15.390	1,316,414.430	
QIAGEN N.V.	41,781	36.405	1,521,037.300	
DEUTSCHE BANK AG-REG	384,233	31.350	12,045,704.550	
BUZZI UNICEM	14,138	44.470	628,716.860	
ENEL SPA	1,599,428	10.120	16,186,211.360	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,704,453	1.036	1,765,813.300	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	721,944	26.120	18,857,177.280	
SARTORIUS AG	4,533	242.000	1,096,986.000	
LEONARDO SPA	82,251	51.820	4,262,246.820	
CTS EVENTIM AG	11,578	56.500	654,157.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	270,188	72.480	19,583,226.240	
RATIONAL AG	860	636.500	547,390.000	
KONINKLIJKE KPN NV	794,750	4.249	3,376,892.750	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	68.960	1,588,700.480	
DEUTSCHE BOERSE AG	37,265	249.000	9,278,985.000	
BANCO SABADELL	1,070,505	3.219	3,445,955.590	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15,900	77.750	1,236,225.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	25,531	68.950	1,760,362.450	
INDITEX	228,635	54.960	12,565,779.600	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	413,654	11.268	4,661,053.270	
MAPFRE SA	164,994	4.416	728,613.500	
ESSILORLUXOTTICA	63,640	171.400	10,907,896.000	
SNAM SPA	390,173	6.170	2,407,367.410	
CREDIT AGRICOLE SA	183,415	17.490	3,207,928.350	
TENARIS SA	76,002	24.130	1,833,928.260	
TELECOM ITALIA SPA	342,839	7.992	2,739,969.280	
TERNA SPA	302,512	10.245	3,099,235.440	
BIOMERIEUX	6,736	69.800	470,172.800	
NESTE OYJ	84,986	29.680	2,522,384.480	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	26,147	54.700	1,430,240.900	
RECORDATI SPA	23,751	51.300	1,218,426.300	

DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	103,040	5.586	575,581.440	
MTU AERO ENGINES AG	10,833	362.100	3,922,629.300	
KONE OYJ	67,111	49.530	3,324,007.830	
ELIA GROUP	10,817	136.700	1,478,683.900	
FINANCIERE DE TUBIZE SA	3,656	208.600	762,641.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	6,975	183.300	1,278,517.500	
ENGIE	376,351	26.880	10,116,314.880	
ALSTOM	68,028	15.670	1,065,998.760	
IPSEN SA	8,274	162.700	1,346,179.800	
LEGRAND SA	54,032	140.700	7,602,302.400	
ADP	6,104	111.600	681,206.400	
ORION OYJ	21,796	69.650	1,518,091.400	
METSO CORPORATION	133,678	15.260	2,039,926.280	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	19.570	1,557,478.450	
SYMRISE AG	26,736	88.600	2,368,809.600	
REXEL SA	41,104	38.330	1,575,516.320	
PRYSMIAN SPA	58,055	135.050	7,840,327.750	
CAIXABANK	740,939	12.525	9,280,260.970	
BUREAU VERITAS SA	72,096	27.200	1,961,011.200	
GETLINK	72,777	18.480	1,344,918.960	
EDP RENEWABLES SA	67,001	13.750	921,263.750	
AMADEUS IT GROUP SA	93,451	50.740	4,741,703.740	
BRENNTAG SE	28,127	56.220	1,581,299.940	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	253,234	5.522	1,398,358.140	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	16.340	699,940.240	
TALANX AG	13,274	110.700	1,469,431.800	
VONOVIA SE	164,754	21.440	3,532,325.760	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	192,866	17.720	3,417,585.520	
KNORR-BREMSE AG	14,544	101.700	1,479,124.800	
ITALGAS SPA	122,960	9.922	1,220,009.120	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65,799	34.590	2,275,987.410	
FERRARI NV	24,750	331.000	8,192,250.000	
ASR NEDERLAND NV	34,744	68.040	2,363,981.760	
AYVENS SA	65,316	11.890	776,607.240	
AIB GROUP PLC	449,244	10.425	4,683,368.700	
NORDEA BANK ABP	626,610	16.815	10,536,447.150	
MONCLER SPA	43,309	49.940	2,162,851.460	
PROSUS NV	268,508	39.545	10,618,148.860	
DR ING HC F PORSCHE AG	27,385	45.130	1,235,885.050	
EXOR NV	16,552	68.550	1,134,639.600	
SIEMENS ENERGY AG	162,311	152.120	24,690,749.320	
HENSOLDT AG	13,720	74.320	1,019,670.400	
INPOST SA	60,024	15.470	928,571.280	
EURONEXT NV	16,722	148.000	2,474,856.000	
NN GROUP NV	58,369	76.180	4,446,550.420	
FINECOBANK SPA	124,605	22.850	2,847,224.250	

	ARGENX SE	12,682	763.800	9,686,511.600	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	207,674	18.910	3,927,115.340	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	91,652	41.870	3,837,469.240	
	DSM-FIRMENICH AG	36,128	83.480	3,015,965.440	
	IBERDROLA SA-RTS	1,274,623	0.417	531,517.790	
	SYENSQO SA	15,096	66.000	996,336.000	
	ZALANDO SE	42,234	26.950	1,138,206.300	
	STELLANTIS NV	404,098	4.834	1,953,409.730	
	FERROVIAL NV	98,621	56.800	5,601,672.800	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	39,582	13.490	533,961.180	
	MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	91,000	16.308	1,484,028.000	
	CSG NV	39,041	13.602	531,035.680	
	VERISURE PLC	50,000	10.255	512,750.000	
	AENA SME SA	149,081	26.940	4,016,242.140	
	CELLNEX TELECOM SAU	95,346	25.180	2,400,812.280	
	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	35,984	1.791	64,447.340	
	BANCO BPM SPA	232,070	15.645	3,630,735.150	
	ABN AMRO BANK NV	126,896	38.030	4,825,854.880	
	SCOUT24 SE	15,592	73.100	1,139,775.200	
	BANCA MEDIOLANUM SPA	55,270	22.360	1,235,837.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	184,485	69.660	12,851,225.100	
	POSTE ITALIANE SPA	98,274	28.700	2,820,463.800	
	AMUNDI SA	11,288	87.500	987,700.000	
	ABIVAX SA	11,120	122.900	1,366,648.000	
	BAWAG GROUP AG	15,890	176.300	2,801,407.000	
	ADYEN NV	5,508	846.600	4,663,072.800	
	DELIVERY HERO SE	34,547	36.210	1,250,946.870	
ユーロ　小計		39,460,143		1,368,639,892.340 (252,869,906,509)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	331,796	76.600	25,415,573.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	127,814	60.600	7,745,528.400	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	249,091	385.000	95,900,035.000	
	MTR CORP	356,941	31.220	11,143,698.020	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	25.360	7,556,569.920	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	257,320	58.450	15,040,354.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,376,406	6.630	15,755,571.780	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	431,904	31.480	13,596,337.920	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	753,495	45.340	34,163,463.300	
	SINO LAND CO	659,200	10.310	6,796,352.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	280,565	118.000	33,106,670.000	

	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	87.600	4,644,552.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	309,156	125.700	38,860,909.200	
	AIA GROUP LTD	2,186,316	72.650	158,835,857.400	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	11.950	9,525,775.200	
	SANDS CHINA LTD	588,200	13.340	7,846,588.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	276,000	33.520	9,251,520.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	351,135	22.840	8,019,923.400	
	WH GROUP LTD	1,550,000	7.940	12,307,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	536,445	70.000	37,551,150.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	379,695	45.460	17,260,934.700	
香港・ドル　小計		13,149,607		570,324,363.840 (11,794,307,844)	
合計		223,424,218		2,822,331,159,341 (2,822,331,159,341)	

（２）株式以外の有価証券

2026年7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル　小計		2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券　合計			2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	408,319.000	12,237,320.430	
		SCENTRE GROUP	1,177,078.000	4,567,062.640	
		STOCKLAND	480,103.000	1,910,809.940	
		VICINITY CENTRES	815,965.000	2,154,147.600	
	オーストラリア・ドル　小計		2,881,465.000	20,869,340.610 (2,346,548,658)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	867,778.000	2,186,800.560	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,214,726.000	2,963,931.440	
	シンガポール・ドル　小計		2,082,504.000	5,150,732.000 (645,644,256)	
投資信託受益証券　合計			4,963,969	2,992,192,914 (2,992,192,914)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN TOWER CORP	96,877.000	16,332,493.430	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	133,913.000	3,061,251.180	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,084.000	5,387,634.560	
		CROWN CASTLE INC	88,932.000	7,084,323.120	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	71,051.000	12,818,310.910	
		EQUINIX INC	20,410.000	21,455,196.100	
		EQUITY RESIDENTIAL	71,367.000	4,902,199.230	

		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,115.000	3,849,908.250	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	45,042.000	6,484,246.320	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	57,433.000	2,479,956.940	
		INVITATION HOMES INC	129,667.000	3,838,143.200	
		IRON MOUNTAIN INC	62,808.000	7,631,800.080	
		KIMCO REALTY	136,267.000	3,390,322.960	
		MID AMERICA	23,159.000	3,132,254.750	
		PROLOGIS INC	192,985.000	27,185,796.950	
		PUBLIC STORAGE	33,500.000	10,738,760.000	
		REALTY INCOME CORP	195,908.000	12,402,935.480	
		REGENCY CENTERS CORP	33,164.000	2,640,517.680	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	22,004.000	4,181,420.120	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	68,177.000	14,915,082.290	
		SUN COMMUNITIES INC	25,617.000	3,045,348.960	
		VENTAS INC	101,588.000	9,209,968.080	
		VICI PROPERTIES INC	222,086.000	5,776,456.860	
		WELLTOWER INC	147,493.000	34,157,903.870	
		WEYERHAEUSER CO	143,943.000	3,375,463.350	
		WP CAREY INC	44,884.000	3,216,387.440	
	アメリカ・ドル　小計		2,209,474.000	232,694,082.110 (37,726,691,533)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	176,057.000	1,174,300.190	
		SEGRO PLC	250,449.000	2,157,367.680	
	イギリス・ポンド　小計		426,506.000	3,331,667.870 (722,672,078)	
	ユーロ	COVIVIO	8,731.000	465,798.850	
		GECINA SA	8,697.000	627,488.550	
		KLEPIERRE	48,371.000	1,748,127.940	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,812.000	2,338,230.000	
	ユーロ　小計		88,611.000	5,179,645.340 (956,991,273)	
	香港・ドル	LINK REIT	499,016.000	18,683,159.040	
	香港・ドル　小計		499,016.000	18,683,159.040 (386,367,729)	
投資証券　合計			3,223,607	39,792,722,613 (39,792,722,613)	
合計				42,784,915,527 (42,784,915,527)	

（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	組入新株予約権証券	組入投資信託受益証券	組入投資証券時価比	有価証券の合計金額に対する比率（%）

			率 (%)	時価比率 (%)	時価比率 (%)	率 (%)	
アメリカ・ドル	株式	516銘柄	74.78	－	－	－	77.44
	投資証券	26銘柄	－	－	－	1.29	
イギリス・ポンド	株式	62銘柄	3.48	－	－	－	3.57
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.02	
イスラエル・シュケル	株式	13銘柄	0.22	－	－	－	0.23
オーストラリア・ドル	株式	43銘柄	1.56	－	－	－	1.67
	投資信託受益証券	4銘柄	－	－	0.08	－	
カナダ・ドル	株式	83銘柄	3.51	－	－	－	3.57
	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	0.37	－	－	－	0.40
	投資信託受益証券	2銘柄	－	－	0.02	－	
スイス・フラン	株式	40銘柄	2.39	－	－	－	2.43
スウェーデン・クローナ	株式	40銘柄	0.76	－	－	－	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	216銘柄	8.67	－	－	－	8.86
	投資証券	4銘柄	－	－	－	0.03	
香港・ドル	株式	21銘柄	0.40	－	－	－	0.43
	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。

Ｊー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7月13日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,478,296,328
投資証券	188,371,467,450
派生商品評価勘定	185,676,430
未収入金	464,317,879
未収配当金	1,954,499,143
差入委託証拠金	231,855,135
流動資産合計	194,686,112,365
資産合計	194,686,112,365
負債の部	
流動負債	
前受金	181,705,200
未払解約金	429,772,000
流動負債合計	611,477,200
負債合計	611,477,200
純資産の部	
元本等	
元本	72,926,748,393
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	121,147,886,772
元本等合計	194,074,635,165
純資産合計	194,074,635,165
負債純資産合計	194,686,112,365

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年7月13日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	71,941,057,995円
同期中追加設定元本額	15,226,692,319円
同期中一部解約元本額	14,241,001,921円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード　国内リート	7,380,649,613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）	53,015,589円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,531,029,111円
たわらノーロード　バランス（積極型）	2,413,591,314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）	418,999,639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）	1,377,028,796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）	1,074,320,317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）	1,344,760,060円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	6,722,544円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	100,757,624円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	33,410,327円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	49,017,634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）	12,805,389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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	149,418,663円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	267,854,432円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	666,528,631円
投資のソムリエ	3,438,684,574円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	792,925,160円
ＤＩＡＭ　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	821,857,922円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,332,952,982円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	91,357,307円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	48,249,656円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	9,196,496円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	317,824,216円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	447,104,654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）	116,963,336円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	56,991,921円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	31,916,588円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	14,079,263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）	562,745円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	88,708,806円
Ｏｎｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（隔月決算型）	54,558,961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）	128,521,551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）	24,215,258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）	70,583,837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）	227,703,018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）	28,725,654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）	62,969,867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）	79,623,047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）	70,504,237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）	27,186,388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）	79,261,840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）	114,415,419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）	464,652,417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）	83,269,111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）	128,156,676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）	526,786,326円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,744,900,583円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	16,801,952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）	39,021,218円

リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,497,773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）	422,042,866円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	6,036,526,271円
Ｏｎｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	21,721,804,380円
Ｏｎｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,253,447,816円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ専用＞	6,671,222,371円
計	72,926,748,393円
２．　受益権の総数	72,926,748,393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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期

	間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	5,710,848,749
合計	5,710,848,749

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち１年超		
市場取引 先物取引 買建	4,968,037,300	－	5,154,028,000	185,990,700
合計	4,968,037,300	－	5,154,028,000	185,990,700

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6612円 （26,612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7月13日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	7,384	1,041,144,000	
	ＧＬＰ投資法人	57,753	8,073,869,400	
	ＫＤＸ不動産投資法人	51,181	7,927,936,900	
	ＭＩＲＡＲＴＨ不動産投資法人	12,777	1,057,935,600	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	17,674	2,363,013,800	
	Ｏｎｅリート投資法人	10,463	791,002,800	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	8,757	971,151,300	
	いちごオフィスリート投資法人	12,582	1,162,576,800	
	いちごホテルリート投資法人	2,905	348,890,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	27,099	3,704,433,300	
	アドバンス・レジデンス投資法人	36,142	5,403,229,000	
	イオンリート投資法人	21,313	2,661,993,700	
	インヴィンシブル投資法人	96,888	5,784,213,600	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,885	456,099,000	
	オリックス不動産投資法人	69,944	6,854,512,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	13,795	1,528,486,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	26,592	2,794,819,200	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,862	459,945,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,623	639,335,100	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	74,810	5,820,218,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	14,717	2,045,663,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	92,189	11,025,804,400	
	スターアジア不動産投資法人	32,345	1,791,913,000	
	スターツプロシード投資法人	2,934	548,951,400	
	セントラル・リート投資法人	2,847	299,504,400	
	トーセイ・リート投資法人	3,816	511,344,000	
	ヒューリックリート投資法人	15,509	2,420,954,900	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,555	504,694,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	3,210	340,260,000	
	ユナイテッド・アーバン投資	40,466	6,531,212,400	

	法人			
	ラサールロジポート投資法人	22,007	3,230,627,600	
	霞ヶ関ホテルリート投資法人	2,184	211,192,800	
	阪急阪神リート投資法人	8,368	1,163,988,800	
	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	30,303	3,715,147,800	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	38,757	4,243,891,500	
	三井不動産商業ファンド投資法人	30,848	2,501,772,800	
	三菱地所物流リート投資法人	17,876	2,166,571,200	
	産業ファンド投資法人	32,038	4,565,415,000	
	森トラストリート投資法人	33,832	2,527,250,400	
	森ヒルズリート投資法人	20,315	2,636,887,000	
	星野リゾート・リート投資法人	7,052	1,667,798,000	
	積水ハウス・リート投資法人	51,809	3,968,569,400	
	大和ハウスリート投資法人	54,648	6,639,732,000	
	大和証券オフィス投資法人	7,107	2,341,756,500	
	大和証券リビング投資法人	25,699	2,521,071,900	
	投資法人みらい	24,169	1,006,638,850	
	東海道リート投資法人	4,401	452,422,800	
	東急リアル・エステート投資法人	11,572	2,194,051,200	
	日本ビルファンド投資法人	106,021	13,962,965,700	
	日本プライムリアルティ投資法人	48,669	4,599,220,500	
	日本プロロジスリート投資法人	90,354	7,942,116,600	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人	5,134	340,897,600	
	日本リート投資法人	23,155	1,924,180,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	34,797	3,371,829,300	
	日本都市ファンド投資法人	91,140	10,435,530,000	
	福岡リート投資法人	9,908	1,740,835,600	
	平和不動産リート投資法人	14,424	1,927,046,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	55,930	8,506,953,000	
投資証券　合計		1,677,534	188,371,467,450	
合計			188,371,467,450	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

