

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2026年9月11日提出
【計算期間】	第19期（自 2025年12月12日 至 2026年6月11日）
【ファンド名】	ワールドアセットバランス（基本コース） ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 杉原 規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	積木 利浩
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
- ②各ファンドの信託金限度額は、各々2,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券に分散投資することにより、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。

●上記資産に関しては、主としてマザーファンド^(*)を通じて実質的に投資します。また、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等へ直接投資する場合もあります。

●DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

(*)外国株式パッシブ・ファンド・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、外国リート・パッシブ・ファンド・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、エマージング債券パッシブ・マザーファンド

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

2 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

●各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

※経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

●基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

●リスク抑制コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

(*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)

(**) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本投資比率をもとに運用を行います。

●各コース間でスイッチングが可能です。

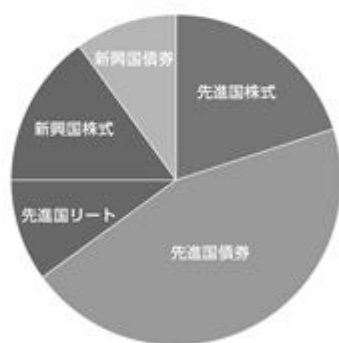
※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。

基本投資比率のイメージ

基本コース

リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。
 ※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



※この図においては、左記の5つの資産への投資比率の合計を「合計資産比率」として表示しています。以下同じ。
 ※合計資産比率には、ETFおよび有価証券指数等先物取引等を含みます。

リスク抑制コース

基本投資比率をもとに投資対象資産の合計資産比率を、現金等*を用いて機動的に変更し、基準価額の下落の抑制をめざします。



※合計資産比率は、10%～100%程度とします。それにあわせて現金等*の比率は変動します。

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少(現金等*比率を増加)させることで基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることをめざします。
 その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加(現金等*比率を減少)させます。
 ※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

※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をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

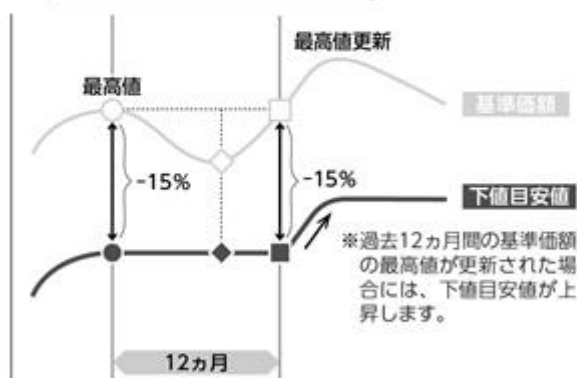
(リスク抑制コース)の下値目安値について

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。

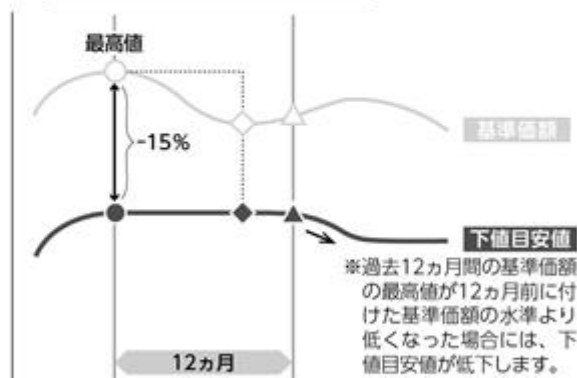
※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が更新された場合には、下値目安値が上昇します。

下値目安値が低下するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が12ヵ月前に付けた基準価額の水準より低くなった場合には、下値目安値が低下します。

※下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去12ヵ月間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去12ヵ月間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

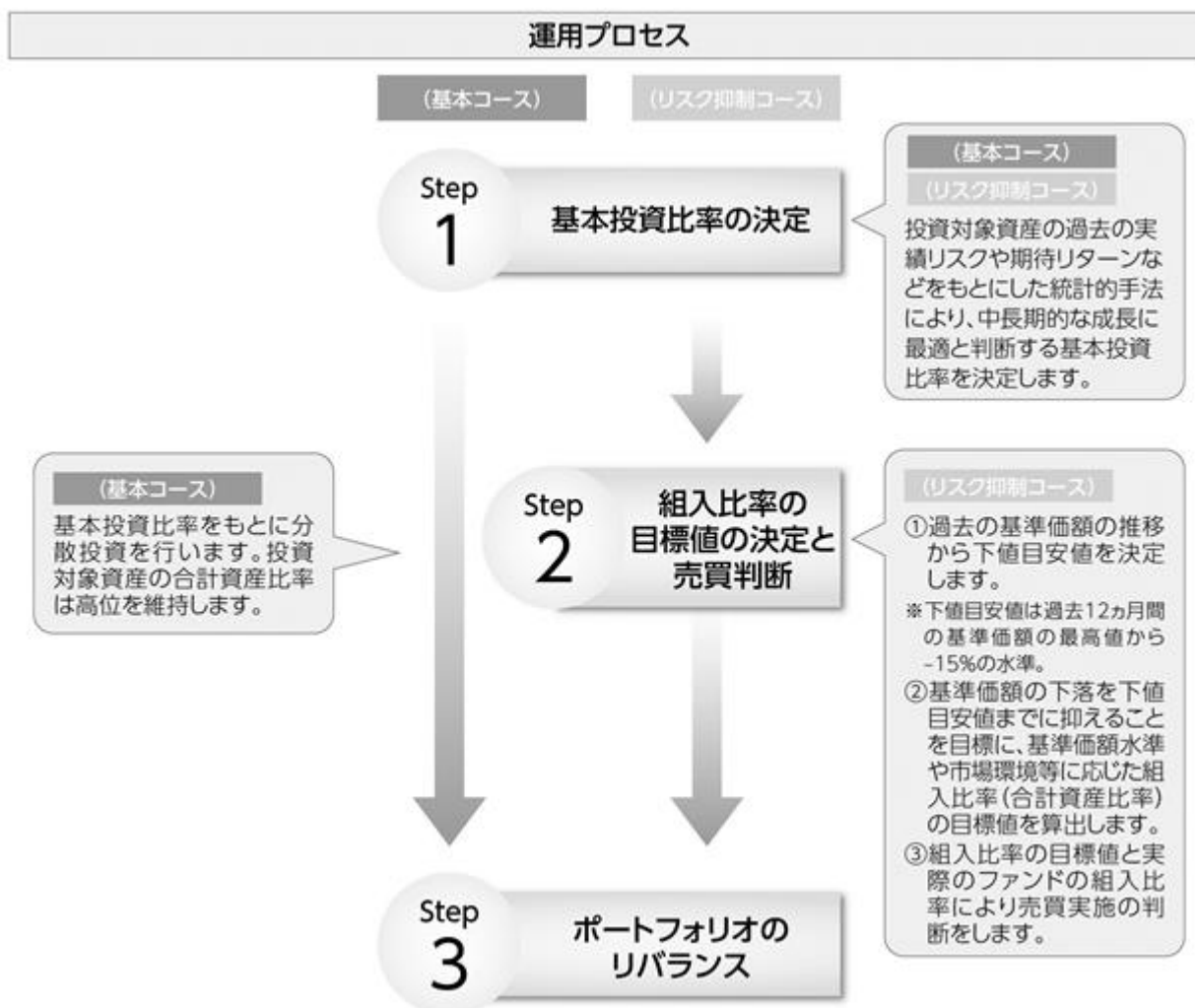
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

5 年2回決算を行います。

- 毎年6月、12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。



○商品分類表

各ファンド

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	国 内	株 式 債 券
追加型投信	海 外	不動産投信
	内 外	その他資産 ()
		資産複合

（注）各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

追加型投信	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。
海 外	目論見書または投資信託約款において、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