	2026年7月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	858,520,749
コール・ローン	192,456,120
投資信託受益証券	13,146,504,807
投資証券	123,014,098,259
派生商品評価勘定	6,830,537
未収入金	2,046,023
未収配当金	508,435,193
差入委託証拠金	404,427,533
流動資産合計	138,133,319,221
資産合計	138,133,319,221
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,620,883
未払解約金	143,752,000
流動負債合計	158,372,883
負債合計	158,372,883
純資産の部	
元本等	
元本	50,548,586,469
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	87,426,359,869
元本等合計	137,974,946,338
純資産合計	137,974,946,338
負債純資産合計	138,133,319,221

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
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7月13日現在
1．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	51,980,698,584円
同期中追加設定元本額	8,923,069,656円
同期中一部解約元本額	10,355,181,771円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード　先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	5,295,800,028円
たわらノーロード　先進国リート	17,678,997,506円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	219,167,047円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	6,327,673,614円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	25,661,643円
たわらノーロード　バランス（標準型）	751,019,411円
たわらノーロード　バランス（積極型）	2,162,131,865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）	3,959,265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）	505,182,838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）	732,206,053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）	1,191,634,845円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	641,250円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	40,039,301円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	24,513,379円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	50,370,830円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	5,022,128,048円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	16,730,081円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	719,089,455円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	91,899,274円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	174,621,042円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	315,178,721円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	687,282,388円
投資のソムリエ	3,398,201,262円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	757,624,048円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	248,851,967円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	418,264,869円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	644,825,491円
ワールドアセットバランス（基本コース）	126,764,290円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	311,441,600円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	164,202,597円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	86,685,227円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,686,079円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	308,462,867円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	222,704,627円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	140,846,051円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	139,198,251円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	102,451,590円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	57,369,257円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	25,293,482円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	43,936,666円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	1,011,640円
Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド	327,351,013円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	490,311,588円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	125,270円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	1,787,456円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	711,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	5,202円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	16,192,722円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	572,716円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	2,386,681円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	18,417,530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）	50,338,406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）	401,135,091円
計	50,548,586,469円
２．　受益権の総数	50,548,586,469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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
1．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
1．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）

投資信託受益証券	△227,071,049
投資証券	3,580,085,370
合計	3,353,014,321

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	1,825,768,628	－	1,817,978,282	△7,790,346
合計	1,825,768,628	－	1,817,978,282	△7,790,346

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年7月13日現在
1口当たり純資産額	2.7296円
（1万口当たり純資産額）	（27,296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7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	385,000.000	190,575.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	43,628.000	
		NTT DC REIT	441,000.000	418,950.000	
		PRIME US REIT	602,760.000	95,838.840	
	アメリカ・ドル　小計		2,340,460.000	748,991.840 (121,434,047)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	193,949.000	177,463.330	

		ARENA REIT	190,560.000	617,414.400	
		BWP PROPERTY GROUP LTD	307,781.000	1,188,034.660	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	437,564.000	765,737.000	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	275,994.000	825,222.060	
		CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	164,596.720	
		CHARTER HALL GROUP	230,247.000	5,143,717.980	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	331,117.000	1,205,265.880	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	250,432.000	974,180.480	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	151,479.000	395,360.190	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	840,948.000	353,198.160	
		DEXUS	536,885.000	3,011,924.850	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	115,861.000	280,383.620	
		DIGICO INFRASTRUCTURE REIT	205,332.000	519,489.960	
		GOODMAN GROUP	1,001,171.000	30,005,094.870	
		GPT GROUP	948,816.000	4,639,710.240	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	122,425.000	266,886.500	
		HEALTHCO REIT	202,023.000	139,395.870	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	944,190.000	1,203,842.250	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	213,943.000	928,512.620	
		MIRVAC GROUP	1,912,776.000	3,261,283.080	
		REGION GROUP	547,253.000	1,291,517.080	
		RURAL FUNDS GROUP	176,030.000	355,580.600	
		SCENTRE GROUP	2,550,732.000	9,896,840.160	
		STOCKLAND	1,194,114.000	4,752,573.720	
		STORAGE KING GROUP	183,660.000	235,084.800	
		VICINITY CENTRES	1,919,167.000	5,066,600.880	
		WAYPOINT REIT LTD	343,320.000	834,267.600	
オーストラリア・ドル　小計			16,513,754.000	78,499,179.560 (8,826,447,749)	
	シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	303,895.000	498,387.800	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,042,360.000	5,146,747.200	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,359,916.000	1,230,723.980	
		CAPITALAND CHINA TRUST	565,280.000	367,432.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,948,609.000	7,194,605.960	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	389,300.000	301,707.500	
		CENTURION ACCOMMODATION REIT	495,300.000	544,830.000	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	0.000	
		ESR REIT	283,714.000	658,216.480	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	462,200.000	265,765.000	
		FRASERS CENTREPOINT	687,500.000	1,546,875.000	

		TRUST			
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,476,964.000	1,425,270.260	
		KEPPEL DC REIT	986,500.000	2,209,760.000	
		KEPPEL REIT	1,545,200.000	1,359,776.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	1,177,200.000	682,776.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,071,720.000	2,079,136.800	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,677,920.000	2,063,841.600	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,088,600.000	1,426,066.000	
		OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,179,800.000	424,728.000	
		PARKWAY LIFE REIT	220,700.000	907,077.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	322,800.000	217,890.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	735,100.000	400,629.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,101,190.000	1,629,761.200	
	シンガポール・ドル　小計		22,234,168.000	32,582,003.280 (4,084,154,111)	
	ユーロ	STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST	177,440.000	278,580.800	
	ユーロ　小計		177,440.000	278,580.800 (51,470,589)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	671,000.000	3,046,340.000	
	香港・ドル　小計		671,000.000	3,046,340.000 (62,998,311)	
投資信託受益証券　合計			41,936,822	13,146,504,807 (13,146,504,807)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	64,914.000	1,382,019.060	
		AGREE REALTY CORP	59,503.000	4,638,258.850	
		AH REALTY TRUST INC	37,788.000	267,161.160	
		ALEXANDER'S INC.	977.000	268,049.720	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,426.000	3,659,276.880	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	90,178.880	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,472.000	564,496.640	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	93,983.000	5,034,669.310	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	154,530.000	5,141,213.100	
		AMERICOLD REALTY TRUST	140,942.000	2,186,010.420	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	109,300.000	1,810,008.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,968.000	13,038,981.120	

		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	46,726.980	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	82,790.000	253,337.400	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	152,323.000	4,726,582.690	
		BROADSTONE NET LEASE INC	93,538.000	2,041,934.540	
		BRT APARTMENTS CORP	3,973.000	58,999.050	
		BXP INC	72,324.000	4,832,689.680	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	49,057.000	5,541,478.720	
		CARETRUST REIT INC	115,176.000	4,632,378.720	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	7,096.000	371,617.520	
		CENTERSPACE	8,274.000	459,786.180	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,414.000	326,824.040	
		CHIRON REAL ESTATE INC	7,015.000	254,784.800	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	11,691.000	210,554.910	
		COPT DEFENCE PROPERTIES	55,843.000	2,039,386.360	
		COUSINS PROPERTIES INC	82,509.000	2,496,722.340	
		CTO REALTY GROUTH INC	16,134.000	343,492.860	
		CUBESMART	110,363.000	4,435,488.970	
		CURBLINE PROPERTIES CORP	49,751.000	1,512,927.910	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	105,020.000	1,247,637.600	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	170,494.000	30,758,822.540	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	112,001.000	981,128.760	
		DOUGLAS EMMETT INC	86,893.000	1,043,584.930	
		EAST GROUP	26,186.000	5,489,109.320	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	20,907.000	519,957.090	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	73,272.000	397,866.960	
		EPR PROPERTIES	37,073.000	2,210,292.260	
		EQUINIX INC	48,322.000	50,796,569.620	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,675.000	6,009,022.250	
		EQUITY RESIDENTIAL	166,762.000	11,454,881.780	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	106,517.000	3,321,200.060	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	31,416.000	9,222,166.800	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	103,389.000	14,883,880.440	
		FARMLAND PARTNERS INC	18,774.000	180,230.400	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,026.000	4,719,804.440	
		FERMI INC	14,478.000	95,410.020	
		FIRST INDUSTRIAL RT	65,761.000	4,275,122.610	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	56,292.000	1,405,048.320	
		FRANKLIN STREET	46,375.000	23,651.250	

		PROPERTIES C			
		FRONTVIEW REIT INC	10,033.000	208,987.390	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	138,281.000	5,970,973.580	
		GETTY REALTY CORP	26,553.000	912,626.610	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	26,376.000	329,436.240	
		GLADSTONE LAND CORP	19,748.000	169,042.880	
		GLOBAL NET LEASE INC	90,579.000	821,551.530	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	172,508.000	3,569,190.520	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	336,790.000	7,291,503.500	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,532.000	1,702,489.040	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	311,206.000	7,213,755.080	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	24,407.000	370,498.260	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	117,058.000	1,959,550.920	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	241,929.000	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	13,602.000	876,512.880	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,925.000	1,411,748.000	
		INVITATION HOMES INC	267,072.000	7,905,331.200	
		IRON MOUNTAIN INC	145,651.000	17,698,053.010	
		JBG SMITH PROPERTIES	26,368.000	383,390.720	
		KILROY REALTY CORP	53,993.000	2,073,331.200	
		KIMCO REALTY	329,601.000	8,200,472.880	
		KITE REALTY GROUP TRUST	101,829.000	2,879,724.120	
		LAMAR ADVERTISING CO	42,512.000	6,597,012.160	
		LINEAGE INC	29,448.000	1,269,797.760	
		LTC PROPERTIES INC	24,621.000	956,772.060	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	29,315.000	1,613,790.750	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	253,468.000	1,143,140.680	
		MID AMERICA	56,871.000	7,691,802.750	
		MILLROSE PROPERTIES INC	76,034.000	2,157,084.580	
		MODIV INC	3,617.000	63,840.050	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	24,295.000	1,830,142.350	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	35,110.000	1,571,523.600	
		NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,924.000	66,348.800	
		NETSTREIT CORP	50,152.000	1,078,268.000	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	18,700.000	97,240.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,217.000	279,026.270	

		NNN REIT INC	92,722.000	4,336,607.940	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	145,454.000	7,025,428.200	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,397.000	181,966.200	
		ORION PROPERTIES INC	20,368.000	56,012.000	
		OUTFRONT MEDIA INC	76,810.000	2,537,802.400	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	102,879.000	1,457,795.430	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	55,793.000	1,014,316.740	
		PHILLIPS EDISON & CO INC	61,982.000	2,595,186.340	
		PIEDMONT REALTY TRUST INC	59,203.000	552,363.990	
		POSTAL REALTY TRUST INC	13,621.000	328,947.150	
		PROLOGIS INC	456,849.000	64,356,318.630	
		PUBLIC STORAGE	77,369.000	24,801,406.640	
		REALTY INCOME CORP	456,705.000	28,913,993.550	
		REGENCY CENTERS CORP	80,466.000	6,406,702.920	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	109,038.000	3,720,376.560	
		RLJ LODGING TRUST	73,261.000	840,303.670	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,743.000	3,864,702.530	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	124,161.000	2,436,038.820	
		SAFEHOLD INC	21,139.000	340,549.290	
		SAUL CENTERS INC	5,700.000	205,998.000	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	63,610.000	561,676.300	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	158,851.000	34,751,833.270	
		SITE CENTERS CORP	22,861.000	98,073.690	
		SL GREEN	35,335.000	1,720,107.800	
		SMARTSTOP SELF STORAGE REIT INC	28,663.000	945,592.370	
		STAG INDUSTRIAL INC	93,079.000	3,628,219.420	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	47,737.000	308,381.020	
		SUN COMMUNITIES INC	56,574.000	6,725,517.120	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	90,842.000	1,019,247.240	
		TANGER INC	55,676.000	2,206,439.880	
		TERRENO REALTY CORP	52,868.000	3,669,039.200	
		THE MACERICH COMPANY	137,964.000	3,406,331.160	
		UDR INC	144,305.000	5,733,237.650	
		UMH PROPERTIES INC	38,835.000	593,398.800	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,726.000	246,561.560	
		URBAN EDGE PROPERTIES	62,563.000	1,423,933.880	
		VENTAS INC	238,036.000	21,580,343.760	
		VICI PROPERTIES INC	534,775.000	13,909,497.750	
		VORNADO REALTY TRUST	79,231.000	3,038,508.850	

	WELLTOWER INC	345,928.000	80,113,465.520	
	WHITESTONE REIT	22,751.000	432,041.490	
	WP CAREY INC	108,841.000	7,799,546.060	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,985.000	887,177.450	
アメリカ・ドル　小計		10,756,747.000	671,078,300.870 (108,801,924,921)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	76,762.000	83,824.100	
	BIG YELLOW GROUP PLC	97,988.000	852,985.540	
	BRITISH LAND CO PLC	497,537.000	2,108,561.800	
	CLS HOLDINGS PLC	80,477.000	37,904.660	
	CUSTODIAN REIT PLC	241,442.000	216,332.030	
	DERWENT LONDON PLC	55,853.000	1,127,113.540	
	GRAINGER PLC	383,622.000	664,816.920	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	193,311.000	649,524.960	
	HAMMERSON PLC	265,033.000	985,922.760	
	HELICAL PLC	50,025.000	93,546.750	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	362,273.000	2,416,360.910	
	LIVING REIT PLC	156,311.000	117,545.870	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,159,828.000	2,189,755.260	
	NEWRIVER REIT PLC	166,709.000	132,700.360	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	188,445.000	137,753.290	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	1,252,073.000	1,165,679.960	
	REGIONAL REIT LTD	77,865.000	74,361.070	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	109,231.000	655,386.000	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	283,492.000	130,406.320	
	SEGRO PLC	661,428.000	5,697,540.790	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	965,767.000	1,354,971.100	
	SIRIUS REAL ESTATE LTD	756,186.000	713,083.390	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	649,923.000	577,131.620	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	301,438.000	333,390.420	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,212,397.000	1,970,145.120	
	UNITE GROUP PLC	246,674.000	1,279,004.690	
	WORKSPACE GROUP PLC	72,484.000	247,895.280	
イギリス・ポンド　小計		10,795,614.000	26,013,644.510 (5,642,619,631)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	420,949.000	804,854.480	
	REIT 1 LTD	103,240.000	2,239,275.600	
	SELLA CAPITAL REAL	108,244.000	957,851.150	

	ESTATE LTD			
イスラエル・シュケル　小計		632,433.000	4,001,981.230 (215,069,273)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	45,559.000	467,435.340	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,332.000	749,611.800	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	37,655.000	1,317,548.450	
	CHOICE PROPERTIES REIT	78,392.000	1,288,764.480	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	26,145.000	463,289.400	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,066.000	499,097.040	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	65,020.000	923,284.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	4,883.000	92,581.680	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	52,306.000	1,221,868.160	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,859.000	1,428,098.490	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	61,447.000	675,917.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	35,315.000	478,165.100	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,395.000	515,026.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,186.000	180,699.640	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,000.000	135,760.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	117,085.500	
	PRIMARIS REIT	27,393.000	610,863.900	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	68,225.000	1,535,062.500	
	SLATE GROCERY REIT	15,647.000	276,482.490	
	SMARTCENTRES REIT	35,752.000	1,076,135.200	
	VITAL INFRASTRUCTURE PROPERTY TRUST	57,513.000	324,373.320	
カナダ・ドル　小計		724,545.000	14,377,149.490 (1,645,033,445)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN NEW ZEALAND LTD & GOODMAN PROPERTY SERVICES NZ LTD	524,054.000	1,100,513.400	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	294,101.000	563,203.410	
ニュージーランド・ドル　小計		818,155.000	1,663,716.810 (155,124,955)	
ユーロ	AEDIFICA	45,154.000	3,124,656.800	
	ALTAREA	2,924.000	283,335.600	
	ASCENCIO	3,060.000	157,284.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	23,004.000	289,850.400	
	CARMILA SA	32,694.000	543,374.280	
	COLONIAL SFL SOCIMI SA	172,411.000	938,777.890	

		COVIVIO	26,637.000	1,421,083.950	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	22,112.000	591,496.000	
		GECINA SA	25,887.000	1,867,747.050	
		HAMBORNER REIT AG	33,033.000	146,336.190	
		ICADE	16,092.000	299,954.880	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	25,203.000	103,080.270	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	265,702.000	294,929.220	
		KLEPIERRE	107,676.000	3,891,410.640	
		MERCIALYS	47,297.000	551,483.020	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,304.000	3,180,125.200	
		MONTEA SCA	10,680.000	716,628.000	
		NSI NV	4,959.000	86,782.500	
		RETAIL ESTATES	6,273.000	427,818.600	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	15,635.000	411,200.500	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	59,516.000	6,100,390.000	
		VASTNED NV	3,687.000	108,397.800	
		WAREHOUSES DE PAUW	92,356.000	2,015,207.920	
		WERELDHAVE NV	19,723.000	378,681.600	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	19,024.000	521,257.600	
	ユーロ　小計		1,292,043.000	28,451,289.910 (5,256,660,324)	
	韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	85,726.000	282,895,800.000	
		HANWHA REIT CO LTD	66,055.000	313,100,700.000	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	29,074.000	99,869,190.000	
		JR REIT XXVII	87,309.000	103,199,238.000	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	24,787.000	99,767,675.000	
		LOTTE REIT CO LTD	78,077.000	274,050,270.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	54,332.000	285,243,000.000	
		SK REITS CO LTD	94,152.000	537,607,920.000	
	韓国・ウォン　小計		519,512.000	1,995,733,793.000 (215,038,320)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	967,070.000	2,050,188.400	
		LINK REIT	1,274,120.000	47,703,052.800	
		PROSPERITY REIT	582,000.000	861,360.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	342,000.000	762,660.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,476,000.000	974,160.000	
	香港・ドル　小計		4,641,190.000	52,351,421.200 (1,082,627,390)	
投資証券　合計			30,180,239	123,014,098,259	

		(123,014,098,259)	
合計		136,160,603,066 (136,160,603,066)	

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

(注)

1．各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	5銘柄	0.09	－	80.00
	投資証券	128銘柄	－	78.86	
イギリス・ポンド	投資証券	28銘柄	－	4.09	4.14
イスラエル・シュケル	投資証券	3銘柄	－	0.16	0.16
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	28銘柄	6.40	－	6.48
カナダ・ドル	投資証券	21銘柄	－	1.19	1.21
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	23銘柄	2.96	－	3.00
ニュージーランド・ドル	投資証券	2銘柄	－	0.11	0.11
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.04	－	3.90
	投資証券	25銘柄	－	3.81	
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	－	0.16	0.16
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.05	－	0.84
	投資証券	5銘柄	－	0.78	

(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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2026年7月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	885,718,245
コール・ローン	171,365,742
国債証券	105,235,105,825
未収利息	1,558,733,509
前払費用	313,012,230
流動資産合計	108,163,935,551
資産合計	108,163,935,551
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,575
未払解約金	75,103,000
流動負債合計	75,117,575
負債合計	75,117,575
純資産の部	
元本等	
元本	37,467,718,008
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	70,621,099,968
元本等合計	108,088,817,976
純資産合計	108,088,817,976
負債純資産合計	108,163,935,551

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年7月13日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	45,336,415,932円
同期中追加設定元本額	14,303,586,352円
同期中一部解約元本額	22,172,284,276円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	5,874,572,742円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	199,597,576円
たわらノーロード　バランス（標準型）	845,310,325円
たわらノーロード　バランス（積極型）	512,358,917円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	676,235円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	4,891,543円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	53,428,013円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	11,680,938円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	6,844,874円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	10,356,613円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	47,745,786円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	250,831,915円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	453,732,465円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	1,026,645,979円
投資のソムリエ	5,024,178,279円
クルーズコントロール	170,748,614円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,120,710,805円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	368,738,202円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	839,082,103円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,361,851,906円
ワールドアセットバランス（基本コース）	120,184,106円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	295,809,332円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	186,565,538円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	103,981,046円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	9,393,196円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	391,088,791円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	396,357,967円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	213,565,696円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	188,953,650円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	122,873,288円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	68,807,518円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	30,337,871円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,203,692円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	5,982,461円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	1,211,515円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	15,106,076,240円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	23,665,178円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	497,848,828円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド２（適格機関投資家限定）	715,324,942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）	3,534,779円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	47,948,815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）	21,341,338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）	731,678,391円
計	37,467,718,008円
２．　受益権の総数	37,467,718,008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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,468,139,716
合計	△1,468,139,716

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち １年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	219,000,000	－	219,014,575	△14,575
アメリカ・ドル	219,000,000	－	219,014,575	△14,575
合計	219,000,000	－	219,014,575	△14,575

（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7月13日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.8849円 （28,849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7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 3.75 09/12/31	6,000,000.000	5,528,700.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	9,000,000.000	8,569,800.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	4,400,000.000	3,223,000.000	
		BRAZIL 5.5 02/04/33	4,800,000.000	4,703,520.000	
		BRAZIL 5.5 11/06/30	1,400,000.000	1,410,500.000	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	4,500,000.000	4,500,000.000	
		BRAZIL 6.125 01/22/32	6,000,000.000	6,103,500.000	
		BRAZIL 6.125 03/15/34	5,000,000.000	4,993,000.000	
		BRAZIL 6.25 03/18/31	7,000,000.000	7,240,450.000	
		BRAZIL 6.25 05/22/36	3,000,000.000	2,943,000.000	
		BRAZIL 6.625 03/15/35	3,000,000.000	3,057,000.000	
		BRAZIL 7.125 05/13/54	5,000,000.000	4,963,750.000	
		BRAZIL 7.25 01/12/56	4,500,000.000	4,456,800.000	
		CHINA GOVT INTL BOND 3.625 11/13/28	5,300,000.000	5,253,696.700	
		CHINA GOVT INTL BOND 3.75 11/13/30	3,000,000.000	2,968,226.520	
		COLOMBIA 5.375 01/21/29	3,000,000.000	2,996,400.000	
		COLOMBIA 7.375 04/25/30	6,000,000.000	6,327,000.000	
		COLOMBIA 7.5 02/02/34	7,000,000.000	7,458,500.000	
		COLOMBIA 8.0 04/20/33	7,000,000.000	7,654,500.000	
		COLOMBIA 8.0 11/14/35	5,000,000.000	5,472,500.000	
		COLOMBIA 8.375 11/07/54	2,000,000.000	2,272,000.000	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	2,000,000.000	1,784,000.000	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	4,000,000.000	4,000,000.000	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.875 10/28/35	5,000,000.000	4,912,250.000	
		DOMINICAN REPUBLIC 6.0	7,800,000.000	7,827,300.000	

		02/22/33			
		DOMINICAN REPUBLIC 6.15 05/17/38	3,000,000.000	2,956,500.000	
		DOMINICAN REPUBLIC 6.95 03/15/37	4,000,000.000	4,213,800.000	
		HUNGARY 2.125 09/22/31	7,500,000.000	6,482,000.320	
		HUNGARY 3.125 09/21/51	4,000,000.000	2,523,825.680	
		HUNGARY 5.25 06/16/29	7,000,000.000	7,078,771.840	
		HUNGARY 5.375 09/26/30	6,000,000.000	6,075,505.980	
		HUNGARY 5.5 03/26/36	4,000,000.000	3,992,912.120	
		HUNGARY 6.0 09/26/35	3,000,000.000	3,107,586.300	
		HUNGARY 6.125 05/22/28	6,000,000.000	6,143,323.920	
		HUNGARY 6.25 09/22/32	5,200,000.000	5,440,240.000	
		HUNGARY 6.75 09/23/55	9,000,000.000	9,687,074.490	
		INDONESIA 1.85 03/12/31	4,700,000.000	4,094,045.060	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	3,700,000.000	3,575,518.380	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	2,000,000.000	2,350,371.810	
		PANAMA 4.5 01/19/63	2,000,000.000	1,520,580.000	
		PANAMA 6.4 02/14/35	8,600,000.000	9,038,600.000	
		PERU 3.0 01/15/34	9,800,000.000	8,457,400.000	
		PERU 5.5 03/30/36	1,000,000.000	1,006,250.000	
		PERU 5.875 08/08/54	7,000,000.000	6,865,250.000	
		PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	4,124,907.420	
		PHILIPPINES 5.0 01/27/36	6,000,000.000	5,857,679.510	
		PHILIPPINES 5.325 06/24/36	3,000,000.000	2,990,078.220	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	10,000,000.000	8,533,000.000	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	8,200,000.000	7,401,730.000	
		REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	2,000,000.000	1,740,500.000	
		REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	9,000,000.000	9,057,600.000	
		REPUBLIC OF CHILE 4.95 01/05/36	1,000,000.000	982,250.000	
		REPUBLIC OF CHILE 5.65 01/13/37	6,000,000.000	6,176,700.000	
		REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	10,600,000.000	10,665,007.360	
		REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	5,000,000.000	4,946,889.850	
		REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	1,000,000.000	998,834.380	
		REPUBLIC OF POLAND 5.375 02/12/35	5,000,000.000	5,052,670.750	
		REPUBLIC OF POLAND 5.375 04/14/36	3,000,000.000	2,996,922.930	
		REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	9,000,000.000	8,356,607.370	

		REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	9,000,000.000	8,394,410.700	
		REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	6,000,000.000	6,082,974.960	
		REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	8,500,000.000	8,864,569.840	
		REPUBLIC OF POLAND 6.125 04/14/56	4,000,000.000	3,984,517.240	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.442 02/14/37	5,200,000.000	5,298,800.000	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	7,000,000.000	7,287,000.000	
		ROMANIA 4.0 02/14/51	7,000,000.000	4,709,997.810	
		ROMANIA 5.75 03/24/35	5,000,000.000	4,837,908.900	
		ROMANIA 5.75 07/04/36	1,700,000.000	1,624,309.500	
		ROMANIA 5.875 01/30/29	9,000,000.000	9,097,379.460	
		ROMANIA 6.375 01/30/34	4,900,000.000	4,952,826.110	
		ROMANIA 6.625 02/17/28	4,000,000.000	4,083,861.920	
		ROMANIA 6.625 05/16/36	7,000,000.000	7,156,995.860	
		ROMANIA 7.125 01/17/33	8,000,000.000	8,494,912.320	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.125 01/12/29	700,000.000	688,996.470	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	7,000,000.000	6,922,205.500	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,954,580.160	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30	9,000,000.000	8,963,550.540	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	6,000,000.000	5,930,089.500	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/16/34	7,000,000.000	6,952,745.450	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	9,000,000.000	7,658,800.830	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.375 01/13/31	9,000,000.000	9,138,542.490	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	9,000,000.000	9,214,654.050	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	6,000,000.000	5,705,210.220	
		SOUTH AFRICA 6.125 12/11/37	14,900,000.000	14,618,390.000	
		SOUTH AFRICA 7.1 11/19/36	18,500,000.000	19,813,544.580	
		SOUTH AFRICA 7.25 12/11/55	1,200,000.000	1,194,226.500	
		SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	7,000,000.000	7,031,856.440	
		SOUTH AFRICA 7.95 11/19/54	6,800,000.000	7,319,779.080	
		TURKEY 6.3 03/14/33	3,000,000.000	2,927,859.510	

		TURKEY 6.5 01/03/35	7,000,000.000	6,800,294.900	
		TURKEY 6.5 09/20/33	6,000,000.000	5,881,197.360	
		TURKEY 6.8 11/04/36	6,300,000.000	6,194,504.290	
		TURKEY 6.95 09/16/35	4,100,000.000	4,079,355.920	
		TURKEY 7.125 02/12/32	4,000,000.000	4,076,586.480	
		TURKEY 7.125 07/17/32	4,000,000.000	4,088,983.840	
		TURKEY 7.25 05/29/32	6,000,000.000	6,155,649.360	
		TURKEY 7.625 05/15/34	6,000,000.000	6,268,997.520	
		TURKEY 8.6 09/24/27	3,000,000.000	3,111,891.900	
		TURKEY 9.125 07/13/30	5,800,000.000	6,364,118.150	
		TURKEY 9.375 01/19/33	3,000,000.000	3,403,246.710	
		TURKEY 9.375 03/14/29	9,500,000.000	10,293,609.100	
		TURKEY 9.875 01/15/28	5,200,000.000	5,511,704.790	
		UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	10,000,000.000	8,816,500.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	8,000,000.000	6,777,600.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	2,000,000.000	1,173,940.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	4,000,000.000	2,806,400.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	2,000,000.000	1,450,200.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/22/31	6,000,000.000	5,848,800.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	10,700,000.000	10,106,150.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.85 07/02/32	3,000,000.000	3,018,600.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36	5,500,000.000	5,450,225.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/13/30	7,500,000.000	7,699,500.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.125 02/09/38	2,700,000.000	2,631,825.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	2,000,000.000	1,835,800.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	8,000,000.000	8,122,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	4,000,000.000	3,713,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.875 05/13/37	9,000,000.000	9,382,050.000	
	アメリカ・ドル　小計		661,700,000.000 (107,281,421,000)	649,078,553.170 (105,235,105,825)	
国債証券　合計			107,281,421,000 (107,281,421,000)	105,235,105,825 (105,235,105,825)	
合計				105,235,105,825 (105,235,105,825)	

（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　117銘柄	97.36	100.00

（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。

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7月13日現在
資産の部	
流動資産	
預金	5,406,318,879
コール・ローン	131,406,530
株式	207,880,743,063
投資信託受益証券	1,128,018,227
投資証券	156,871,374
派生商品評価勘定	15,219,954
未収入金	9,044,063
未収配当金	668,292,168
差入委託証拠金	1,934,198,940
流動資産合計	217,330,113,198
資産合計	217,330,113,198
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	238,177,887
未払金	33,391
未払解約金	44,206,000
流動負債合計	282,417,278
負債合計	282,417,278
純資産の部	
元本等	
元本	70,132,008,310
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	146,915,687,610
元本等合計	217,047,695,920
純資産合計	217,047,695,920
負債純資産合計	217,330,113,198

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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。
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7月13日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	65,934,563,781円
同期中追加設定元本額	11,807,480,929円
同期中一部解約元本額	7,610,036,400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	20,722,186円
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	11,790,466,042円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ専用＞	4,905,056,527円
たわらノーロード　新興国株式	21,077,056,568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）	22,382,820円
たわらノーロード　バランス（標準型）	130,327,379円
たわらノーロード　バランス（積極型）	313,990,770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）	39,231,298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）	178,221,190円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	258,424,134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）	485,082,983円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	566,232円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	14,148,604円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,495,716円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	15,911,508円
たわらノーロード　全世界株式	13,641,946,527円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	11,645,573円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	5,589,007円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	3,846,924,224円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～１９７２年生まれ向け）	1,081,965円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７３～１９７７年生まれ向け）	530,782円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７８～１９８２年生まれ向け）	381,177円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８３～１９８７年生まれ向け）	381,975円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	296,879円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	244,019円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９８～２００２年生まれ向け）	254,667円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／２００３～２００７年生まれ向け）	362,300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）	247,047,045円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	481,174,041円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	1,002,396,637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＞	341,622,678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）	170,571,532円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	412,587,495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	163,861,809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）	77,535,406円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	42,559,017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）	10,397,619円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	13,633,079円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	414,090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）	1,035,076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）	1,410,804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）	44,504,626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）	19,797,270円
計	70,132,008,310円
２．　受益権の総数	70,132,008,310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　2026年1月14日 至　2026年7月13日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立した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7月13日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年7月13日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	13,936,025,315
投資信託受益証券	20,716,887
投資証券	△10,556,620
合計	13,946,185,582

（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7月13日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2026年7月13日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	8,039,434,925	－	7,816,476,992	△222,957,933
合計	8,039,434,925	－	7,816,476,992	△222,957,933

（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7月13日現在
1口当たり純資産額	3.0948円
（1万口当たり純資産額）	（30,948円）

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2026年7月13日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	16,378	30.000	491,340.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,343	400.810	2,943,147.830	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,784	175.830	1,720,320.720	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	299,601	2.700	808,922.700	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	2.680	238,520.000	
	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	13.940	441,898.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	39,877	10.310	411,131.870	
	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	41.110	805,673.780	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	63,052	8.880	559,901.760	
	STONECO LTD	22,909	11.210	256,809.890	
	AURA MINERALS INC	3,419	60.810	207,909.390	
	XP INC	43,477	16.920	735,630.840	
	KANZHUN LTD ADR	39,728	13.760	546,657.280	
	FULL TRUCK ALLIANCE CO LTD ADR	77,609	8.570	665,109.130	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	6,582	27.080	178,240.560	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS	388,046	13.760	5,339,512.960	
	JBS NV	32,951	11.910	392,446.410	
	PDD HOLDINGS INC ADR	60,344	85.130	5,137,084.720	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
アメリカ・ドル　小計		3,598,968		22,850,933.020 (3,704,821,771)	
アラブ首長国	ABU DHABI ISLAMIC BANK	162,134	22.000	3,566,948.000	