各ファンド

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

※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) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

資産複合（投資信託証券（債券、株式、不動産投信）、先物、E T F、短期金融資産） 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、E T F、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
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（日本除く）	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除く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（フルヘッジ）	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】

2017年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

```

graph TD
    MA[マザーファンド] --> F[ファンド]
    F --> WC[ワールドアセットバランス  
(基本コース) / (リスク抑制コース)]
    WC --> TC[委託会社]
    WC --> SC[受託会社]
    TC --> IAC[投資顧問会社]
    TC --> AMO[＜アセットマネジメントOne株式会社＞  
信託財産の運用指図等]
    SC --> AMO
    SC --> MCB[＜みずほ信託銀行株式会社＞  
信託財産の保管、管理等  
※信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。]
    AMO <--> |証券投資信託契約| MCB
    AMO <--> |募集・販売の  
取扱い等に関する契約| VC[販売会社]
    VC <--> |投資  
(受益者)| I[投資者  
(受益者)]
    
```

投資顧問会社

＜みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社＞
信託財産の運用助言等

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
エマージング債券パッシブ・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
エマージング株式パッシブ・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
DIAMマネーマザーファンド

ファンド

ワールドアセットバランス
(基本コース) / (リスク抑制コース)

委託会社

＜アセットマネジメントOne株式会社＞
信託財産の運用指図等

受託会社

＜みずほ信託銀行株式会社＞
信託財産の保管、管理等
※信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。

証券投資信託契約

募集・販売の
取扱い等に関する契約

販売会社

募集の取扱いおよび販売、投資信託説明書(目論見書)・運用報告書の交付、
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支払いの取扱い等

投資者
(受益者)

委託会社と受託会社との間においては、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

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。

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、各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。

8/278

●「ファミリーファンド方式」とは●

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2026年6月30日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「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6月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ^{※1}	70.0% ^{※2}
株式会社第一ライフグループ	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ^{※2}

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

※2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、株式会社第一ライフグループ49.0%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

●ワールドアセットバランス（基本コース）

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・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、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投資信託証券（ETF）を主要投資対象とします。なお、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

①以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・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
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

②実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

③各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

※経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

- ④「D I A Mマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとE T Fおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率は、原則として高位を保ちます。
- ⑤各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。
- ⑥資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

●ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・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、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投資信託証券（E T F）を主要投資対象とします。なお、「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

- ①以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（E T F）、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・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
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

- ②実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

- ③各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

※経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

- ④基準価額の下落を一定水準（下値目安値^(*)）までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去12ヵ月間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

(*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません（相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。）。

（**）合計資産比率とは、「D I A Mマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとE T Fおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。

⑤各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

⑥資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

a.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します。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b.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外国株式パッシブ・ファンド・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、外国リート・パッシブ・ファンド・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、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、D I A Mマネーマザーファンドの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。）、新株予約権証券および新投資口予約権証券
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。

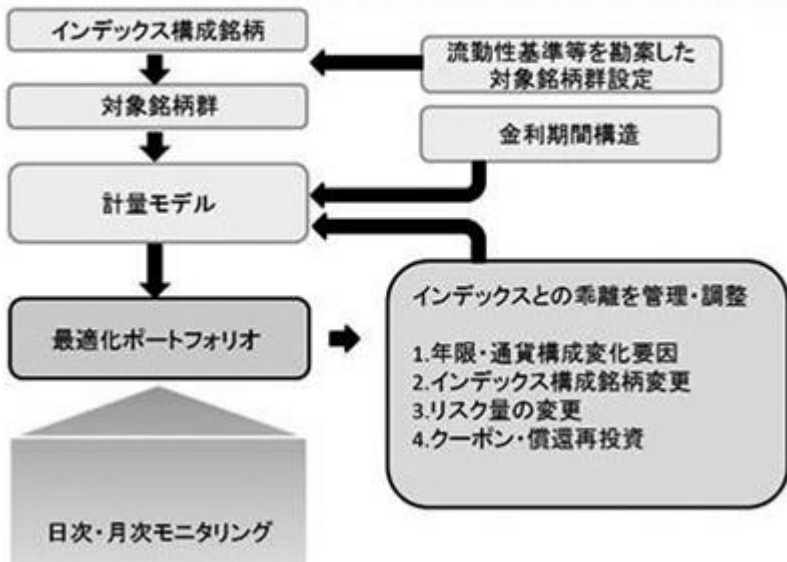
③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

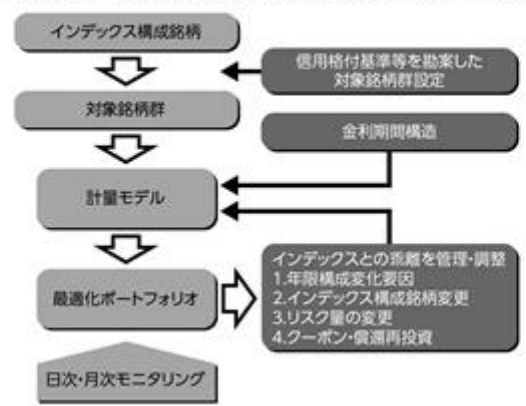
（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	------------------------------

基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。 ※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
運用プロセス	流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C C --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> I[1.年限・通貨構成変化要因 2.インデックス構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] I --> H </pre>

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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主として新興国の債券に投資し、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3.組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはM o o d y ' s の外貨建て長期格付がB B ー格もしくはB a 3 格以上を取得している債券とします。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ . P . モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

運用プロセス	信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[信用格付基準等を勘案した 対象銘柄群設定] --> A G[金利期間構造] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年配構成変化要因 2.インデックス構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] --> C I[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年配構成変化要因 2.インデックス構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] --> D </pre>
主な投資制限	1.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6.一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

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

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

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

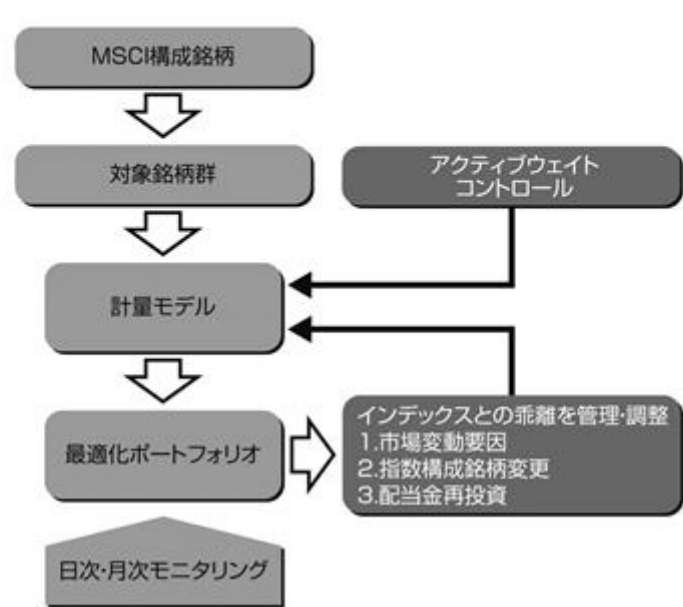
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、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

ファンド名	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

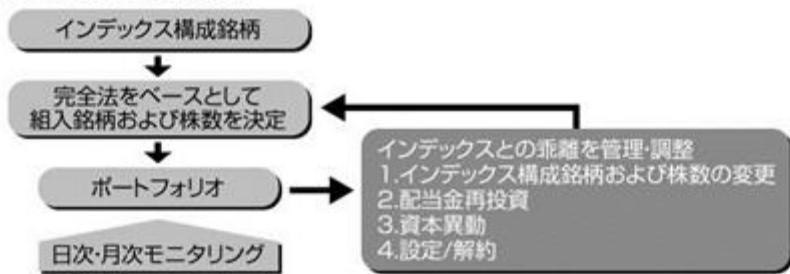
	認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデック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。  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[アクティブウェイトコントロール] --> C F --> D D --> G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] </pre>
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6.一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 ^(*) を主要投資対象とします。 （*）海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。

投資態度	1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
------	--

※ S & P 先進国 R E I T インデックスは S & P Dow Jones Indices LLC またはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスがアセットマネジメントOne株式会社（以下「アセットマネジメントOne」）に付与されています。S & P[®]、S & P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®] および CDX[®] は、S & P Global, Inc. またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®] は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスは SPDJI に付与されており、アセットマネジメントOneにより一定の目的でサブライセンスされています。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社（総称して「S & P Dow Jones Indices」）がスポンサーとなっておらず、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 R E I T インデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I T インデックスに関する、S & P Dow Jones Indices とアセットマネジメントOne との間における唯一の関係は、当インデックスと S & P Dow Jones Indices および／またはそのライセンサーの一定の商標、サービスマーク、および／または商号をライセンス供与していることです。S & P 先進国 R E I T インデックスは、アセットマネジメントOne または本商品を考慮することなく、S & P Dow Jones Indices によって決定、構成、計算されます。S & P Dow Jones Indices は、S & P 先進国 R E I T インデックスの決定、構成または計算に際して、アセットマネジメントOne または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S & P Dow Jones Indices は、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I T インデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資リターンを提供する保証はありません。S & P Dow Jones Indices は、（改正米国1940年投資会社法に定義する）投資顧問、商品取引顧問、コモディティ・プール・オペレーター、ブローカー・ディーラー、受託者、プロモーターでも、合衆国法典第15巻第77条k項(a)に列記する「専門家」でも、税務顧問でもありません。S & P Dow Jones Indices が、証券、商品、暗号通貨又はその他資産を指数に採用した場合にも、それは、S & P Dow Jones Indices がかかる証券、商品、暗号通貨またはその他の資産を購入、売却または保有するよう推奨したことにはならず、また投資助言もしくは商品取引の助言とはみなされません。S & P DOW JONES INDICES または第三者ライセンサーは、S & P 先進国 R E I T インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面

	の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS&P 先進国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運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日次・月次モニタリング] D --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本買動 4.設定/解約] E --> B </pre>

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

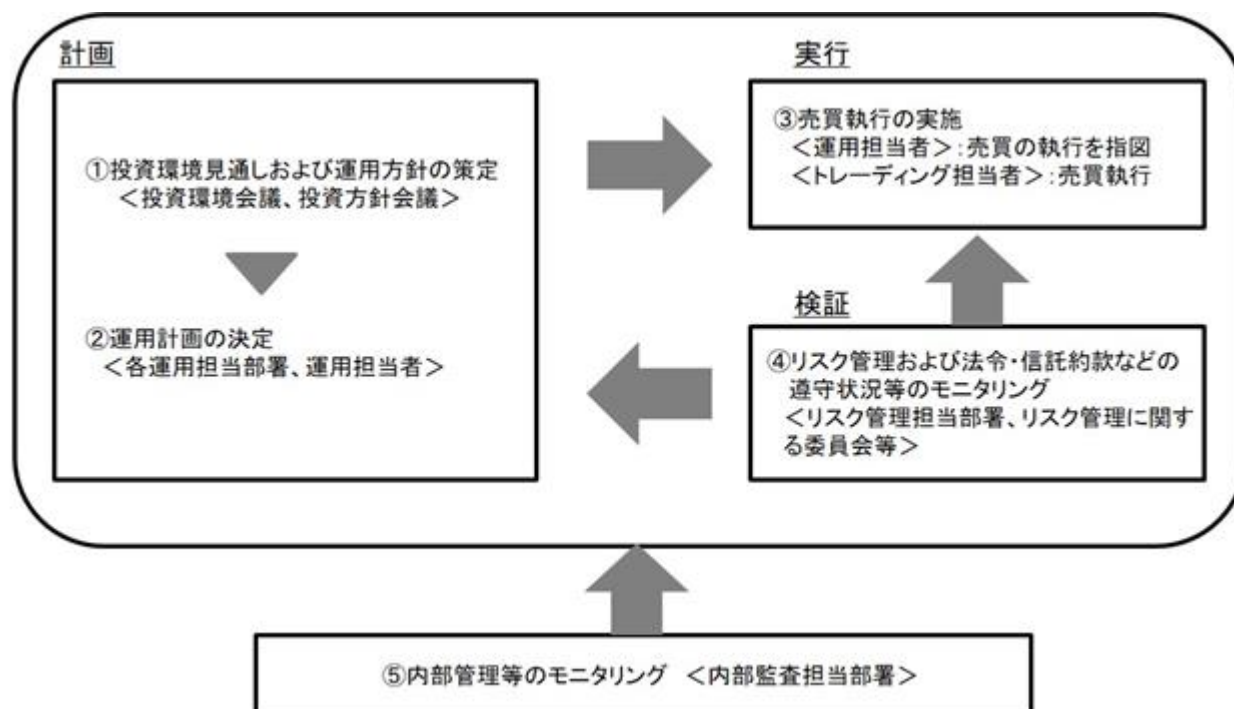
ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにC D、C P、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	1.国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がA A-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のC D、C Pを主要投資対象とします。 (*) 主要格付機関と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

主な投資制限	1. 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 2. 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 3. 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 5. 投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 6. 外貨建て資産への投資は行いません。 7. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（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。

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

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

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年6月、12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この信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

③ 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）

④ マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

⑤ 同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人資産運用業協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

⑥ スワップ取引、金利先渡し取引、為替先渡し取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

⑦ 一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で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、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）

⑧ 投資する株式等の範囲（約款第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。

⑨信用取引の指図範囲（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券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑩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。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（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ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券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組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払

金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金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組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。）を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等の1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額」といいます。）とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額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マザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑩で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額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ヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑩で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額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

るヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等の1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額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マザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を加えた額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑩で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑩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価格変動リスクや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) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑫金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや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)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品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（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品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。
- 5)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産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（「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 6)上記5)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受

益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、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。

7)金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、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。

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

⑬デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条）

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

⑭有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.～2.の範囲内で貸付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。

⑮特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第28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。

⑯外国為替予約取引の指図（約款第29条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、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とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額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(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)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)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファ

ンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

⑰資金の借入れ（約款第35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。

⑱同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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。

リスク抑制コースでは、現金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。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従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。

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。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。

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

為替ヘッジを行っても、為替相場の変動による基準価額への影響を完全には排除できません。

ファンドは、実質組入外貨建資産については原則として対円で為替ヘッジを行い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、実質組入資産の直接ヘッジのほか、一部の新興国通貨については代替通貨を用いた為替ヘッジを行う場合があります。代替通貨を用いた為替ヘッジの場合、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、代替通貨と一部の新興国通貨間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および代替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。

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、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。

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。

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>

- 各ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 各ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- 収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

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

○（基本コース）（リスク抑制コース）の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

○リスク抑制コースでは、過去12ヵ月間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整[※]します。そのため、基準価額は、長期的に15%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

※基準価額的水準が下値目安値に近づいた場合等では、下値目安値を意識した資産配分（組入比率）をめざすため、投資対象資産の合計資産比率の引上げについては機動的に行えない場合があります。

○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（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

○各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

○注意事項

イ、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）などの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。