連邦・ディルハム	PJSC				
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	283,598	7.770	2,203,556.460	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	369,100	20.700	7,640,370.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	325,776	14.700	4,788,907.200	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	469,482	18.000	8,450,676.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	676,959	11.860	8,028,733.740	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	400,130	8.160	3,265,060.800	
	AIR ARABIA PJSC	227,560	5.460	1,242,477.600	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	200,313	31.320	6,273,803.160	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	95,686	14.040	1,343,431.440	
	DUBAI ELECTRICITY & WATER AUTHORITY PJSC	601,201	2.790	1,677,350.790	
	SALIK CO PJSC	196,959	5.700	1,122,666.300	
	ADNOC DRILLING CO PJSC	319,228	5.790	1,848,330.120	
	ADNOC GAS PLC	736,529	3.420	2,518,929.180	
	ADNOC LOGISTICS & SERVICES	193,108	6.070	1,172,165.560	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	293,434	4.000	1,173,736.000	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		5,551,197		56,317,142.350 (2,490,907,206)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	646,308	1,307.800	845,241,602.400	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	174,055	309.750	53,913,536.250	
	ASIAN PAINTS LTD	39,512	2,677.800	105,805,233.600	
	BANK OF BARODA	93,834	250.950	23,547,642.300	
	EICHER MOTORS LTD	14,110	7,365.500	103,927,205.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	28,312	3,213.600	90,983,443.200	
	HDFC BANK LTD	1,208,896	824.950	997,278,755.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	94,269	3,129.400	295,005,408.600	
	SHREE CEMENT LTD	901	26,615.000	23,980,115.000	
	ICICI BANK LTD	563,486	1,401.200	789,556,583.200	
	INDUSIND BANK LTD	62,632	1,015.800	63,621,585.600	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	96,592	395.300	38,182,817.600	
	STATE BANK OF INDIA LTD	196,000	1,036.000	203,056,000.000	
	TATA STEEL LTD	799,847	191.190	152,922,747.930	
	TATA MOTORS PASSENGER VEHICLES LIMITED	199,142	337.950	67,300,038.900	
	JSW STEEL LTD	61,601	1,245.400	76,717,885.400	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	12,260	1,856.200	22,757,012.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	57,048	1,111.900	63,431,671.200	

BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,731	10,654.000	29,096,074.000	
TATA POWER CO LTD	156,763	381.300	59,773,731.900	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,311	5,353.000	60,547,783.000	
NESTLE INDIA LTD	59,445	1,455.200	86,504,364.000	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	132,897	395.250	52,527,539.250	
GAIL INDIA LTD	220,558	173.730	38,317,541.340	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	582,100	377.600	219,800,960.000	
VEDANTA LTD	138,518	272.550	37,753,080.900	
SUPREME INDUSTRIES LTD	6,516	3,319.600	21,630,513.600	
AXIS BANK LTD	242,900	1,323.700	321,526,730.000	
TITAN COMPANY LTD	37,657	4,584.400	172,634,750.800	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	273,278	244.960	66,942,178.880	
NATIONAL ALUMINIUM CO LTD	88,926	354.850	31,555,391.100	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	13,131	2,052.400	26,950,064.400	
BHARAT ELECTRONICS LTD	371,017	414.850	153,916,402.450	
GE VERNOVA T&D INDIA LTD	12,975	4,677.100	60,685,372.500	
LUPIN LTD	25,380	2,496.300	63,356,094.000	
NMDC LTD	300,771	84.920	25,541,473.320	
MPHASIS LTD	14,024	2,321.900	32,562,325.600	
BAJAJ FINANCE LTD	263,000	1,020.500	268,391,500.000	
INFOSYS LTD	324,358	1,068.000	346,414,344.000	
WIPRO LTD	259,689	175.460	45,565,031.940	
MRF LTD	235	134,425.000	31,589,875.000	
INDIAN OIL CORP LTD	302,990	138.960	42,103,490.400	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	75,000	2,150.600	161,295,000.000	
TRENT LTD	28,449	2,902.800	82,581,757.200	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	11,157	8,841.000	98,639,037.000	
CUMMINS INDIA LTD	13,288	5,621.500	74,698,492.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	94,147	1,164.100	109,596,522.700	
DABUR INDIA LTD	48,488	443.500	21,504,428.000	
HERO MOTOCORP LTD	11,949	4,949.100	59,136,795.900	
SRF LTD	14,918	2,774.600	41,391,482.800	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,207	2,252.900	18,489,550.300	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	56,361	1,244.300	70,129,992.300	
BHARTI AIRTEL LTD	291,286	1,920.400	559,385,634.400	
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	230,823	105.410	24,331,052.430	
ORACLE FINANCIAL SERVICES SOFTWARE LTD	2,314	11,651.000	26,960,414.000	
UNITED SPIRITS LTD	32,011	1,385.700	44,357,642.700	

UNION BANK OF INDIA LTD	143,317	164.510	23,577,079.670	
CANARA BANK	186,895	128.780	24,068,338.100	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	97,281	1,935.500	188,287,375.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	12,822	6,836.000	87,651,192.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,744	13,854.000	176,555,376.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	26,476	1,564.700	41,426,997.200	
HAVELLS INDIA LTD	22,642	1,188.400	26,907,752.800	
TVS MOTOR COMPANY LTD	24,496	3,623.100	88,751,457.600	
JINDAL STEEL LTD	39,201	1,051.300	41,212,011.300	
JINDAL STAINLESS LTD	34,447	716.400	24,677,830.800	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	415,057	143.190	59,432,011.830	
SHRIRAM FINANCE LTD	149,909	1,044.100	156,519,986.900	
PETRONET LNG LTD	75,518	278.950	21,065,746.100	
CIPLA LTD/INDIA	56,006	1,439.400	80,615,036.400	
LARSEN & TOUBRO LTD	71,885	3,945.800	283,643,833.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,779	11,711.000	126,232,869.000	
ASHOK LEYLAND LTD	279,560	157.490	44,027,904.400	
BOSCH LTD	776	41,815.000	32,448,440.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	84,694	2,069.000	175,231,886.000	
ADANI ENTERPRISES LTD	19,238	3,157.300	60,740,137.400	
NTPC LTD	464,225	344.550	159,948,723.750	
YES BANK LTD	1,634,971	23.940	39,141,205.740	
AMBUJA CEMENTS LTD	61,793	436.450	26,969,554.850	
BHARAT FORGE LTD	25,017	2,117.000	52,960,989.000	
SUZLON ENERGY LTD	1,106,340	53.920	59,653,852.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	136,479	967.450	132,036,608.550	
ITC LTD	320,553	281.750	90,315,807.750	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,722	1,598.500	47,510,617.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	51,485	594.750	30,620,703.750	
SUNDARAM FINANCE LTD	6,335	4,574.900	28,981,991.500	
PHOENIX MILLS LTD	19,759	2,138.900	42,262,525.100	
COROMANDEL INTERNATIONAL LTD	12,117	2,067.800	25,055,532.600	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	11,421	4,901.500	55,980,031.500	
SIEMENS INDIA LTD	8,270	3,496.500	28,916,055.000	
INFO EDGE INDIA LTD	36,145	1,204.050	43,520,387.250	
GMR AIRPORTS LTD	269,965	112.510	30,373,762.150	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	72,036	916.600	66,028,197.600	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	39,996	1,088.400	43,531,646.400	
TECH MAHINDRA LTD	57,980	1,454.800	84,349,304.000	
VOLTAS LTD	22,355	1,286.700	28,764,178.500	
INDIAN HOTELS CO LTD	92,709	752.300	69,744,980.700	
TORRENT POWER LTD	17,117	1,419.400	24,295,869.800	
VODAFONE IDEA LTD	2,817,069	14.190	39,974,209.110	

MARICO LTD	55,579	852.500	47,381,097.500	
POWER FINANCE CORP LTD	155,773	406.500	63,321,724.500	
INDIAN BANK	29,247	870.700	25,465,362.900	
PAGE INDUSTRIES LTD	602	39,395.000	23,715,790.000	
FORTIS HEALTHCARE LTD	49,466	968.000	47,883,088.000	
ABB LTD/INDIA	5,092	6,836.000	34,808,912.000	
DLF LTD	73,505	685.750	50,406,053.750	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	433,978	283.100	122,859,171.800	
NHPC LTD	307,784	79.820	24,567,318.880	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	11,595	5,053.900	58,599,970.500	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	52,598	1,828.100	96,154,403.800	
REC LTD	118,641	351.950	41,755,699.950	
BAJAJ FINSERV LTD	40,913	1,916.000	78,389,308.000	
BAJAJ AUTO LTD	7,123	10,156.000	72,341,188.000	
ADANI POWER LTD	329,501	218.450	71,979,493.450	
OIL INDIA LTD	50,564	424.950	21,487,171.800	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,629	3,129.400	36,391,792.600	
OBEROI REALTY LTD	13,246	1,924.800	25,495,900.800	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS LTD	17,525	1,733.200	30,374,330.000	
JSW ENERGY LTD	44,430	553.450	24,589,783.500	
COAL INDIA LTD	180,782	429.300	77,609,712.600	
L&T FINANCE LTD	90,118	321.250	28,950,407.500	
MULTI COMMODITY EXCHANGE OF INDIA LTD	13,671	2,770.700	37,878,239.700	
INDUS TOWERS LTD	130,423	406.150	52,971,301.450	
PI INDUSTRIES LTD	7,263	2,607.400	18,937,546.200	
VARUN BEVERAGES LTD	135,186	478.100	64,632,426.600	
BSE LTD	20,544	3,811.600	78,305,510.400	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,696	2,958.400	34,601,446.400	
LTM LTD	8,144	4,037.200	32,878,956.800	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	103,093	567.700	58,525,896.100	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	54,729	1,072.100	58,674,960.900	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	17,621	4,506.800	79,414,322.800	
FEDERAL BANK LTD	195,961	329.850	64,637,735.850	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	20,722	2,761.200	57,217,586.400	
GODREJ PROPERTIES LTD	17,149	2,133.000	36,578,817.000	
POLYCAB INDIA LTD	5,665	9,210.500	52,177,482.500	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	44,300	1,807.800	80,085,540.000	
HITACHI ENERGY INDIA LTD	1,259	32,605.000	41,049,695.000	

	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	26,315	611.650	16,095,569.750	
	ETERNAL LTD	258,514	289.650	74,878,580.100	
	LODHA DEVELOPERS LTD	27,877	1,220.750	34,030,847.750	
	MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	76,520	1,108.100	84,791,812.000	
	DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	3,949	13,421.000	52,999,529.000	
	APL APOLLO TUBES LTD	18,244	1,835.900	33,494,159.600	
	ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	38,768	1,341.800	52,018,902.400	
	FSN E-COMMERCE VENTURES LTD	120,259	330.100	39,697,495.900	
	PB FINTECH LTD	36,762	1,580.400	58,098,664.800	
	MANKIND PHARMA LTD	11,821	2,525.100	29,849,207.100	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	305,795	241.960	73,990,158.200	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	12,169	1,333.800	16,231,012.200	
	SWIGGY LTD	154,307	273.250	42,164,387.750	
	WAAREE ENERGIES LTD	9,279	2,922.900	27,121,589.100	
	TATA MOTORS LTD	206,895	422.500	87,413,137.500	
	VISHAL MEGA MART LTD	259,329	118.790	30,805,691.910	
	SIEMENS ENERGY INDIA LTD	9,101	3,526.900	32,098,316.900	
	VEDANTA ALUMINIUM METAL LTD	138,518	443.550	61,439,658.900	
	ZYDUS LIFESCIENCES LTD	17,682	1,150.800	20,348,445.600	
	ADITYA BIRLA CAPITAL LTD	79,827	408.300	32,593,364.100	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	15,670	4,081.100	63,950,837.000	
	IDFC BANK LTD	509,314	80.830	41,167,850.620	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	24,532	1,826.200	44,800,338.400	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	37,542	510.350	19,159,559.700	
	ALKEM LABORATORIES LTD	4,865	5,669.500	27,582,117.500	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	19,624	5,312.000	104,242,688.000	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,547	18,236.000	46,447,092.000	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	49,103	1,862.900	91,473,978.700	
インド・ルピー 小計		23,528,220		14,011,503,832.300 (23,959,671,553)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	2,181,173	1,620.000	3,533,500,260.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	135,001	24,500.000	3,307,524,500.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,598,100	4,810.000	7,686,861,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,496,500	2,480.000	11,151,320,000.000	
	CHAROEN POKPHAND	659,600	3,120.000	2,057,952,000.000	

	INDONESIA TBK PT				
	BANK MANDIRI	3,975,000	4,080.000	16,218,000,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	6,757,300	2,790.000	18,852,867,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,498,400	3,420.000	5,124,528,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,286,900	6,175.000	32,646,607,500.000	
	BUMI RESOURCES MINERALS TBK PT	5,755,200	505.000	2,906,376,000.000	
	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		107,820,656,260.000 (970,385,906)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	11,532	54.940	633,568.080	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	12,640	129.440	1,636,121.600	
	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	4,100	233.450	957,145.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	25.310	303,720.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,880	53.630	690,754.400	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	26,000	23.150	601,900.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	12,100	29.860	361,306.000	
	UNISPLENDOUR CORP LTD	18,640	38.410	715,962.400	
	KINGNET NETWORK CO LTD	17,300	16.920	292,716.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	13.100	250,210.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	5,300	99.380	526,714.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	47.270	56,724.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	17.310	280,422.000	
	HGTECH CO LTD	7,300	158.070	1,153,911.000	
	CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	2,100	69.500	145,950.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	43.200	509,760.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	15.350	124,335.000	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	11,800	242.300	2,859,140.000	
	SHANJIN INTERNATIONAL GOLD CO LTD	23,900	20.030	478,717.000	
	SHANDONG HIMILE MECHANICAL SCIENCE &	8,120	45.770	371,652.400	

TECHNOLOGY CO LTD				
GEM CO LTD	29,100	6.540	190,314.000	
SHENZHEN EVERWIN PRECISION TECHNOLOGY CO LTD	10,100	29.880	301,788.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	43,500	14.040	610,740.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	24.000	405,600.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	12,760	114.790	1,464,720.400	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	14.640	228,281.520	
ZHEJIANG NHU CO LTD	24,512	28.700	703,494.400	
YUNNAN TIN CO LTD	9,000	36.450	328,050.000	
LEO GROUP CO LTD	39,500	4.610	182,095.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	17.270	88,077.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	44.910	417,663.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	25.360	263,744.000	
MUYUAN FOODS GROUP CO LTD	33,900	38.140	1,292,946.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,950	12.170	108,921.500	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	6.120	110,160.000	
TIANQI LITHIUM CORP	11,700	47.800	559,260.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	19.450	217,840.000	
HAISCO PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	2,800	69.330	194,124.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	44.070	528,840.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	10.950	564,472.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	10,140	23.760	240,926.400	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	14,739	85.830	1,265,048.370	
BLUEFOCUS INTELLIGENT COMMUNICATIONS GROUP CO LTD	21,200	13.810	292,772.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	7,770	89.520	695,570.400	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	67,129	8.350	560,527.150	

	CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	127.050	1,372,140.000	
	SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	7,900	37.130	293,327.000	
	XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	58,700	8.430	494,841.000	
	GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,800	13.580	214,564.000	
	HUADONG MEDICINE CO LTD	20,100	29.380	590,538.000	
	YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	151.200	756,000.000	
	TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	70,900	6.100	432,490.000	
	SHANGHAI 2345 NETWORK HOLDING GROUP CO LTD	34,500	6.340	218,730.000	
	37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	19.180	304,962.000	
	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,500	78.180	586,350.000	
	SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	10,000	63.430	634,300.000	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	10.660	145,775.500	
	BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	49.420	449,722.000	
	HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,920	226.820	889,134.400	
	BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	10,800	12.750	137,700.000	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	44,454	62.140	2,762,371.560	
	QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	25.400	759,460.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	4.810	342,953.000	
	NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	7.140	142,086.000	
	WANXIANG QIANCHAO CO LTD	18,900	12.020	227,178.000	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	17.290	330,239.000	
	IFLYTEK CO LTD	11,500	43.190	496,685.000	
	GOERTEK INC	18,100	22.570	408,517.000	
	GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.250	154,425.000	
	BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	30.700	1,080,640.000	
	LENS TECHNOLOGY CO LTD	30,200	43.640	1,317,928.000	
	TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	238,509	5.120	1,221,166.080	
	CHANGJIANG SECURITIES	28,300	8.740	247,342.000	