ロ、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。

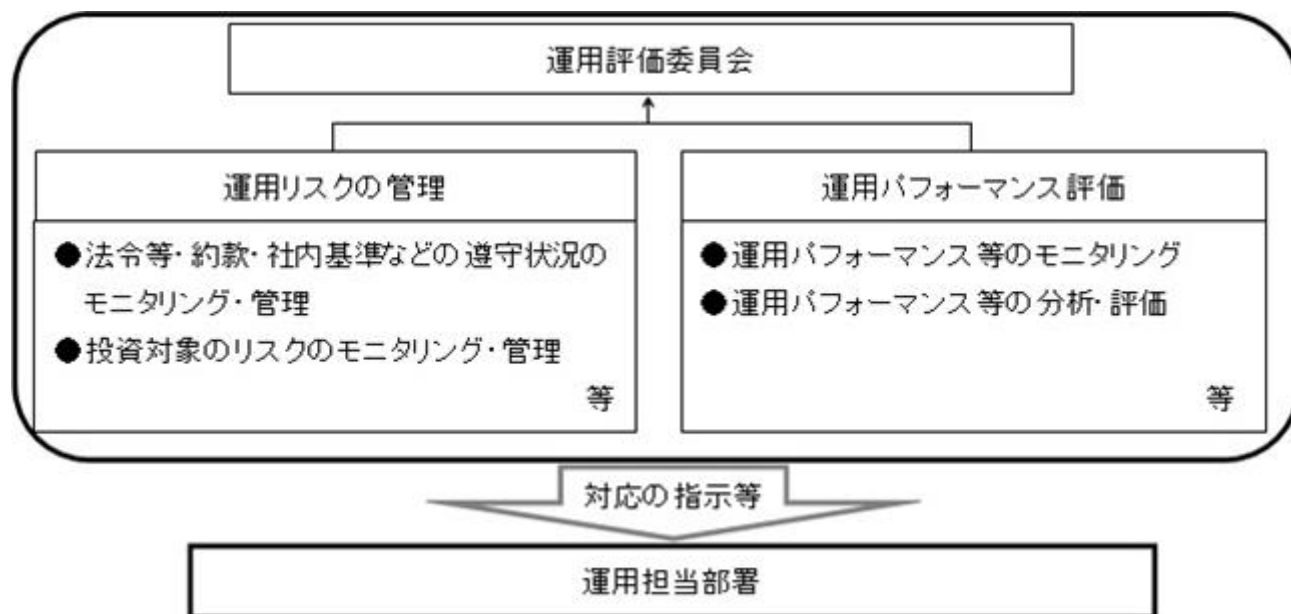
ハ、投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ、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。



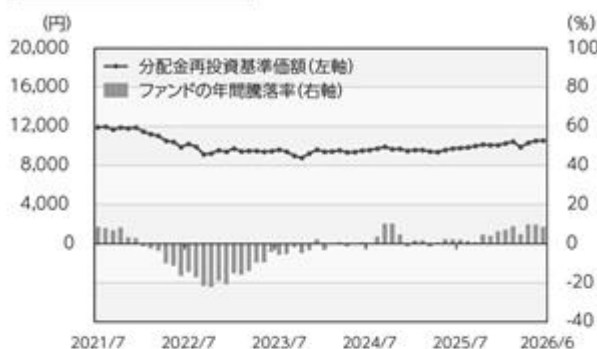
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

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

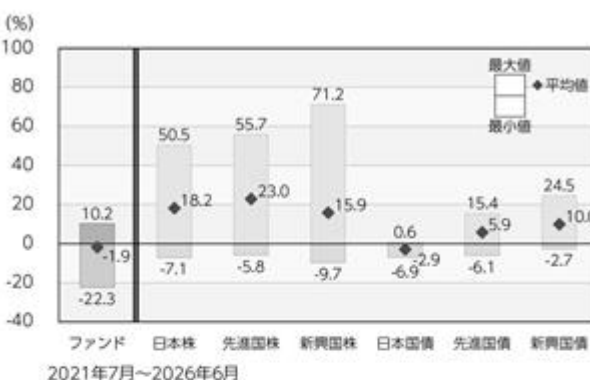
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

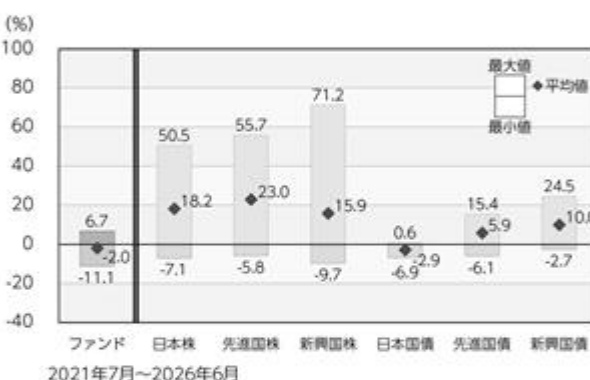
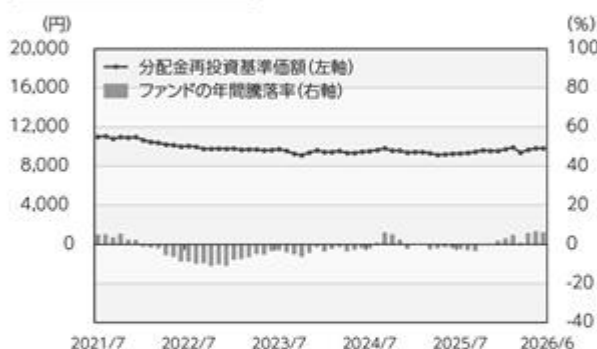
（基本コース）



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



（リスク抑制コース）



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

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

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）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】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.243%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	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0.55%	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0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

※委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

ありません。

2.その他の費用

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

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

- ②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。
- ③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に各ファンドで負担することになります。
- ※上記の「その他の費用」については、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。
- ※上場投資信託（ETFおよびリート）は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託（ETFおよびリート）の費用は表示しておりません。
- ※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※各ファンドは、少額投資非課税制度（N I S A）の対象ではありません。公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にN I S Aの適用対象となります。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2026年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

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

ファンド名	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
(基本コース)	1.35%	1.24%	0.11%
(リスク抑制コース)	1.31%	1.24%	0.07%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2025年12月12日～2026年6月11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、各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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	3,682,311,313	98.27
内 日本	3,682,311,313	98.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	64,749,058	1.73
純資産総額	3,747,060,371	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。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	8,043,179,159	81.25
内 日本	8,043,179,159	81.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,855,647,952	18.75
純資産総額	9,898,827,111	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）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	2,781,104,135,112	97.10
内 アメリカ	2,061,914,641,439	71.99
内 カナダ	101,843,570,049	3.56
内 イギリス	100,731,274,478	3.52
内 スイス	77,620,692,472	2.71
内 フランス	63,694,302,566	2.22
内 ドイツ	62,495,453,851	2.18
内 オランダ	57,872,489,647	2.02
内 アイルランド	46,615,121,378	1.63
内 オーストラリア	45,104,077,798	1.57
内 スペイン	27,968,493,125	0.98
内 スウェーデン	21,942,480,848	0.77
内 イタリア	21,597,957,059	0.75
内 デンマーク	12,310,759,429	0.43
内 シンガポール	12,116,235,240	0.42
内 香港	9,354,248,797	0.33
内 フィンランド	8,712,660,049	0.30
内 イスラエル	8,165,866,689	0.29
内 ケイマン諸島	7,060,464,728	0.25
内 ベルギー	6,448,951,950	0.23
内 ジャージー	4,587,378,055	0.16
内 ノルウェー	4,229,797,034	0.15
内 ルクセンブルグ	4,205,027,548	0.15
内 バミューダ	3,994,486,972	0.14

	内 リベリア	2,754,626,714	0.10
	内 オーストリア	2,594,126,514	0.09
	内 オランダ領キュラソー	2,337,273,790	0.08
	内 ニュージーランド	1,562,260,210	0.05
	内 ポルトガル	1,269,416,683	0.04
新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		3,079,943,810	0.11
	内 オーストラリア	2,438,818,008	0.09
	内 シンガポール	641,125,802	0.02
投資証券		40,292,350,866	1.41
	内 アメリカ	38,216,919,309	1.33
	内 フランス	975,462,461	0.03
	内 イギリス	719,655,030	0.03
	内 香港	380,314,066	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		39,782,586,254	1.39
純資産総額		2,864,259,016,042	100.00

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	264,331,589,329	99.65
内 アメリカ	118,907,690,294	44.83
内 中国	33,680,629,778	12.70
内 フランス	18,542,449,761	6.99
内 イタリア	17,209,714,839	6.49
内 イギリス	15,004,388,931	5.66
内 ドイツ	14,929,329,783	5.63
内 スペイン	11,001,631,950	4.15
内 カナダ	5,499,464,718	2.07
内 ベルギー	3,993,869,137	1.51
内 オーストラリア	3,411,684,377	1.29
内 オランダ	3,215,384,063	1.21
内 オーストリア	2,712,289,858	1.02
内 メキシコ	2,425,580,732	0.91
内 ポーランド	1,891,263,561	0.71

内 韓国	1,840,042,032	0.69
内 ポルトガル	1,463,958,288	0.55
内 フィンランド	1,388,543,455	0.52
内 マレーシア	1,333,694,887	0.50
内 イスラエル	1,166,831,657	0.44
内 アイルランド	1,086,633,770	0.41
内 シンガポール	977,770,320	0.37
内 ニュージーランド	737,293,037	0.28
内 デンマーク	529,158,629	0.20
内 スロバキア	509,174,637	0.19
内 スウェーデン	456,492,433	0.17
内 ノルウェー	416,624,402	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	938,890,416	0.35
純資産総額	265,270,479,745	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	内 オーストラリア	9,265,780,920	6.52
	内 シンガポール	4,321,763,049	3.04
	内 香港	62,394,880	0.04
		13,649,938,849	9.60
投資証券	内 アメリカ	112,269,874,684	78.98
	内 イギリス	5,462,339,984	3.84
	内 フランス	2,871,130,940	2.02
	内 カナダ	1,667,495,414	1.17
	内 ベルギー	1,411,761,754	0.99
	内 香港	1,091,772,444	0.77
	内 スペイン	798,224,311	0.56
	内 ガーンジー	310,793,737	0.22
	内 イスラエル	226,685,720	0.16
	内 韓国	214,731,521	0.15
	内 オランダ	207,283,114	0.15
	内 ニュージーランド	149,236,064	0.10
	内 アイルランド	57,816,992	0.04
	内 ドイツ	27,031,571	0.02
	内 イタリア	19,900,061	0.01
		126,786,078,311	89.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,712,716,477	1.20
純資産総額		142,148,733,637	100.00

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）		1,570,733,514	1.10
内 アメリカ		1,570,733,514	1.10

（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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

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

純資産総額	217,376,989,242	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

2026年6月30日現在

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	111,074,776,298	97.98
内 メキシコ	13,607,177,746	12.00
内 トルコ	12,773,219,224	11.27
内 サウジアラビア	11,566,465,192	10.20
内 ブラジル	10,058,063,101	8.87
内 ポーランド	9,743,670,116	8.59
内 南アフリカ	8,479,626,641	7.48
内 ハンガリー	8,091,771,221	7.14
内 ルーマニア	7,703,104,440	6.79
内 チリ	5,906,096,692	5.21
内 コロンビア	5,255,265,180	4.64
内 ドミニカ共和国	4,204,999,735	3.71
内 ペルー	2,680,579,849	2.36
内 ウルグアイ	2,397,850,740	2.12
内 パナマ	1,981,417,824	1.75
内 インドネシア	1,828,544,200	1.61
内 アラブ首長国連邦	1,758,588,756	1.55
内 フィリピン	1,355,383,890	1.20
内 中国	1,340,362,281	1.18
内 オマーン	342,589,470	0.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,293,503,964	2.02
純資産総額	113,368,280,262	100.00

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
----	-----------------	----	----	---------------------	---------------------	------------------	-----------------

1	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	1,581,987,196	1.1397 1,802,990,808	1.1513 1,821,341,858	— —	48.61
2	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	176,677,566	3.0118 532,117,494	3.1234 551,834,709	— —	14.73
3	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	40,060,586	13.2788 531,956,510	13.7372 550,320,281	— —	14.69
4	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	138,703,942	2.6616 369,174,427	2.7629 383,225,121	— —	10.23
5	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	129,152,830	2.8410 366,923,204	2.9081 375,589,344	— —	10.02

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.27
合計	98.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	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	3,455,671,751	1.1401 3,940,113,221	1.1513 3,978,514,886	— —	40.19
2	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	385,652,000	3.0223 1,165,558,688	3.1234 1,204,545,456	— —	12.17
3	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	87,500,380	13.2989 1,163,664,161	13.7372 1,202,010,220	— —	12.14
4	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	303,108,572	2.6641 807,526,373	2.7629 837,458,673	— —	8.46
5	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	282,194,534	2.8438 802,511,732	2.9081 820,649,924	— —	8.29

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	81.25
合計	81.25

（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

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

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

9	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	458,229	103,678.96 47,508,706,175	91,360.61 41,864,082,792	— —	1.46
10	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	587,196	67,679.96 39,741,405,114	66,878.69 39,270,903,715	— —	1.37
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	167,590	168,867.64 28,300,527,880	199,728.33 33,472,471,277	— —	1.17
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	559,467	49,180.80 27,515,038,266	53,489.64 29,925,689,596	— —	1.04
13	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	340,250	35,916.72 12,220,663,990	87,607.78 29,808,547,519	— —	1.04
14	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	81,060	222,902.39 18,068,468,268	298,784.20 24,219,447,252	— —	0.85
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	290,122	80,597.07 23,382,984,174	80,545.43 23,368,004,143	— —	0.82
16	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	502,577	39,396.30 19,799,674,784	41,979.43 21,097,900,464	— —	0.74
17	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	917,020	7,951.74 7,291,911,539	21,390.01 19,615,067,703	— —	0.68
18	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	350,509	51,062.40 17,897,830,915	55,480.54 19,446,429,821	— —	0.68
19	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	867,201	24,085.32 20,886,817,928	22,094.78 19,160,618,259	— —	0.67
20	APPLIED MATERIALS INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	165,868	58,723.66 9,740,377,100	112,802.58 18,710,339,931	— —	0.65
21	LAM RESEARCH CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	260,931	38,919.97 10,155,426,919	66,727.67 17,411,318,939	— —	0.61
22	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	914,544	21,626.25 19,778,165,732	18,609.89 17,019,566,898	— —	0.59

23	CATERPILLAR INC アメリカ	株式 機械	97,107	126,596.65 12,293,421,639	167,779.72 16,292,585,668	— —	0.57
24	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	824,874	12,756.99 10,522,913,268	19,113.30 15,766,066,698	— —	0.55
25	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	369,382	37,420.76 13,822,557,407	41,297.40 15,254,516,539	— —	0.53
26	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	92,596	165,045.50 15,282,553,823	153,731.36 14,234,909,492	— —	0.50
27	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サービス	170,622	84,056.95 14,341,965,971	82,760.43 14,120,751,725	— —	0.49
28	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,416,742	8,536.33 12,093,777,449	9,399.13 13,316,146,768	— —	0.46
29	GE AEROSPACE アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	218,268	51,266.10 11,189,750,904	60,686.76 13,245,979,237	— —	0.46
30	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	189,518	48,321.55 9,157,803,889	68,174.56 12,920,308,119	— —	0.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2026年6月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
半導体・半導体製造装置	外国	15.03
銀行		6.94
ソフトウェア		5.94
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.86
コンピュータ・周辺機器		5.77
医薬品		4.46
石油・ガス・消耗燃料		3.52
大規模小売り		3.16