CO LTD				
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	7.110	287,869.680	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	26,400	23.370	616,968.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	48.820	513,586.400	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	91,418	20.190	1,845,729.420	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY CO LTD	7,800	38.650	301,470.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	24,200	73.690	1,783,298.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	58,900	4.580	269,762.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	222,300	7.590	1,687,257.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	6.620	303,858.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	38.250	462,825.000	
MIDEA GROUP CO LTD	20,700	78.990	1,635,093.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	10.050	425,115.000	
PING AN BANK CO LTD	142,300	10.450	1,487,035.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	40,080	13.340	534,667.200	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	118,600	4.510	534,886.000	
ZTE CORP	22,700	40.530	920,031.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.260	206,910.000	
WEICHAI POWER CO LTD	44,200	27.570	1,218,594.000	
GF SECURITIES CO LTD	31,600	21.750	687,300.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	22.360	471,796.000	
BYD CO LTD	47,000	90.000	4,230,000.000	
CCOOP GROUP CO LTD	127,500	1.360	173,400.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	15.160	516,956.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	40.060	386,979.600	
LB GROUP CO LTD	11,000	16.000	176,000.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	12.550	537,140.000	
INNER MONGOLIA XINGYE	12,200	33.000	402,600.000	

	SILVER&TIN MINING CO LTD				
	SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,500	70.890	815,235.000	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	4,280	801.000	3,428,280.000	
	NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	70.950	908,160.000	
	CHINA TUNGSTEN AND HIGHTECH MATERIALS CO LTD	13,400	74.710	1,001,114.000	
	HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	10.110	345,762.000	
	HUNAN VALIN STEEL CO LTD	47,800	3.500	167,300.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	79.790	135,643.000	
	GUOCHENG MINING CO LTD	9,200	31.070	285,844.000	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	47.280	312,048.000	
	CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	6.770	258,614.000	
	GIANT NETWORK GROUP CO LTD	13,200	29.560	390,192.000	
	HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	23.490	396,981.000	
	SF HOLDING CO LTD	33,000	32.030	1,056,990.000	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	219.900	549,750.000	
	VICTORY GIANT TECHNOLOGY HUIZHOU CO LTD	5,300	272.000	1,441,600.000	
	EOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	7,644	523.050	3,998,194.200	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD	80,290	8.910	715,383.900	
	360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	9.060	352,434.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	33,000	7.060	232,980.000	
	ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	51.680	118,864.000	
	CSC FINANCIAL CO LTD	21,800	27.250	594,050.000	
	YANGTZE OPTICAL FIBRE & CABLE JOINT STOCK LTD CO	3,700	415.030	1,535,611.000	
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	24.600	158,940.600	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	47,800	15.790	754,762.000	
	BAIYIN NONFERROUS GROUP CO LTD	43,000	4.940	212,420.000	
	ZHESHANG SECURITIES CO	22,500	9.570	215,325.000	

LTD				
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	22.680	346,505.040	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	3,500	200.450	701,575.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	34.430	151,836.300	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	5,800	54.800	317,840.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	41.510	378,405.160	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	6,840	1,093.980	7,482,823.200	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY NETWORK & TECHNOLOGY HOLDINGS CO LTD	27,500	9.600	264,000.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,342	426.000	1,849,692.000	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	88.980	266,940.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	10,200	47.820	487,764.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	8.530	108,331.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	3,300	40.780	134,574.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	19.000	404,700.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	69,700	66.270	4,619,019.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,200	141.570	1,019,304.000	
SHENZHEN MEGMEET ELECTRICAL CO LTD	3,200	161.790	517,728.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	2,500	111.240	278,100.000	
SG MICRO CORP	4,413	124.250	548,315.250	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	27,340	348.760	9,535,098.400	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,916	612.000	2,396,592.000	
WUXI APPTEC CO LTD	13,972	123.300	1,722,747.600	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	30,200	4.830	145,866.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	73,300	6.300	461,790.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	2.810	231,825.000	
MAXSCEND	2,560	94.690	242,406.400	

MICROELECTRONICS CO LTD				
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	45,100	20.320	916,432.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	33.940	252,004.500	
BANK OF SUZHOU CO LTD	40,700	7.320	297,924.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	3,018	101.500	306,327.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	101.350	111,485.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	56.730	142,959.600	
ANJI MICROELECTRONICS TECHNOLOGY SHANGHAI CO LTD	1,040	312.800	325,312.000	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	6,258	434.510	2,719,163.580	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	8,000	268.060	2,144,480.000	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD	5,200	149.000	774,800.000	
OMNIVISION INTEGRATED CIRCUITS GROUP INC	7,330	103.210	756,529.300	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	26,100	8.950	233,595.000	
TIANFENG SECURITIES CO LTD	43,200	3.720	160,704.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.750	314,325.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	98.470	1,053,629.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.120	201,376.000	
JL MAG RARE-EARTH CO LTD	9,400	28.690	269,686.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	3,480	39.980	139,130.400	
HUNAN YUNENG NEW ENERGY BATTERY MATERIAL CO LTD	7,900	63.150	498,885.000	
CITIC PACIFIC SPECIAL STEEL GROUP CO LTD	21,200	12.800	271,360.000	
BEIJING COMPASS TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	2,900	81.310	235,799.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	301,300	4.660	1,404,058.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	208.800	668,160.000	
SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	7,028	271.120	1,905,431.360	
SUZHOU MAXWELL	1,700	267.000	453,900.000	

TECHNOLOGIES CO LTD				
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	5,520	38.700	213,624.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	170,800	5.040	860,832.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	11.800	247,800.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	41.830	133,856.000	
GUOLIAN MINSHENG SECURITIES CO LTD	26,200	8.870	232,394.000	
HENAN SHIJIA PHOTONS TECHNOLOGY CO LTD	4,000	147.630	590,520.000	
QUANTUMCTEK CO LTD	600	446.700	268,020.000	
ACM RESEARCH SHANGHAI INC	2,200	392.890	864,358.000	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	3,000	292.000	876,000.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	40,600	11.170	453,502.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	7,900	65.700	519,030.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	5,100	103.150	526,065.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	4,700	352.310	1,655,857.000	
SHENZHEN ENVICOOL TECHNOLOGY CO LTD	8,580	73.540	630,973.200	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	7.610	88,062.920	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	5.300	188,680.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	6,577	28.740	189,022.980	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	43.580	126,382.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	14,400	36.170	520,848.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	50.920	234,232.000	
DELTON TECHNOLOGY GUANGZHOU INC	3,800	175.260	665,988.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	4,000	109.000	436,000.000	
SUZHOU EVERBRIGHT PHOTONICS CO LTD	1,600	445.600	712,960.000	
PIOTECH INC	1,876	832.000	1,560,832.000	
DOSILICON CO LTD	2,600	164.000	426,400.000	

	RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,100	82.250	748,475.000	
	ROBOTECHNIK INTELLIGENT TECHNOLOGY CO LTD	900	489.000	440,100.000	
	JINKO SOLAR CO LTD	40,200	4.390	176,478.000	
	CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	3,925	1,400.000	5,495,000.000	
	SHANGHAI ALLIST PHARMACEUTICALS CO LTD	3,400	122.940	417,996.000	
	APT MEDICAL INC	1,450	204.880	297,076.000	
	SHANNON SEMICONDUCTOR TECHNOLOGY CO LTD	2,800	271.000	758,800.000	
	ADVANCED FIBER RESOURCES ZHUHAI LTD	1,900	290.800	552,520.000	
	EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD	2,400	112.400	269,760.000	
	SHENZHEN LONGSYS ELECTRONICS CO LTD	2,300	587.600	1,351,480.000	
	SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,900	51.800	253,820.000	
	ANKER INNOVATIONS TECHNOLOGY CO LTD	3,400	105.920	360,128.000	
	IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,540	89.450	137,753.000	
	SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	7,880	68.500	539,780.000	
	BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	233.760	572,010.720	
	NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	36.400	691,600.000	
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	16.520	142,072.000	
	LOONGSON TECHNOLOGY CORP LTD	1,600	147.100	235,360.000	
	HWATSING TECHNOLOGY CO LTD	4,183	324.600	1,357,801.800	
	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.550	473,280.000	
	SUZHOU CENTEC COMMUNICATIONS CO LTD	2,200	378.680	833,096.000	
	WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	149,700	1.550	232,035.000	
	ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	11,700	24.670	288,639.000	
	PETROCHINA CO LTD	117,300	9.270	1,087,371.000	
	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	356,000	7.330	2,609,480.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	527,900	6.230	3,288,817.000	

	BANK OF CHINA LTD	196,000	5.790	1,134,840.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	223,900	4.760	1,065,764.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	37.420	516,396.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	43,600	42.040	1,832,944.000	
	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	133,000	36.880	4,905,040.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	64,700	49.480	3,201,356.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD	136,000	17.330	2,356,880.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	227,300	9.060	2,059,338.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	237,900	3.340	794,586.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	10.120	430,100.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	8,000	1,204.980	9,639,840.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	340,100	6.610	2,248,061.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD	47,600	7.150	340,340.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	79,400	28.400	2,254,960.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,900	29.620	1,152,218.000	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD	157,800	28.030	4,423,134.000	
	DAQIN RAILWAY CO LTD	206,900	4.680	968,292.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	3.060	704,718.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	287,400	4.590	1,319,166.000	
	HUAXIA BANK CO LTD	70,700	6.780	479,346.000	
	INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	41,900	24.880	1,042,472.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD	138,300	4.900	677,670.000	
	CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	168,900	4.200	709,380.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	117,500	5.480	643,900.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	17.110	396,952.000	
	CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	20.560	849,128.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	6.840	403,560.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	96,300	4.810	463,203.000	
	CRRC CORP LTD	162,500	5.500	893,750.000	
	JIANGSU HENGRUI	41,052	55.750	2,288,649.000	

	PHARMACEUTICALS				
	CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	25,100	42.510	1,067,001.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	20.180	813,254.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD	117,500	4.280	502,900.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,000	62.980	881,720.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD	38,000	20.350	773,300.000	
	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	45,600	18.860	860,016.000	
	GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.760	482,188.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	127,300	10.030	1,276,819.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	23.450	290,780.000	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	38,100	16.940	645,414.000	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	19,800	68.710	1,360,458.000	
	SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	6.820	536,734.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD	81,400	6.640	540,496.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	139,000	27.720	3,853,080.000	
	FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	7.140	393,414.000	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	13.730	524,486.000	
	NARI TECHNOLOGY CO LTD	55,212	22.040	1,216,872.480	
	CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	52.730	516,754.000	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	5.190	160,371.000	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.170	482,825.000	
	TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	53.500	235,400.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	76,300	8.350	637,105.000	
	UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD	10,600	30.360	321,816.000	
	AIR CHINA LTD	91,800	6.000	550,800.000	
	TBEA CO LTD	24,180	20.060	485,050.800	
	CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.390	321,465.000	
	METALLURGICAL CORP OF	56,200	2.570	144,434.000	

	CHINA LTD				
	POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	4.660	485,572.000	
	CHINA CSSC HOLDINGS LTD	41,300	37.040	1,529,752.000	
	SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,600	22.840	264,944.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	42.890	639,061.000	
	HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	25,600	15.960	408,576.000	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	11.920	393,360.000	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	14.670	347,679.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	16.130	183,882.000	
	AECC AVIATION POWER CO LTD	18,300	35.770	654,591.000	
	BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.640	609,672.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	72,870	13.980	1,018,722.600	
	CMOC GROUP LIMITED	111,200	17.500	1,946,000.000	
	ZHONGJIN GOLD CORP LTD	31,700	20.340	644,778.000	
	INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	226,900	6.160	1,397,704.000	
	BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	23.680	213,120.000	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	24.960	502,195.200	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	24.290	189,462.000	
	JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	22.400	620,480.000	
	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	67,500	3.200	216,000.000	
	HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.340	359,522.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	46,800	18.160	849,888.000	
	YUTONG BUS CO LTD	16,300	28.400	462,920.000	
	SHENERGY CO LTD	42,900	8.870	380,523.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	3.660	290,970.000	
	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	28.140	422,634.660	
	HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	4.500	261,000.000	
	CHINA XD ELECTRIC CO LTD	25,700	13.420	344,894.000	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY	16,400	14.830	243,212.000	

DEVELOPMENT CO LTD				
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	21.320	218,828.480	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	9.670	157,137.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	13,100	63.350	829,885.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	5.110	230,461.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	50.790	518,058.000	
SICHUAN CHANGHONG ELECTRIC CO LTD	31,900	6.830	217,877.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.000	134,400.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	31,800	10.170	323,406.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.350	171,390.000	
WESTERN MINING CO LTD	15,100	30.440	459,644.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	4,300	117.050	503,315.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	21,100	37.150	783,865.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,880	110.300	869,164.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	11,500	56.870	654,005.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	15.470	878,696.000	
KINGFA SCI & TECH CO LTD	18,500	15.210	281,385.000	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	9,200	35.170	323,564.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	5,550	29.320	162,726.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	43.420	881,426.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	104,900	4.080	427,992.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	19,000	14.000	266,000.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	26,500	45.910	1,216,615.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	15,900	15.770	250,743.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	8.440	400,562.400	

	YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	27.270	346,329.000	
	SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	15,400	149.390	2,300,606.000	
	WOLONG ELECTRIC GROUP CO LTD	10,700	33.650	360,055.000	
	TONGWEI CO LTD	32,600	11.360	370,336.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	12,784	20.000	255,680.000	
	JCET GROUP CO LTD	10,900	101.110	1,102,099.000	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	44.510	302,668.000	
	SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	13,637	18.630	254,057.310	
	CHONGQING QIANLI TECHNOLOGY CO LTD	33,000	7.790	257,070.000	
	CHINA JUSHI CO LTD	20,246	55.700	1,127,702.200	
	JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	8,424	111.010	935,148.240	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	13,800	77.790	1,073,502.000	
	SAILUN GROUP CO LTD	19,700	12.440	245,068.000	
	ANGEL YEAST CO LTD	4,900	36.530	178,997.000	
	NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	9,004	13.950	125,605.800	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	10,700	38.600	413,020.000	
	NINGBO DEYE TECHNOLOGY CORP	8,985	84.000	754,740.000	
	EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	4,550	121.510	552,870.500	
	CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	79.100	561,610.000	
	GEOVIS TECHNOLOGY CO LTD	5,000	41.950	209,750.000	
	TRINA SOLAR CO LTD	11,100	12.980	144,078.000	
	CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	3.740	567,732.000	
	SICHUAN BIOKIN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	310.900	808,340.000	
	BIWIN STORAGE TECHNOLOGY CO LTD	2,800	388.500	1,087,800.000	
	YUANJIE SEMICONDUCTOR TECHNOLOGY CO LTD	780	1,609.000	1,255,020.000	
	ZANGGE MINING CO LTD	11,600	69.300	803,880.000	
	DAZHONG MINING CO LTD	12,300	28.900	355,470.000	
	DAJIN HEAVY INDUSTRY CO LTD	6,100	46.210	281,881.000	
	REMEGEN CO LTD	3,800	134.020	509,276.000	
	SHANGHAI RURAL	52,200	7.660	399,852.000	

COMMERCIAL BANK CO LTD				
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	7,760	105.880	821,628.800	
CSI SOLAR CO LTD	32,400	10.110	327,564.000	
SICHUAN HUAFENG TECHNOLOGY CO LTD	4,600	202.000	929,200.000	
SHENGYI ELECTRONICS CO LTD	4,600	123.000	565,800.000	
SHENZHEN TECHWINSEMI TECHNOLOGY CO LTD	1,400	799.980	1,119,972.000	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	15,400	353.000	5,436,200.000	
CICT MOBILE COMMUNICATION TECHNOLOGY CO LTD	20,800	22.280	463,424.000	
GUOBO ELECTRONICS CO LTD	2,400	113.010	271,224.000	
SHARETRONIC DATA TECHNOLOGY CO LTD	3,500	277.960	972,860.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	44,968	12.110	544,562.480	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	93.340	168,012.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.400	395,820.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	61,351	22.920	1,406,164.920	
HUAQIN CO LTD	5,320	82.800	440,496.000	
HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR LTD	3,000	369.870	1,109,610.000	
SHANDONG HONGQIAO ALUMINUM INDUSTRY HOLDING CO LTD	18,900	14.450	273,105.000	
NEXCHIP SEMICONDUCTOR CORP	17,000	54.120	920,040.000	
SKYVERSE TECHNOLOGY CO LTD	2,000	422.740	845,480.000	
UNITED NOVA TECHNOLOGY CO LTD	76,800	9.010	691,968.000	
CHENGTUN MINING GROUP CO LTD	19,900	10.740	213,726.000	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	25,519	33.720	860,500.680	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	13.780	181,896.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	10,150	57.360	582,204.000	
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD	126,110	18.300	2,307,813.000	