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

3.06
2.69
2.66
2.54
1.97
1.72
1.71
1.66
1.64
1.58
1.57
1.48
1.30
1.28
1.28
1.17
1.13
1.01
1.00
0.99
0.96
0.96
0.86
0.77
0.73
0.68
0.67
0.66
0.61
0.54
0.52
0.52
0.48
0.44
0.42
0.41
0.36
0.36
0.29
0.22
0.19
0.18
0.17
0.16
0.14
0.13
0.11
0.09
0.08
0.07

水道	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
海上運輸	0.04
紙製品・林産品	0.03
販売	0.02
各種消費者サービス	0.01
合計	97.10

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

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

16	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 中国	国債証 券	1,001,628,600	100.45 1,006,217,861	100.46 1,006,295,287	1.46 2028/5/25	0.38
17	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証 券	990,579,000	100.89 999,420,688	101.48 1,005,282,906	4.5 2033/11/15	0.38
18	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 中国	国債証 券	930,083,700	104.88 975,542,377	104.94 976,114,751	2.68 2030/5/21	0.37
19	US T N/B 4.125 11/30/29 アメリカ	国債証 券	974,340,000	99.74 971,808,995	100.04 974,739,635	4.125 2029/11/30	0.37
20	CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31 中国	国債証 券	930,083,700	103.23 960,126,705	103.28 960,594,165	2.12 2031/6/25	0.36
21	US T N/B 3.5 01/31/28 アメリカ	国債証 券	958,101,000	98.94 947,958,599	99.05 949,081,378	3.5 2028/1/31	0.36
22	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32 中国	国債証 券	930,083,700	101.46 943,674,176	101.57 944,687,874	1.78 2032/9/15	0.36
23	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35 中国	国債証 券	906,235,400	99.41 900,927,162	99.55 902,217,750	1.61 2035/2/15	0.34
24	US T N/B 3.375 09/15/28 アメリカ	国債証 券	909,384,000	98.26 893,647,390	98.45 895,352,485	3.375 2028/9/15	0.34
25	US T N/B 3.75 06/30/27 アメリカ	国債証 券	893,145,000	99.63 889,925,158	99.68 890,356,637	3.75 2027/6/30	0.34
26	US T N/B 3.875 09/30/32 アメリカ	国債証 券	893,145,000	97.66 872,264,242	98.19 877,009,075	3.875 2032/9/30	0.33
27	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証 券	893,145,000	97.60 871,793,249	98.19 876,991,631	4 2034/2/15	0.33
28	CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27 中国	国債証 券	858,538,800	101.74 873,560,996	101.74 873,501,585	2.85 2027/6/4	0.33
29	US T N/B 4.625 11/15/45 アメリカ	国債証 券	893,145,000	96.37 860,768,493	97.06 866,908,865	4.625 2045/11/15	0.33
30	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30 中国	国債証 券	858,538,800	100.79 865,373,198	100.95 866,717,669	1.63 2030/10/25	0.33

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.65
合計	99.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	352,180	33,557.89 11,818,418,932	36,981.07 13,023,994,887	— —	9.16
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	465,126	22,822.29 10,615,240,737	22,554.34 10,490,613,249	— —	7.38
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	49,198	177,360.73 8,725,793,396	176,220.75 8,669,708,768	— —	6.10
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	161,721	34,317.87 5,549,921,661	36,953.46 5,976,151,863	— —	4.20
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	164,724	30,553.67 5,032,924,137	30,948.28 5,097,925,496	— —	3.59
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	464,962	9,782.37 4,548,431,993	10,237.06 4,759,846,495	— —	3.35
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	78,770	51,659.50 4,069,219,350	52,687.43 4,150,189,294	— —	2.92
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	1,019,349	3,514.13 3,582,135,094	3,581.07 3,650,366,239	— —	2.57
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	242,328	13,251.02 3,211,094,143	14,501.42 3,514,101,802	— —	2.47
10	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	148,294	20,758.31 3,078,333,371	21,105.82 3,129,867,701	— —	2.20
11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	105,261	23,600.13 2,484,174,199	24,075.94 2,534,257,667	— —	1.78
12	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	547,085	4,267.60 2,334,744,979	4,413.76 2,414,701,999	— —	1.70
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	69,663	28,794.99 2,005,945,722	31,282.80 2,179,254,365	— —	1.53
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	170,971	10,407.57 1,779,393,522	11,097.73 1,897,390,440	— —	1.33
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	31,980	44,447.76 1,421,439,585	48,056.07 1,536,833,204	— —	1.08
16	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	338,552	3,959.06 1,340,350,457	4,194.53 1,420,067,773	— —	1.00
17	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	274,054	4,613.49 1,264,348,101	4,967.51 1,361,366,012	— —	0.96
18	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	111,693	11,565.41 1,291,775,986	11,935.66 1,333,130,230	— —	0.94
19	MID AMERICA アメリカ	投資証券	57,893	21,516.67 1,245,664,865	22,840.15 1,322,285,006	— —	0.93
20	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	319,394	4,061.37 1,297,178,455	4,046.75 1,292,510,480	— —	0.91
21	SEGRO PLC イギリス	投資証券	673,058	1,590.93 1,070,794,828	1,888.56 1,271,116,540	— —	0.89
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	345,712	3,176.34 1,098,101,758	3,551.46 1,227,785,554	— —	0.86
23	OMEGA HEALTHCARE INVS INC アメリカ	投資証券	149,630	7,231.22 1,082,008,451	7,812.58 1,168,996,779	— —	0.82

24	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD フランス	投資証券	60,593	18,294.04 1,108,491,068	19,063.24 1,155,099,355	— —	0.81
25	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,621,265	425.04 1,114,151,912	437.31 1,146,319,027	— —	0.81
26	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	57,597	19,236.71 1,107,977,327	19,686.53 1,133,885,627	— —	0.80
27	LAMAR ADVERTISING CO アメリカ	投資証券	43,280	24,301.66 1,051,775,996	25,394.54 1,099,076,046	— —	0.77
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	81,914	12,484.54 1,022,658,871	13,202.30 1,081,453,775	— —	0.76
29	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	140,776	7,240.97 1,019,354,806	7,455.32 1,049,530,818	— —	0.74
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	96,381	10,099.03 973,355,005	10,505.00 1,012,483,282	— —	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6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	9.60
投資証券	89.19
合計	98.80

（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6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,619,396	10,424.51 27,305,945,092	12,064.72 31,602,284,547	— —	14.54
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	497,330	23,128.01 11,502,253,663	33,841.35 16,830,321,579	— —	7.74
3	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	58,729	126,350.60 7,420,444,892	275,340.81 16,170,490,782	— —	7.44

4	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	655,100	10,551.42 6,912,240,732	8,702.34 5,700,904,244	— —	2.62
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,781,168	2,810.68 5,006,301,583	1,926.02 3,430,583,003	— —	1.58
6	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	153,521	10,044.25 1,542,003,766	19,904.24 3,055,719,750	— —	1.41
7	DELTA ELECTRONICS INC 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	207,178	9,528.47 1,974,089,760	9,697.59 2,009,127,922	— —	0.92
8	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	85,260	15,611.03 1,330,996,944	22,054.50 1,880,367,181	— —	0.87
9	SK SQUARE CO LTD 韓国	株式 コングロ マリット	9,825	74,597.35 732,919,035	171,826.08 1,688,191,236	— —	0.78
10	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	1,208,896	1,380.65 1,669,070,039	1,382.09 1,670,811,534	— —	0.77
11	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,299,889	1,057.64 1,374,823,071	1,254.83 1,631,143,483	— —	0.75
12	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,943,530	179.84 1,608,459,362	170.65 1,526,216,971	— —	0.70
13	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	646,308	2,358.92 1,524,591,872	2,250.72 1,454,664,804	— —	0.67
14	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	563,486	2,325.76 1,310,533,565	2,400.54 1,352,675,190	— —	0.62
15	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD 韓国	株式 電子装 置・機 器・部品	5,961	78,331.93 466,936,657	213,525.33 1,272,824,527	— —	0.59
16	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	355,086	2,301.10 817,090,790	3,191.80 1,133,365,696	— —	0.52