	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	155,200	8.910	1,382,832.000	
	JIANGSU ETERN CO LTD	14,500	49.040	711,080.000	
	SERES GROUP CO LTD	9,000	59.900	539,100.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	108,700	11.080	1,204,396.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	33,900	15.140	513,246.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	21,200	16.740	354,888.000	
	SHENZHEN KINWONG ELECTRONIC CO LTD	4,300	70.050	301,215.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	50,400	12.940	652,176.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.500	274,950.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	15.500	285,200.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,616	14.240	79,971.840	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	13,572	15.950	216,473.400	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	44,800	9.120	408,576.000	
	FOUNDER TECHNOLOGY GROUP CORP	25,600	13.180	337,408.000	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING GROUP LTD	14,900	32.840	489,316.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	46.030	303,798.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	97,300	14.980	1,457,554.000	
オフショア・人民元　小計		15,664,023		319,196,964.060 (7,623,029,976)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	465,240	17.220	8,011,432.800	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	305,334	4.040	1,233,549.360	
	OOREDOO QSC	91,110	13.150	1,198,096.500	
	QATAR FUEL QSC	57,879	14.020	811,463.580	
	NEBRAS ENERGY	59,319	14.620	867,243.780	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	101,753	11.170	1,136,581.010	
	INDUSTRIES QATAR QSC	162,839	10.860	1,768,431.540	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	182,517	21.330	3,893,087.610	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	284,685	4.265	1,214,181.520	
	AL RAYAN BANK	580,363	2.000	1,160,726.000	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	555,481	1.130	627,693.530	
	DUKHAN BANK	178,162	3.343	595,595.560	
カタール・リアル　小計		3,024,682		22,518,082.790 (1,003,630,950)	
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	0.596	127,516.580	
	GULF BANK KSCP	233,639	0.356	83,175.480	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	934,120	0.807	753,834.840	
	MABANEE CO KPSC	72,047	0.928	66,859.610	
	BOUBYAN BANK KSCP	154,751	0.633	97,957.380	
	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		2,087,183.690 (1,096,543,695)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	49,088	30,020.000	1,473,621,760.000	
	GRUPO CIBEST SA	24,801	81,000.000	2,008,881,000.000	
	GRUPO CIBEST SA	45,569	67,400.000	3,071,350,600.000	
コロンビア・ペソ　小計		119,458		6,553,853,360.000 (327,351,868)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	27,314	31.440	858,752.160	
	JARIR MARKETING CO	60,555	17.500	1,059,712.500	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	7,248	138.600	1,004,572.800	
	MAKKAH CONSTRUCTION & DEVELOPMENT CO	10,427	86.950	906,627.650	
	ETIHAD ETISALAT CO	39,442	62.150	2,451,320.300	
	SAUDI BRITISH BANK	104,013	32.100	3,338,817.300	
	AL RAJHI BANK	312,490	65.100	20,343,099.000	
	ARAB NATIONAL BANK	97,011	21.070	2,044,021.770	
	BANK ALBILAD	81,739	24.290	1,985,440.310	
	BANK AL-JAZIRA	84,904	11.790	1,001,018.160	
	BANQUE SAUDI FRANSI	121,586	19.540	2,375,790.440	
	RIYAD BANK	215,176	20.580	4,428,322.080	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	56,260	13.520	760,635.200	
	SAUDI TELECOM CO	209,410	43.440	9,096,770.400	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	25,555	127.000	3,245,485.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	100,957	52.200	5,269,955.400	
	SAUDI ENERGY CO	84,386	18.000	1,518,948.000	
	ALMARAI CO JSC	47,828	46.520	2,224,958.560	
	JABAL OMAR DEVELOPMENT CO	60,707	15.520	942,172.640	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	54,640	18.700	1,021,768.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	8,423	161.300	1,358,629.900	
	ALINMA BANK	159,681	24.290	3,878,651.490	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	121,503	58.800	7,144,376.400	
	MOUWASAT MEDICAL	10,690	62.150	664,383.500	

	SERVICES CO				
	SAUDI ARABIAN OIL CO	637,116	26.780	17,061,966.480	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,562	214.800	1,839,117.600	
	ACWA POWER CO	24,817	190.300	4,722,675.100	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,198	206.200	453,227.600	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	4,735	132.200	625,967.000	
	ELM CO	2,637	663.000	1,748,331.000	
	ADES HOLDING CO	35,063	19.180	672,508.340	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	4,712	175.800	828,369.600	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	310,804	38.360	11,922,441.440	
サウジアラビア・リアル　小計		3,132,589		118,798,833.120 (5,140,425,509)	
タイ・バーツ	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	381,700	40.750	15,554,275.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	66,000	232.000	15,312,000.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,204,900	2.640	5,820,936.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	375,700	22.200	8,340,540.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	103,900	373.000	38,754,700.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	331,500	313.000	103,759,500.000	
	PTT PCL	1,074,100	37.500	40,278,750.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	77,550	245.000	18,999,750.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	420,900	63.500	26,727,150.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	196,200	67.000	13,145,400.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,112,200	19.600	21,799,120.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	55,900	186.500	10,425,350.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	327,810	23.500	7,703,535.000	
	CP ALL PCL NVDR	575,800	46.750	26,918,650.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	127,745	139.500	17,820,427.500	
	GULF DEVELOPMENT PCL NVDR	403,874	63.500	25,645,999.000	
	SCB X PCL NVDR	94,700	156.500	14,820,550.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,034,228	13.600	14,065,500.800	
タイ・バーツ　小計		8,964,707		425,892,133.300 (2,069,835,768)	
チェコ・コル	KOMERCNI BANKA AS	8,306	985.000	8,181,410.000	

ナ					
	CEZ	13,559	1,300.000	17,626,700.000	
	MONETA MONEY BANK AS	23,959	193.400	4,633,670.600	
チェコ・コルナ　小計		45,824		30,441,780.600 (231,744,143)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,919,485	79.000	546,639,315.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	8,508	63,500.000	540,258,000.000	
	BANCO DE CHILE	4,887,223	188.880	923,098,680.240	
	EMPRESAS COPEC SA	36,661	6,139.000	225,061,879.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	37,177,986	26.260	976,293,912.360	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	15,257	67,750.000	1,033,661,750.000	
	FALABELLA SA	73,380	5,905.000	433,308,900.000	
	CENCOSUD SA	145,870	2,045.100	298,318,737.000	
	ENEL CHILE SA	2,582,189	81.700	210,964,841.300	
	PLAZA SA	75,590	3,901.000	294,876,590.000	
チリ・ペソ　小計		51,922,149		5,482,482,604.900 (960,827,006)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	328,217	68.750	22,564,918.750	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	121,617	370.000	44,998,290.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	348,668	40.400	14,086,187.200	
	KOC HOLDING AS	75,955	192.800	14,644,124.000	
	TURK HAVA YOLLARI	53,238	344.500	18,340,491.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	124,785	107.000	13,351,995.000	
	TURKIYE IS BANKASI	852,515	13.780	11,747,656.700	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	108,640	267.000	29,006,880.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	333,172	35.140	11,707,664.080	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	127,546	90.500	11,542,913.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	99,212	372.500	36,956,470.000	
トルコ・リラ　小計		2,573,565		228,947,589.730 (791,174,186)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	13,519	12,090.000	163,444,710.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	41,431	4,076.000	168,872,756.000	
	OTP BANK NYRT	23,146	45,800.000	1,060,086,800.000	
ハンガリー・フォリント　小計		78,096		1,392,404,266.000 (720,569,208)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	582,600	16.000	9,321,600.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	211,828	103.000	21,818,284.000	
	AYALA CORP	28,113	476.000	13,381,788.000	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	102,520	985.000	100,982,200.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	152,915	65.150	9,962,412.250	
	BDO UNIBANK INC	235,537	124.200	29,253,695.400	
	PLDT INC	8,765	1,163.000	10,193,695.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	945,875	18.240	17,252,760.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,623	590.000	13,937,570.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	25,700	578.000	14,854,600.000	
フィリピン・ペソ　小計		2,317,476		240,958,604.650 (634,757,252)	
ブラジル・レアル	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	196,000	15.530	3,043,880.000	
	VALE SA	379,089	74.180	28,120,822.020	
	RAIA DROGASIL SA	131,951	18.770	2,476,720.270	
	AXIA ENERGIA SA	135,595	54.030	7,326,197.850	
	BANCO DO BRASIL SA	184,100	20.580	3,788,778.000	
	ITAUSA SA	593,614	14.170	8,411,510.380	
	GERDAU SA	141,637	23.010	3,259,067.370	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	402,810	44.190	17,800,173.900	
	VIBRA ENERGIA SA	116,582	33.000	3,847,206.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	453,712	39.650	17,989,680.800	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOBILIDADE SA	112,420	15.150	1,703,163.000	
	WEG SA	152,544	46.510	7,094,821.440	
	BANCO BRADESCO SA PREF	576,702	18.860	10,876,599.720	
	BANCO BRADESCO SA	152,592	16.460	2,511,664.320	
	SUZANO SA	68,975	41.550	2,865,911.250	
	CPFL ENERGIA SA	23,800	47.870	1,139,306.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	583,423	44.300	25,845,638.900	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	45,400	46.460	2,109,284.000	
	PORTO SEGURO SA	20,100	54.970	1,104,897.000	
	ENGIE BRASIL SA	32,881	33.580	1,104,143.980	
	LOCALIZA RENT A CAR	90,589	41.100	3,723,207.900	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	70,304	30.710	2,159,035.840	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	118,100	40.910	4,831,471.000	
	EMBRAER SA	70,000	84.600	5,922,000.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	185,140	11.380	2,106,893.200	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	249,607	31.110	7,765,273.770	
	MBRF GLOBAL FOODS COMPANY SA	66,640	15.550	1,036,252.000	
	ENEVA SA	101,600	27.550	2,799,080.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	537,548	15.420	8,288,990.160	

	PRIO SA	85,700	55.450	4,752,065.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	81,600	35.750	2,917,200.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	66,300	40.350	2,675,205.000	
	AMBEV SA	476,395	15.820	7,536,568.900	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	52,100	22.050	1,148,805.000	
	TIM SA	88,100	22.780	2,006,918.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	77,200	36.020	2,780,744.000	
	AXIA ENERGIA SA-C	37,274	52.850	1,969,930.900	
	RUMO SA	136,200	14.360	1,955,832.000	
ブラジル・レアル　小計		7,094,324		218,794,938.870 (6,941,400,713)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	68,864	20.810	1,433,059.840	
	MBANK	1,453	1,430.000	2,077,790.000	
	BUDIMEX SA	1,403	729.800	1,023,909.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,890	308.950	4,600,265.500	
	BANK PEKAO SA	18,555	244.300	4,532,986.500	
	ORLEN SA	61,308	139.920	8,578,215.360	
	ASSECO POLAND SA	4,956	177.750	880,929.000	
	LPP SA	122	19,380.000	2,364,360.000	
	ERSTE BANK POLSKA SA	4,377	687.200	3,007,874.400	
	CD PROJEKT RED SA	6,738	233.000	1,569,954.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	94,045	112.880	10,615,799.600	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	104,937	9.372	983,469.560	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	59,477	69.420	4,128,893.340	
	DINO POLSKA SA	48,070	28.220	1,356,535.400	
	ALLEGRO.EU SA	85,638	39.830	3,410,961.540	
	ZABKA GROUP SA	36,260	27.710	1,004,764.600	
ポーランド・ズロチ　小計		611,093		51,569,768.040 (2,198,223,246)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	272,300	6.500	1,769,950.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	823,100	7.640	6,288,484.000	
	CELCOMDIGI BHD	372,600	2.990	1,114,074.000	
	RHB BANK BHD	215,180	8.290	1,783,842.200	
	GAMUDA BHD	555,900	4.130	2,295,867.000	
	HONG LEONG BANK BHD	62,908	21.880	1,376,427.040	
	IOI CORP BHD	231,913	4.510	1,045,927.630	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	47,600	21.600	1,028,160.000	
	MALAYAN BANKING BHD	598,075	10.900	6,519,017.500	
	MISC BHD	157,880	7.890	1,245,673.200	
	PETRONAS GAS BHD	78,500	17.520	1,375,320.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	131,600	7.580	997,528.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	285,550	14.300	4,083,365.000	

	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,523,650	4.890	7,450,648.500	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	313,320	4.360	1,366,075.200	
	MAXIS BHD	228,800	3.580	819,104.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	265,400	4.300	1,141,220.000	
	SUNWAY BHD	293,800	5.200	1,527,760.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	173,900	8.440	1,467,716.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	396,600	7.700	3,053,820.000	
	SD GUTHRIE BHD	205,700	6.240	1,283,568.000	
マレーシア・リンギット　小計		7,234,276		49,033,547.270 (1,948,656,912)	
メキシコ・ペソ	SIGMA FOODS SAB DE CV	367,756	16.120	5,928,226.720	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	145,000	56.100	8,134,500.000	
	GRUMA SAB DE CV	18,575	283.550	5,266,941.250	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	19,800	281.040	5,564,592.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	56,800	126.440	7,181,792.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	257,100	186.590	47,972,289.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	19,295	789.560	15,234,560.200	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	155,900	38.070	5,935,113.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,965	499.070	8,965,792.550	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	304,862	199.230	60,737,656.260	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	147,700	41.490	6,128,073.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	55,380	198.230	10,977,977.400	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	556,000	49.320	27,421,920.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	41,940	412.470	17,298,991.800	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	26,900	236.480	6,361,312.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,603,878	22.730	36,456,146.940	
メキシコ・ペソ　小計		3,794,851		275,565,884.120 (2,550,748,050)	
ユーロ	GEK TERNA SA	5,566	44.400	247,130.400	
	NATIONAL BANK OF GREECE	90,434	15.800	1,428,857.200	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,480	19.640	284,387.200	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	ALLWYN AG	17,320	13.360	231,395.200	
	JUMBO SA	11,425	22.700	259,347.500	
	PUBLIC POWER CORP	27,615	23.260	642,324.900	
	ALPHA BANK SA	173,066	4.110	711,301.260	

	PIRAEUS BANK SA	113,139	9.250	1,046,535.750	
	EUROBANK SA	264,312	4.384	1,158,743.800	
ユーロ　小計		720,487		6,010,023.210 (1,110,411,888)	
韓国・ウォン	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,819	204,000.000	779,076,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,120	648,000.000	2,021,760,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,735	155,800.000	737,713,000.000	
	KT&G CORP	9,745	173,500.000	1,690,757,500.000	
	KAKAO CORP	31,822	35,350.000	1,124,907,700.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,033	81,300.000	1,140,882,900.000	
	SK TELECOM CO LTD	11,428	88,700.000	1,013,663,600.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	21,070	42,200.000	889,154,000.000	
	LG UPLUS CORP	8,998	14,960.000	134,610,080.000	
	DOOSAN ENERBILITY	47,915	78,100.000	3,742,161,500.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,213	49,500.000	258,043,500.000	
	LG CHEM LTD	4,872	264,000.000	1,286,208,000.000	
	LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	8,048	202,500.000	1,629,720,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	44,231	109,200.000	4,830,025,200.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	22,754	19,740.000	449,163,960.000	
	S-OIL CORP	4,930	132,100.000	651,253,000.000	
	POSCO FUTURE M CO LTD	3,432	151,800.000	520,977,600.000	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,543	340,500.000	1,546,891,500.000	
	HYUNDAI MOBIS	6,297	488,000.000	3,072,936,000.000	
	SK HYNIX INC	58,729	2,180,000.000	128,029,220,000.000	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,612	107,200.000	816,006,400.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	2,175	204,500.000	444,787,500.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	14,184	457,500.000	6,489,180,000.000	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	26,462	21,250.000	562,317,500.000	
	KIA CORPORATION	24,711	147,500.000	3,644,872,500.000	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,756	36,200.000	1,004,767,200.000	
	KOREAN AIR CO LTD	22,115	26,750.000	591,576,250.000	
	HLB INC	12,328	36,600.000	451,204,800.000	
	LG ELECTRONICS INC	11,318	182,400.000	2,064,403,200.000	
	LG CORP	9,665	101,300.000	979,064,500.000	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,334	31,600.000	421,354,400.000	
	NAVER CORP	15,075	191,300.000	2,883,847,500.000	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,489	239,000.000	1,072,871,000.000	

	DOOSAN CORP	789	1,382,000.000	1,090,398,000.000	
	POSCO HOLDINGS INC	7,489	313,500.000	2,347,801,500.000	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,364	434,000.000	2,761,976,000.000	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,961	1,584,000.000	9,442,224,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	497,330	285,000.000	141,739,050,000.000	
	SAMYANG FOODS CO LTD	432	1,139,000.000	492,048,000.000	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	71,710	22,350.000	1,602,718,500.000	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,519	967,000.000	3,402,873,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	85,260	194,300.000	16,566,018,000.000	
	YUHAN CORP	5,429	68,500.000	371,886,500.000	
	LG DISPLAY CO LTD	31,713	11,010.000	349,160,130.000	
	CELLTRION INC	16,188	175,200.000	2,836,137,600.000	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	4,352	222,000.000	966,144,000.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	29,048	128,500.000	3,732,668,000.000	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	3,831	191,600.000	734,019,600.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,431	340,500.000	2,870,755,500.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,716	123,100.000	334,339,600.000	
	SK INNOVATION CO LTD	7,298	102,900.000	750,964,200.000	
	ECOPRO CO LTD	10,993	85,800.000	943,199,400.000	
	SK INC	3,768	657,000.000	2,475,576,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	37,811	184,400.000	6,972,348,400.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,220	144,300.000	1,041,846,000.000	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,283	115,000.000	952,545,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,041	71,500.000	503,431,500.000	
	HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SYSTEM CO LTD	2,470	851,000.000	2,101,970,000.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	4,410	199,500.000	879,795,000.000	
	HYOSUNG HEAVY INDUSTRIES CORP	544	2,924,000.000	1,590,656,000.000	
	HYUNDAI ROTEM CO LTD	7,456	178,900.000	1,333,878,400.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	67,700	31,450.000	2,129,165,000.000	
	ECOPRO BM CO LTD	5,815	121,600.000	707,104,000.000	
	HANWHA SYSTEMS CO LTD	8,286	71,700.000	594,106,200.000	
	KRAFTON INC	3,094	238,000.000	736,372,000.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	3,332	504,000.000	1,679,328,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	9,825	1,409,000.000	13,843,425,000.000	
	HYBE CO LTD	2,400	220,500.000	529,200,000.000	
	APR CORP/KOREA	2,455	375,000.000	920,625,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	5,032	326,000.000	1,640,432,000.000	
	KAKAOBANK CORP	16,051	22,900.000	367,567,900.000	