17	UNITED MICROELECTRONICS CORP 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,206,610	387.34 467,368,520	834.85 1,007,348,494	— —	0.46
18	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,956,235	145.29 1,010,722,739	137.10 953,701,209	— —	0.44
19	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	379,089	2,803.73 1,062,863,259	2,448.74 928,291,401	— —	0.43
20	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 無線通信 サービス	291,286	3,192.83 930,027,071	3,185.10 927,775,912	— —	0.43
21	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	312,490	3,114.28 973,182,637	2,851.11 890,944,613	— —	0.41
22	YAGEO CORP 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	165,584	1,665.23 275,736,508	5,294.22 876,638,786	— —	0.40
23	ELITE MATERIAL CO LTD 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	30,511	19,448.80 593,402,435	27,743.76 846,490,166	— —	0.39
24	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,827,800	657.98 1,202,670,261	452.72 827,482,712	— —	0.38
25	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS ケイマン諸島	株式 銀行	388,046	2,444.91 948,739,643	2,132.18 827,384,191	— —	0.38
26	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	583,423	1,451.40 846,782,446	1,329.20 775,491,673	— —	0.36
27	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	187,000	3,792.03 709,109,795	4,129.57 772,230,338	— —	0.36
28	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,189,200	105.82 760,819,376	105.41 757,841,609	— —	0.35
29	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	538,110	1,775.72 955,533,966	1,401.03 753,909,060	— —	0.35
30	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	60,344	16,946.78 1,022,636,505	12,429.33 750,035,525	— —	0.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
----	---------

株式	96.70
投資信託受益証券	0.51
投資証券	0.07
合計	97.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2026年6月30日現在		
業種	国内／外国	投資比率（％）
半導体・半導体製造装置	外国	26.23
銀行		13.55
コンピュータ・周辺機器		10.37
電子装置・機器・部品		5.13
金属・鉱業		3.63
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.22
石油・ガス・消耗燃料		3.00
大規模小売り		2.65
保険		2.41
自動車		1.93
電気設備		1.68
コングロマリット		1.51
無線通信サービス		1.27
化学		1.14
ホテル・レストラン・レジャー		0.94
機械		0.87
不動産管理・開発		0.87
金融サービス		0.86
資本市場		0.83
電力		0.81
情報技術サービス		0.81
各種電気通信サービス		0.75
医薬品		0.74
バイオテクノロジー		0.73
食品		0.73
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.65
生活必需品流通・小売り		0.65
航空宇宙・防衛		0.65
通信機器		0.61
娯楽		0.58
飲料		0.55
運送インフラ		0.53
消費者金融		0.48
専門小売り		0.45
建設・土木		0.44
自動車用部品		0.44
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.42
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.41
繊維・アパレル・贅沢品		0.39
建設資材		0.35
旅客航空輸送		0.30

パーソナルケア用品	0.29
家庭用耐久財	0.26
海上運輸	0.19
航空貨物・物流サービス	0.17
タバコ	0.17
ガス	0.16
ソフトウェア	0.15
陸上運輸	0.14
水道	0.13
商社・流通業	0.08
総合公益事業	0.08
各種消費者サービス	0.07
エネルギー設備・サービス	0.07
ヘルスケア機器・用品	0.05
紙製品・林産品	0.04
専門サービス	0.04
建設関連製品	0.03
家庭用品	0.03
メディア	0.01
販売	0.00
商業サービス・用品	0.00
合計	96.70

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	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	3,004,215,000	107.18 3,220,002,959	107.72 3,236,345,735	7.1 2036/11/19	2.85
2	SOUTH AFRICA 6.125 12/11/37 南アフリカ	国債証 券	2,419,611,000	97.78 2,365,982,473	98.33 2,379,251,888	6.125 2037/12/11	2.10
3	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30 サウジアラビア	国債証 券	1,948,680,000	101.12 1,970,645,053	99.85 1,945,894,459	4.75 2030/1/16	1.72
4	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54 ポーランド	国債証 券	1,948,680,000	95.21 1,855,354,479	95.46 1,860,260,242	5.5 2054/3/18	1.64
5	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証 券	1,623,900,000	107.15 1,740,129,634	106.89 1,735,824,871	7.125 2033/1/17	1.53
6	REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29 ポーランド	国債証 券	1,721,334,000	101.42 1,745,810,879	100.72 1,733,817,526	4.625 2029/3/18	1.53
7	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53 サウジアラビア	国債証 券	1,948,680,000	87.74 1,709,786,257	86.43 1,684,349,761	5 2053/1/18	1.49
8	TURKEY 9.375 03/14/29 トルコ	国債証 券	1,542,705,000	110.34 1,702,367,747	108.81 1,678,665,519	9.375 2029/3/14	1.48

9	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33 メキシコ	国債証 券	1,737,573,000	96.54 1,677,626,731	95.14 1,653,300,709	4.875 2033/5/19	1.46
10	HUNGARY 6.75 09/23/55 ハンガリー	国債証 券	1,461,510,000	108.40 1,584,374,483	109.97 1,607,316,127	6.75 2055/9/23	1.42
11	UNITED MEXICAN STATES 6.875 05/13/37 メキシコ	国債証 券	1,461,510,000	106.70 1,559,431,170	105.25 1,538,239,275	6.875 2037/5/13	1.36
12	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証 券	1,461,510,000	104.74 1,530,810,521	103.00 1,505,428,828	5.5 2032/10/25	1.33
13	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.375 01/13/31 サウジアラビア	国債証 券	1,461,510,000	103.65 1,514,973,161	102.16 1,493,160,065	5.375 2031/1/13	1.32
14	ROMANIA 5.875 01/30/29 ルーマニア	国債証 券	1,461,510,000	102.41 1,496,824,787	101.29 1,480,394,083	5.875 2029/1/30	1.31
15	PANAMA 6.4 02/14/35 パナマ	国債証 券	1,396,554,000	106.91 1,493,061,097	106.00 1,480,347,240	6.4 2035/2/14	1.31
16	REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29 チリ	国債証 券	1,461,510,000	101.52 1,483,796,249	101.00 1,476,198,175	4.85 2029/1/22	1.30
17	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証 券	1,380,315,000	106.62 1,471,783,687	105.33 1,453,928,855	5.75 2032/11/16	1.28
18	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証 券	1,623,900,000	89.53 1,453,958,865	89.00 1,445,271,000	2.659 2031/5/24	1.27
19	REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53 ポーランド	国債証 券	1,461,510,000	95.27 1,392,457,715	95.66 1,398,210,715	5.5 2053/4/4	1.23
20	REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33 チリ	国債証 券	1,623,900,000	86.67 1,407,434,130	86.09 1,398,015,510	2.55 2033/7/27	1.23
21	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証 券	1,461,510,000	96.38 1,408,676,413	95.31 1,392,965,181	3.875 2030/6/12	1.23
22	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証 券	1,591,422,000	86.92 1,383,355,695	86.85 1,382,150,007	3 2034/1/15	1.22
23	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証 券	1,299,120,000	104.37 1,355,982,482	102.65 1,333,546,680	6.35 2035/2/9	1.18
24	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証 券	1,266,642,000	100.65 1,274,875,173	100.95 1,278,675,099	6 2033/2/22	1.13
25	UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/13/30 メキシコ	国債証 券	1,217,925,000	104.07 1,267,555,443	102.82 1,252,270,485	6 2030/5/13	1.10
26	COLOMBIA 8.0 04/20/33 コロンビア	国債証 券	1,136,730,000	110.05 1,250,971,365	110.00 1,250,403,000	8 2033/4/20	1.10
27	COLOMBIA 7.5 02/02/34 コロンビア	国債証 券	1,136,730,000	107.47 1,221,700,567	107.30 1,219,711,290	7.5 2034/2/2	1.08