	SAMSUNG SDS CO LTD	4,086	199,600.000	815,565,600.000	
	ALTEOGEN INC	4,112	324,000.000	1,332,288,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,652	391,500.000	3,387,258,000.000	
	SAMSUNG EPISHOLDINGS CO LTD	740	384,500.000	284,530,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,243	1,395,000.000	1,733,985,000.000	
	LIG DEFENSE&AEROSPACE CO LTD	1,300	749,000.000	973,700,000.000	
韓国・ウォン　小計		1,532,937		419,836,457,320.000 (45,236,958,440)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	106,000	31.220	3,309,320.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	124,000	16.850	2,089,400.000	
	BEIJING ENTERPRISES	47,000	29.200	1,372,400.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	396,000	5.580	2,209,680.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	556,000	3.470	1,929,320.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	306,700	10.610	3,254,087.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	77,500	23.160	1,794,900.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	829,600	8.110	6,728,056.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	421,120	12.910	5,436,659.200	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	315,888	32.180	10,165,275.840	
	CITIC LTD	462,000	11.020	5,091,240.000	
	LENOVO GROUP LTD	824,000	24.480	20,171,520.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,266,000	9.030	20,461,980.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	145,990	18.580	2,712,494.200	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,427,200	4.060	9,854,432.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	282,000	6.980	1,968,360.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	78,600	42.220	3,318,492.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	438,000	6.620	2,899,560.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	122,000	13.180	1,607,960.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	390,000	7.620	2,971,800.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	259,600	5.480	1,422,608.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	695,000	18.640	12,954,800.000	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	89,800	14.940	1,341,612.000	
	BYD CO LTD	393,500	84.900	33,408,150.000	

CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	6.490	1,038,400.000	
MMG LTD	456,000	7.160	3,264,960.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	12,500	128.800	1,610,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	741,788	14.180	10,518,553.840	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	205,200	17.460	3,582,792.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	222,000	8.640	1,918,080.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	793,000	28.420	22,537,060.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	619,000	30.000	18,570,000.000	
WEICHAI POWER CO LTD	205,440	34.260	7,038,374.400	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	146,000	13.080	1,909,680.000	
TINGYI HOLDING CORP	220,000	11.060	2,433,200.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	62,000	44.440	2,755,280.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	270,000	7.580	2,046,600.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	179,833	22.200	3,992,292.600	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,083,250	5.190	5,622,067.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	306,000	17.210	5,266,260.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	655,100	460.200	301,477,020.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	697,500	53.050	37,002,375.000	
LI NING CO LTD	241,500	14.670	3,542,805.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	416,000	2.740	1,139,840.000	
ZTE CORP	75,488	25.700	1,940,041.600	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	355,500	40.860	14,525,730.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	255,750	13.930	3,562,597.500	
BANK OF COMMUNICATIONS	862,205	6.830	5,888,860.150	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	82,000	38.680	3,171,760.000	
BAIDU INC	225,250	115.400	25,993,850.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,943,530	8.130	72,710,898.900	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	92,000	43.700	4,020,400.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	416,000	4.210	1,751,360.000	
BANK OF CHINA LTD	7,189,200	5.090	36,593,028.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	401,470	45.720	18,355,208.400	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,956,235	6.660	46,328,525.100	

ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	173,500	18.490	3,208,015.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	108,000	62.800	6,782,400.000	
CHINA COAL ENERGY CO	192,000	9.920	1,904,640.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	80,000	18.760	1,500,800.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	45,600	34.940	1,593,264.000	
CMOC GROUP LIMITED	387,000	14.950	5,785,650.000	
CHINA CITIC BANK-H	869,800	6.820	5,932,036.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	68,800	55.900	3,845,920.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	134,800	72.950	9,833,660.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	462,000	4.750	2,194,500.000	
KINGSOFT CORP LTD	99,200	24.100	2,390,720.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,537,000	0.640	1,623,680.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	93,000	39.820	3,703,260.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	436,000	3.370	1,469,320.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	81,500	21.760	1,773,440.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	547,000	3.330	1,821,510.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	286,800	27.400	7,858,320.000	
CRRC CORP LTD - H	400,000	4.570	1,828,000.000	
SINOPHARM GROUP CO	136,000	16.730	2,275,280.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	346,000	20.740	7,176,040.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	232,000	6.060	1,405,920.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	234,000	5.210	1,219,140.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	207,400	11.600	2,405,840.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	220,000	6.100	1,342,000.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	96,000	45.300	4,348,800.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	3.250	2,041,507.000	
CHINA GOLD INTERNATIONAL RESOURCES CORP LTD	24,500	138.900	3,403,050.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,876,000	5.490	15,789,240.000	
FAR EAST HORIZON LTD	243,000	5.820	1,414,260.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	163,000	27.300	4,449,900.000	

	CHINA NONFERROUS MINING CORP LTD	137,000	12.000	1,644,000.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	1,000,000	4.950	4,950,000.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	336,000	7.250	2,436,000.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
	CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
	GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD	205,352	14.640	3,006,353.280	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	875,000	4.670	4,086,250.000	
	GENSCRIPT BIOTECH CORP	146,000	13.840	2,020,640.000	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	99,750	18.370	1,832,407.500	
	CHINA TOWER CORP LTD	494,000	9.170	4,529,980.000	
	XIAOMI CORP	1,827,800	25.840	47,230,352.000	
	BEONE MEDICINES LTD	86,700	183.500	15,909,450.000	
	WUXI APPTEC CO LTD	45,112	155.100	6,996,871.200	
	MEITUAN	538,110	78.700	42,349,257.000	
	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	122,800	12.510	1,536,228.000	
	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	157,000	10.950	1,719,150.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	486,000	1.990	967,140.000	
	INNOVENT BIOLOGICS INC	149,500	89.700	13,410,150.000	
	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	49,000	37.740	1,849,260.000	
	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	130,000	31.940	4,152,200.000	
	CHINA FEIHE LTD	407,000	3.020	1,229,140.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,781,168	110.200	196,284,713.600	
	JD.COM INC	241,735	110.200	26,639,197.000	
	SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	186,000	7.630	1,419,180.000	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	270,800	43.040	11,655,232.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD	252,600	20.140	5,087,364.000	
	BILIBILI INC	27,800	139.200	3,869,760.000	
	AKESO INC	69,000	97.250	6,710,250.000	
	NETEASE INC	187,000	206.800	38,671,600.000	
	REMEGEN CO LTD	19,000	84.100	1,597,900.000	
	PONY AI INC	18,900	52.450	991,305.000	
	GDS HOLDINGS LTD	110,100	31.720	3,492,372.000	
	NONGFU SPRING CO LTD	198,600	39.740	7,892,364.000	
	LI AUTO INC	132,400	47.420	6,278,408.000	
	JD HEALTH INTERNATIONAL	110,650	37.300	4,127,245.000	

INC				
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	75,800	37.860	2,869,788.000	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	41,800	185.400	7,749,720.000	
YUM CHINA HOLDINGS INC	36,250	337.200	12,223,500.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	134,300	38.120	5,119,516.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	52,800	150.700	7,956,960.000	
KE HOLDINGS INC	210,600	40.620	8,554,572.000	
JD LOGISTICS INC	189,500	12.680	2,402,860.000	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	42,400	26.020	1,103,248.000	
TRIP.COM GROUP LTD	62,850	329.400	20,702,790.000	
XPENG INC	135,200	51.250	6,929,000.000	
SENSETIME GROUP INC	3,072,000	1.410	4,331,520.000	
NIO INC	188,720	38.660	7,295,915.200	
SICHUAN KELUN-BIOTECH BIOPHARMACEUTICAL CO LTD	5,300	516.500	2,737,450.000	
MIDEA GROUP CO LTD	42,500	88.750	3,771,875.000	
WUXI XDC CAYMAN INC	37,500	60.300	2,261,250.000	
MINISO GROUP HOLDING LTD	49,000	23.020	1,127,980.000	
XTALPI HOLDINGS LTD	176,000	7.920	1,393,920.000	
UBTECH ROBOTICS CORP LTD	20,550	85.050	1,747,777.500	
HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR LTD	77,000	185.500	14,283,500.000	
J&T GLOBAL EXPRESS LTD	229,400	9.080	2,082,952.000	
HORIZON ROBOTICS INC	514,200	4.420	2,272,764.000	
LAOPU GOLD CO LTD	4,500	391.200	1,760,400.000	
CGN POWER CO LTD	1,071,000	2.750	2,945,250.000	
YANGTZE OPTICAL FIBRE AND CABLE JOINT STOCK LTD CO	39,000	159.800	6,232,200.000	
ZIJIN GOLD INTERNATIONAL CO LTD	37,400	98.300	3,676,420.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	18,900	587.000	11,094,300.000	
HESAI GROUP	91,840	16.570	1,521,788.800	
GF SECURITIES CO LTD	111,400	16.670	1,857,038.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	68,800	51.100	3,515,680.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	136,000	16.320	2,219,520.000	
3SBIO INC	208,500	18.070	3,767,595.000	
BOC AVIATION LTD	25,000	78.950	1,973,750.000	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	9.540	1,182,960.000	

	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	174,400	21.580	3,763,552.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	377,500	37.960	14,329,900.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	1,180,000	1.570	1,852,600.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	50,400	41.620	2,097,648.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	82,000	13.780	1,129,960.000	
香港・ドル　小計		79,409,480		1,603,313,257.310 (33,156,518,161)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	53,826	2,470.000	132,950,220.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	69,258	684.000	47,372,472.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	52,966	840.000	44,491,440.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	710,401	17.950	12,751,697.950	
	GOLD CIRCUIT ELECTRONICS LTD	34,954	1,075.000	37,575,550.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	131,262	173.000	22,708,326.000	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	55,350	336.500	18,625,275.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	142,637	875.000	124,807,375.000	
	QUANTA COMPUTER INC	288,078	373.500	107,597,133.000	
	EVA AIRWAYS CORP	270,721	39.600	10,720,551.600	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	774,279	24.050	18,621,409.950	
	CHINA STEEL CORP	1,259,775	18.550	23,368,826.250	
	ADVANTECH CO LTD	51,304	540.000	27,704,160.000	
	CHROMA ATE INC	38,774	1,820.000	70,568,680.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	207,178	1,880.000	389,494,640.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	406,096	133.500	54,213,816.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	185,636	108.500	20,141,506.000	
	ELITE MATERIAL CO LTD	30,511	5,295.000	161,555,745.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	118,157	194.500	22,981,536.500	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	57,522	542.000	31,176,924.000	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	14,657	721.000	10,567,697.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	397,769	54.800	21,797,741.200	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	370,722	60.000	22,243,320.000	
	KING YUAN ELECTRONICS CO LTD	112,907	308.500	34,831,809.500	
	MEDIATEK INC	153,521	3,925.000	602,569,925.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	890,051	124.500	110,811,349.500	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	971,000	38.850	37,723,350.000	
	HOTAI MOTOR CO LTD	33,668	476.500	16,042,802.000	

FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	195,577	95.000	18,579,815.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,131,543	68.300	77,284,386.900	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,012,658	96.300	97,518,965.400	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,607,982	30.050	48,319,859.100	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,519,808	34.750	52,813,328.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,299,889	237.500	308,723,637.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,218,878	46.700	56,921,602.600	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,349	3,950.000	40,878,550.000	
TS FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,251,617	36.850	82,972,086.450	
INVENTEC CO LTD	250,778	69.800	17,504,304.400	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	211,545	213.500	45,164,857.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,267,856	40.450	51,284,775.200	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,788,777	69.900	125,035,512.300	
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	34,472	2,350.000	81,009,200.000	
MPI CORP	9,017	7,080.000	63,840,360.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,203,362	33.600	40,432,963.200	
NAN YA PLASTICS CORP	502,923	181.500	91,280,524.500	
WISTRON CORP	321,533	144.500	46,461,518.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	503,007	78.400	39,435,748.800	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,940	241.000	13,722,540.000	
E INK HOLDINGS INC	83,129	200.500	16,667,364.500	
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM CO LTD	24,417	744.000	18,166,248.000	
TCC GROUP HOLDINGS	675,532	22.700	15,334,576.400	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,619,396	2,415.000	6,325,841,340.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,206,610	156.000	188,231,160.000	
WAN HAI LINES LTD	63,482	80.400	5,103,952.800	
YAGEO CORP	165,584	900.000	149,025,600.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	206,015	51.600	10,630,374.000	
KING SLIDE WORKS CO LTD	6,097	8,250.000	50,300,250.000	
GLOBAL UNICHIP CORP	9,196	4,340.000	39,910,640.000	
INNOLUX CORPORATION	784,074	65.300	51,200,032.200	
LOTES CO LTD	8,806	1,955.000	17,215,730.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,837	2,605.000	17,810,385.000	

	JENTECH PRECISION INDUSTRIAL CO LTD	9,423	3,205.000	30,200,715.000	
	PEGATRON CORP	219,164	82.700	18,124,862.800	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	7,967	4,210.000	33,541,070.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,474	1,280.000	18,526,720.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	155,328	114.500	17,785,056.000	
	BIZLINK HOLDING INC	18,806	1,865.000	35,073,190.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	79,150	588.000	46,540,200.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,205,605	25.150	30,320,965.750	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	425,231	42.800	18,199,886.800	
	ASPEED TECHNOLOGY INC	3,494	13,665.000	47,745,510.000	
	WIWYNN CORP	10,950	5,040.000	55,188,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	355,086	677.000	240,393,222.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	32,074	1,285.000	41,215,090.000	
	CALIWAY BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	95,155	107.500	10,229,162.500	
	GLOBALWAFERS CO LTD	28,482	1,350.000	38,450,700.000	
	HON PRECISION INC	8,481	6,660.000	56,483,460.000	
台湾・ドル　小計		32,809,536		11,278,655,277.550 (56,776,750,666)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	32,012	235.420	7,536,265.040	
	CLICKS GROUP LTD	26,121	225.000	5,877,225.000	
	DISCOVERY LTD	57,591	259.370	14,937,377.670	
	GOLD FIELDS LTD	95,778	560.000	53,635,680.000	
	REMGRO LTD	55,901	190.150	10,629,575.150	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	58,146	248.490	14,448,699.540	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,155	4,743.540	43,427,108.700	
	MTN GROUP LTD	185,699	228.590	42,448,934.410	
	FIRSTRAND LTD	536,179	96.850	51,928,936.150	
	NASPERS LTD	81,598	859.910	70,166,936.180	
	NEDBANK GROUP LTD	47,000	270.990	12,736,530.000	
	VALTERRA PLATINUM LIMITED	28,554	1,090.000	31,123,860.000	
	SASOL LTD	59,212	170.150	10,074,921.800	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	50,878	283.700	14,434,088.600	
	STANDARD BANK GROUP LTD	139,430	324.480	45,242,246.400	
	ABSA GROUP LTD	91,225	215.970	19,701,863.250	
	SANLAM LTD	186,989	89.270	16,692,508.030	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	100,431	181.700	18,248,312.700	

	OUTSURANCE GROUP LTD	88,389	80.370	7,103,823.930	
	VODACOM GROUP PTY LTD	66,682	152.590	10,175,006.380	
	NEPI ROCKCASTLE NV	57,465	147.700	8,487,580.500	
	REINET INVESTMENTS SCA	14,066	446.140	6,275,405.240	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	398,857	21.770	8,683,116.890	
	SIBANYE STILLWATER LTD	291,568	34.580	10,082,421.440	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	37,574	233.520	8,774,280.480	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	54,073	1,330.000	71,917,090.000	
	BID CORP LTD	34,891	431.300	15,048,488.300	
南アフリカ・ランド　小計		2,885,464		629,838,281.780 (6,235,398,990)	
合計		378,640,262		207,880,743,063 (207,880,743,063)	

（2）株式以外の有価証券

2026年7月13日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	121,900.000	7,159,187.000	
		ENERGISA SA	31,460.000	1,639,695.200	
		KLABIN SA	79,032.000	1,386,221.280	
	ブラジル・レアル　小計		232,392.000	10,185,103.480 (323,128,519)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,633,475.000	35,707,763.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	59,700.000	10,849,281.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	180,905.000	40,397,895.550	
	メキシコ・ペソ　小計		1,874,080.000	86,954,940.050 (804,889,708)	
投資信託受益証券　合計			2,106,472	1,128,018,227 (1,128,018,227)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	275,500.000	8,276,020.000	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA DE CV	112,105.000	8,671,321.750	
	メキシコ・ペソ　小計		387,605.000	16,947,341.750 (156,871,374)	
投資証券　合計			387,605	156,871,374 (156,871,374)	
合計				1,284,889,601 (1,284,889,601)	

（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	組入投資信託受益証	組入投資証	有価証券の合計金額に

			時価比率（%）	券時価比率（%）	券時価比率（%）	対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式	37銘柄	1.71	－	－	1.77
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式	16銘柄	1.15	－	－	1.19
インド・ルピー	株式	165銘柄	11.04	－	－	11.45
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	3.51	－	－	3.64
カタール・リアル	株式	12銘柄	0.46	－	－	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	0.15	－	－	0.16
サウジアラビア・リアル	株式	33銘柄	2.37	－	－	2.46
タイ・バーツ	株式	18銘柄	0.95	－	－	0.99
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.11	－	－	0.11
チリ・ペソ	株式	10銘柄	0.44	－	－	0.46
トルコ・リラ	株式	11銘柄	0.36	－	－	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	0.29	－	－	0.30
ブラジル・レアル	株式	38銘柄	3.20	－	－	3.47
	投資信託受益証券	3銘柄	－	0.15	－	
ポーランド・ズロチ	株式	16銘柄	1.01	－	－	1.05
マレーシア・リンギット	株式	21銘柄	0.90	－	－	0.93
メキシコ・ペソ	株式	16銘柄	1.18	－	－	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	0.51	－	－	0.53
韓国・ウォン	株式	77銘柄	20.84	－	－	21.63
香港・ドル	株式	159銘柄	15.28	－	－	15.85
台湾・ドル	株式	77銘柄	26.16	－	－	27.14
南アフリカ・ランド	株式	27銘柄	2.87	－	－	2.98

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	202,791,950,762円
Ⅱ　負債総額	1,834,556,363円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	200,957,394,399円
Ⅳ　発行済数量	192,242,261,680口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0453円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	450,682,917,420円
Ⅱ　負債総額	3,918,494,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	446,764,423,420円
Ⅳ　発行済数量	407,735,027,094口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0957円

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7月31日現在

Ⅰ　資産総額	946,734,210,616円
Ⅱ　負債総額	48,606,443,236円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	898,127,767,380円
Ⅳ　発行済数量	121,156,544,033口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	7.4130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7月31日現在

Ⅰ　資産総額	267,529,889,100円
Ⅱ　負債総額	1,644,895,768円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	265,884,993,332円
Ⅳ　発行済数量	234,173,002,824口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1354円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	337,271,566,449円
Ⅱ　負債総額	464,109,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	336,807,457,449円
Ⅳ　発行済数量	122,782,495,456口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7431円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	2,891,337,796,937円
Ⅱ　負債総額	243,465,471円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,891,094,331,466円
Ⅳ　発行済数量	210,853,777,946口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	13.7114円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	199,497,738,684円
Ⅱ　負債総額	2,152,028,800円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	197,345,709,884円
Ⅳ　発行済数量	72,695,107,810口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7147円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	141,293,350,845円
Ⅱ　負債総額	134,015,509円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	141,159,335,336円
Ⅳ　発行済数量	50,879,254,902口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7744円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	106,294,896,413円
Ⅱ　負債総額	605,113,357円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	105,689,783,056円
Ⅳ　発行済数量	37,328,132,913口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8314円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	202,567,051,326円
Ⅱ　負債総額	667,662,272円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	201,899,389,054円
Ⅳ　発行済数量	70,951,097,970口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8456円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【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7月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2026年7月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は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7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,654,243,671,169
追加型株式投資信託	758	22,175,593,776,683
単位型公社債投資信託	15	22,543,887,942
単位型株式投資信託	150	790,690,976,066
合計	949	24,643,072,311,860

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。

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 業務執行社員	公認会計士	森　重　　俊　寛
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	稲　葉　　宏　和

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の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。

（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
ソフトウエア		2,740		2,936
ソフトウエア仮勘定		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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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エアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価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権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）
ソフトウエア	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 A種種類株式	利益剰余金	11,440	286,000	2025年3月31日	2025年6月17日

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 A種種類株式	11,440	286,000	2025年3月31日	2025年6月17日

(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 A種種類株式	利益剰余金	22,000	550,000	2026年3月31日	2026年6月17日

（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			
その他有価証券	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				
その他有価証券(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				
その他有価証券(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				
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）

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第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	9,048	未払手数料	1,976
	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日付で清算結了しました。

(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。

約　　款

追加型証券投資信託
投資のソムリエ
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1.基本方針
この投資信託は、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.運用方法
(1)投資対象
「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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、「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、「外国債券パッシブ・ファンド・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、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・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」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産に投資する場合もあります。

(2)投資態度
①投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。
・国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。
・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
・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
・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
・Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
（それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）
・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ*を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。
＊一部の外貨建資産の通貨については、委託者がその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。
・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産へ投資する場合もあります。
②基準価額の変動リスク*を年率４％程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。
※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、上記数値は当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、当ファンドが年率４％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。
＊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基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（０％～１００％）を決定します。
・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。
・基本配分戦略は月次で行います。
④機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。
・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（０％～１００％）を変更します。
・機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

(3)投資制限
①各マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。
②株式への実質投資割合には制限を設けません。
③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。
④外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）について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、委託者は、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。

3.収益分配方針
毎決算時に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。
①分配対象額の範囲
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。）等の全額とします。
②分配対象額についての分配方針
委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。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留保益の運用方針
留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
投資のソムリエ
約款

＜信託の種類、委託者および受託者＞
第1条　この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。
②この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

＜信託事務の委託＞
第2条　受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。)を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

＜信託の目的および金額＞
第3条　委託者は、金5,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

＜信託金の限度額＞
第4条　委託者は、受託者と合意のうえ、金2兆円を限度として、信託金を追加することができます。
②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

＜信託期間＞
第5条　この信託の期間は、信託契約締結日から第46条第1項、第47条第1項、第48条第1項および第50条第2項の規定による信託終了の日までとします。

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

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

＜受益権の分割および再分割＞
第8条　委託者は、第3条の規定による受益権については5,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。
②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところにしたがい、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

＜追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法＞
第9条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。
②この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

③外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

④第27条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

＜信託日時の異なる受益権の内容＞

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

＜受益権の帰属と受益証券の不発行＞

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

②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第8条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

＜受益権の設定にかかる受託者の通知＞

第12条　受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

＜受益権の申込単位および取得価額等＞

第13条　委託者は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位とし、取得の申込みに応じることができます。

②販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口または1円を最低単位とし、販売会社が独自に定める単位をもって取得の申込みに応じることができます。また、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがった契約(以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

③前2項の規定にかかわらず、取得申込日がニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、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）といいます。）の場合には、受益権の取得申込みに応じません。

④第1項および第2項の場合の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に委託者または販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以

下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、信託契約締結日前の取得申込にかかる取得価額は、1口につき1円に委託者または販売会社がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

⑤前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥第1項および第2項の取得申込者は委託者または販売会社に、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この信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者（第43条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または販売会社は、当該取得申込みの代金（第4項の受益権の取得価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に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。

⑦前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。） 等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

＜受益権の譲渡にかかる記載または記録＞

第14条　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に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、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に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、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

＜受益権の譲渡の対抗要件＞

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

＜投資の対象とする資産の種類＞

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

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項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22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
   ハ. 金銭債権
   ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   イ. 為替手形

＜運用の指図範囲等＞

第17条　委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、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、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド（以下それぞれを「各マザーファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。）各受益証券のほか次の有価証券(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（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。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. 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、振替投資法人債を含みます。）
8. 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。）
9. 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。）
10. 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。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 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
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
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、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 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。）
17. 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。)
18. 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。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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。)
21. 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。)
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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第13号および第18号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第7号までの証券ならびに第13号および第18号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号の証券および第15号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

②委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用すること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前号の権利の性質を有するもの

③委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

④前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜利害関係人等との取引等＞

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第28条において同じ。)、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

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

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等および第21条から第25条、第27条、第31条から第33条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等および当該取引、当該行為を行うことができます。

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

＜運用の基本方針＞

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

＜投資する株式等の範囲＞

第20条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第20条の2　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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人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。

＜信用取引の指図範囲＞

第21条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

＜先物取引等の運用指図＞

第22条　委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の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委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および為替変動リスクを回避するため、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委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、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。

＜スワップ取引の運用指図＞

第23条　委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

④委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供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。

＜金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図＞

第24条　委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

④委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

＜デリバティブ取引等にかかる投資制限＞

第24条の2　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。

＜有価証券の貸付の指図および範囲＞

第25条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

＜特別な場合の外貨建有価証券への投資制限＞

第26条　外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

＜外国為替予約取引の指図＞

第27条　委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する

外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

＜信託業務の委託等＞

第28条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存にかかる業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

＜混蔵寄託＞

第29条　金融機関または第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

＜信託財産の登記等および記載等の留保等＞

第30条　信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、信託財産に属する旨の記載または記録に代えてその計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

＜一部解約の請求および有価証券の売却等の指図＞

第31条　委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

＜再投資の指図＞

第32条　委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

＜資金の借入れ＞

第33条　委託者は、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。

＜損益の帰属＞

第34条　委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

＜受託者による資金の立替え＞

第35条　信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

＜信託の計算期間＞

第36条　この信託の計算期間は、平成25年7月12日以降、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。ただし、第1計算期間は平成24年10月26日から平成25年1月11日まで、第2計算期間は平成25年1月12日から平成25年4月11日まで、第3計算期間は平成25年4月12日から平成25年7月11日までとします。

②前項にかかわらず､前項の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下｢該当日｣といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第5条に定める信託期間の終了日とします。

＜信託財産に関する報告等＞

第37条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

＜信託事務の諸費用および監査費用＞

第38条　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

＜信託報酬等の額および支弁の方法＞

第39条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、次の各号により計算された額の合計額とします。

1. 第36条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対して年10,000分の140の率を乗じて得た額
2. 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、マザーファンドの信託財産に属する品貸料（貸付有価証券の利子または配当金等相当額を含まないものとします。また、有価証券の貸付にあたって担保として金銭を受入れた場合には、当該品貸料に、当該金銭の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付の相手方に支払う当該金銭に対する利息額を控除して得た額（ただし、この額が負の場合は、零とします。）とすることができます。以下同じ。）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品貸料の割合を乗じて得た額とします。）に100分の50未満の率を乗じて得た額

②前項各号の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者の間の配分は別に定めます。

③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

＜収益の分配方式＞

第40条　信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、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、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、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、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②前項各号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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。

＜収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責＞

第41条　受託者は、収益分配金については第42条第1項に規定する支払開始日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第42条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第45条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第42条第5項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

＜収益分配金、償還金および一部解約金の支払い＞

第42条　収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に応じた受益者にかかる受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己に帰属する受益権の全部または一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みをしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が当該申し出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者ごとに当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じたものとします。当該受益権の取得申込に応じたことにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

④償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者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ます。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に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。

⑤一部解約金は、第45条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から受益者に支払います。

⑥前各項（第2項および第3項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとします。

⑦収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

＜委託者自らの募集にかかる受益権の口座管理機関＞

第43条　委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

＜収益分配金および償還金の時効＞

第44条　受益者が、収益分配金について第42条第1項に規定する支払い開始日から5年間その支払いを請求

しないとき、および信託終了による償還金については第42条第4項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

＜信託契約の一部解約＞

第45条　受益者（販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日が海外休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、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信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約に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。

③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

④一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者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。

⑤委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

⑥前項により一部解約の実行の請求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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。

＜信託契約の解約＞

第46条　委託者は、信託期間中において、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託者と合意のうえ、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、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、前項の事項について、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発します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。

④第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑤第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、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、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

＜信託契約に関する監督官庁の命令＞

第47条　委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、第51条の規定に従います。

＜委託者の登録取消等に伴う取扱い＞

第48条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第51条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者との間において存続します。

＜委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い＞

第49条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を承継させることがあります。

＜受託者の辞任および解任に伴う取扱い＞

第50条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第51条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜信託約款の変更等＞

第51条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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、この約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあっては、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、この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。

③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。

④第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この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。

⑦前各項の規定にかかわらず、この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も、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。

＜反対受益者の受益権買取請求の不適用＞

第52条　この信託は、受益者が第45条の規定による一部解約請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第46条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

＜他の受益者の氏名等の開示の請求の制限＞

第53条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1.他の受益者の氏名または名称および住所

2.他の受益者が有する受益権の内容

第54条　（削除）

＜公告＞

第55条　委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

https://www.am-one.co.jp/

②前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜運用状況にかかる情報の提供＞

第56条　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める事項にかかる情報を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行うものとします。

＜質権口記載または記録の受益権の取扱い＞

第57条　振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

＜約款に関する疑義の取扱い＞

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

（附則）

第1条　この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条　第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第3条　第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期

間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。) を取決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条　第42条第7項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

平成24年10月26日　　(信託契約締結日)

委託者　　ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社

受託者　　みずほ信託銀行株式会社

親投資信託
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針
この投資信託は、NOMURA－BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2.運用方法
（1）投資対象
わが国の公社債を主要投資対象とします。
（2）投資態度
1)主としてわが国の公社債に投資し､NOMURA－BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
2）公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3）公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
4）有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
5）信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
6）信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
（3）投資制限
1）株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
2）株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
3）同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4）同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
5）外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
6）有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
7）スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
8）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
9）外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行ないます。
10）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
11）外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

12）一般社団法人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、委託者は、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。

親投資信託
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

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

2.運用方法
（1）投資対象
わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
（2）投資態度
1）主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
2）最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
3）株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
4）株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
5）非株式割合は原則として信託財産総額の50％以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10％以下とします。
6）国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
7）信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
（3）投資制限
1）株式への投資割合には、制限を設けません。
2）有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
3）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
4）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
5）外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
6）一般社団法人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、委託者は、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。

親投資信託
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
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針
この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。

２．運用方法
（１）投資対象
海外の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度
①主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
②外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
③外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。
④有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
⑤信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
⑥信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
⑦ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

（３）投資制限
①株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
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有価証券先物取引等を行うことができます。
⑦スワップ取引を行うことができます。
⑧金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
⑨外国為替予約取引を行うことができます。
⑩デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を

実現する目的以外には利用しません。
⑪外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
⑫一般社団法人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、委託者は、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。

親投資信託
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第15条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針
この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2.運用方法
（1）投資対象
海外の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度
1）主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
2）外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3）外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
4）有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
5）信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
6）信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（3）投資制限
1）株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
2）同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
3）同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。
4）外貨建資産への投資には、制限を設けません。
5）有価証券先物取引等は約款第19条の範囲で行います。
6）スワップ取引は約款第20条の範囲で行います。
7）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

８）外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。
９）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
１０）外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
１１）一般社団法人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、委託者は、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。

親投資信託
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針
この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2.運用方法
（1）投資対象
海外の株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度
1）主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
2）株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3）組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
4）有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
5）信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
6）信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（3）投資制限
1）株式への投資割合には、制限を設けません。
2）新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。
3）同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4）外貨建資産への投資には、制限を設けません。
5）有価証券先物取引等は約款第20条の範囲で行います。
6）スワップ取引は約款第21条の範囲で行います。
7）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第22条の範囲で行います。
8）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為

替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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

１０）一般社団法人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、委託者は、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。

親投資信託
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1．基本方針
この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2.運用方法
（１）投資対象
東京証券取引所に上場し、東証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。

（２）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目指して運用を行ないます。
②不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することを目指します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
③但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証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。

（３）運用制限
①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30％を超えないものとします。ただし、東証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、委託者は、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。

親投資信託
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

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

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

（２）投資態度
①主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
②不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
③外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
④市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（３）運用制限
①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
③株式への直接投資は行いません。
④同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30％以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30％を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
⑦一般社団法人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、委託者は、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。

親投資信託
エマージング債券パッシブ・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針
この投資信託は、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目指して運用を行います。

２．運用方法
（１）投資対象
新興国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度
①主として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目指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ＢＢ－格もしくはＢａ３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。
⑤信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
⑥ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

（３）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有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。
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、委託者は、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。

親投資信託
エマージング株式パッシブ・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針
この投資信託は、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目指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及び証書等を含みます。

２．運用方法
（１）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。
（＊）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及び証書等を含みます。

（２）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目指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。
④信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
⑤ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

（３）投資制限
①株式への投資割合には、制限を設けません。
②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有価証券先物取引等、スワップ取引、外国為替予約取引、金利先渡取引および為替先渡取引は約款の範囲内で行うことができます。
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、委託者は、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。