28	REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34 チリ	国債証 券	1,331,598,000	92.02 1,225,403,059	91.11 1,213,285,517	3.5 2034/1/31	1.07
29	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.442 02/14/37 ウルグアイ	国債証 券	1,169,208,000	104.04 1,216,502,463	103.00 1,204,284,240	5.442 2037/2/14	1.06
30	HUNGARY 6.25 09/22/32 ハンガリー	国債証 券	1,136,730,000	105.99 1,204,820,127	105.58 1,200,159,534	6.25 2032/9/22	1.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.98
合計	97.98

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

ワールドアセットバランス（基本コース）

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

該当事項はありません。

（参考）

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。

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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Sep26	買建	527	32,066,124,559	32,093,393,494	1.12
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep26	買建	474	5,519,954,687	5,503,293,576	0.19
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep26	買建	43	2,019,585,177	2,016,096,753	0.07
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep26	買建	68	1,538,599,955	1,540,355,839	0.05
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Sep26	買建	26	643,807,182	639,718,508	0.02

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

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

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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	シカゴ商品 取引所	DJ US REAL ESTATE Sep26	買建	245	1,535,486,764	1,570,733,514	1.10

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

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

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

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

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。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

ワールドアセットバランス（基本コース）

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)

第1計算期間末 (2017年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (2017年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
第3計算期間末 (2018年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
第4計算期間末 (2018年12月11日)	14,083	14,083	1.0007	1.0007
第5計算期間末 (2019年6月11日)	12,878	12,878	1.0565	1.0565
第6計算期間末 (2019年12月11日)	12,003	12,003	1.0853	1.0853
第7計算期間末 (2020年6月11日)	11,343	11,343	1.0724	1.0724
第8計算期間末 (2020年12月11日)	10,467	10,467	1.1486	1.1486
第9計算期間末 (2021年6月11日)	9,706	9,706	1.1869	1.1869
第10計算期間末 (2021年12月13日)	8,589	8,589	1.1896	1.1896
第11計算期間末 (2022年6月13日)	6,748	6,748	1.0025	1.0025
第12計算期間末 (2022年12月12日)	6,104	6,104	0.9632	0.9632
第13計算期間末 (2023年6月12日)	5,766	5,766	0.9493	0.9493
第14計算期間末 (2023年12月11日)	5,315	5,315	0.9319	0.9319
第15計算期間末 (2024年6月11日)	5,018	5,018	0.9453	0.9453
第16計算期間末 (2024年12月11日)	4,774	4,774	0.9716	0.9716
第17計算期間末 (2025年6月11日)	4,407	4,407	0.9671	0.9671
第18計算期間末 (2025年12月11日)	4,159	4,159	1.0044	1.0044
第19計算期間末 (2026年6月11日)	3,804	3,804	1.0401	1.0401
2025年6月末日	4,427	—	0.9731	—
7月末日	4,388	—	0.9790	—
8月末日	4,366	—	0.9862	—
9月末日	4,350	—	0.9998	—
10月末日	4,305	—	1.0136	—
11月末日	4,238	—	1.0084	—
12月末日	4,131	—	1.0090	—
2026年1月末日	4,121	—	1.0257	—
2月末日	4,119	—	1.0444	—
3月末日	3,797	—	0.9881	—

4月末日	3,922	—	1.0320	—
5月末日	3,883	—	1.0529	—
6月末日	3,747	—	1.0560	—

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (2017年12月11日)	47,243	47,243	1.0544	1.0544
第3計算期間末 (2018年6月11日)	64,853	64,853	1.0356	1.0356
第4計算期間末 (2018年12月11日)	53,883	53,883	0.9975	0.9975
第5計算期間末 (2019年6月11日)	49,438	49,438	1.0392	1.0392
第6計算期間末 (2019年12月11日)	46,310	46,310	1.0681	1.0681
第7計算期間末 (2020年6月11日)	41,188	41,188	1.0437	1.0437
第8計算期間末 (2020年12月11日)	36,032	36,032	1.0685	1.0685
第9計算期間末 (2021年6月11日)	30,943	30,943	1.0971	1.0971
第10計算期間末 (2021年12月13日)	26,061	26,061	1.0983	1.0983
第11計算期間末 (2022年6月13日)	22,061	22,061	1.0041	1.0041
第12計算期間末 (2022年12月12日)	20,162	20,162	0.9801	0.9801
第13計算期間末 (2023年6月12日)	18,479	18,479	0.9676	0.9676
第14計算期間末 (2023年12月11日)	16,231	16,231	0.9411	0.9411
第15計算期間末 (2024年6月11日)	14,860	14,860	0.9393	0.9393
第16計算期間末 (2024年12月11日)	13,944	13,944	0.9612	0.9612
第17計算期間末 (2025年6月11日)	11,833	11,833	0.9236	0.9236
第18計算期間末 (2025年12月11日)	10,766	10,766	0.9519	0.9519
第19計算期間末 (2026年6月11日)	9,860	9,860	0.9714	0.9714
2025年6月末日	11,806	—	0.9262	—
7月末日	11,590	—	0.9290	—

8月末日	11,416	—	0.9339	—
9月末日	11,324	—	0.9473	—
10月末日	11,157	—	0.9603	—
11月末日	10,912	—	0.9554	—
12月末日	10,661	—	0.9563	—
2026年1月末日	10,506	—	0.9723	—
2月末日	10,498	—	0.9897	—
3月末日	9,801	—	0.9388	—
4月末日	9,964	—	0.9669	—
5月末日	10,017	—	0.9818	—
6月末日	9,898	—	0.9835	—

②【分配の推移】

ワールドアセットバランス（基本コース）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

ワールドアセットバランス（基本コース）

	収益率（％）
第1計算期間	3.4
第2計算期間	1.9
第3計算期間	△1.6
第4計算期間	△3.6
第5計算期間	5.6
第6計算期間	2.7
第7計算期間	△1.2
第8計算期間	7.1
第9計算期間	3.3
第10計算期間	0.2
第11計算期間	△15.7
第12計算期間	△3.9
第13計算期間	△1.4
第14計算期間	△1.8
第15計算期間	1.4
第16計算期間	2.8
第17計算期間	△0.5
第18計算期間	3.9
第19計算期間	3.6

（注）収益率は期間騰落率です。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

	収益率（％）
第1計算期間	3.4
第2計算期間	2.0
第3計算期間	△1.8
第4計算期間	△3.7
第5計算期間	4.2
第6計算期間	2.8
第7計算期間	△2.3
第8計算期間	2.4
第9計算期間	2.7
第10計算期間	0.1
第11計算期間	△8.6
第12計算期間	△2.4
第13計算期間	△1.3
第14計算期間	△2.7
第15計算期間	△0.2
第16計算期間	2.3
第17計算期間	△3.9

第18計算期間	3.1
第19計算期間	2.0

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

ワールドアセットバランス（基本コース）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876
第2計算期間	7,912,713,431	738,193,959
第3計算期間	4,414,882,467	1,581,611,324
第4計算期間	527,482,147	2,267,181,143
第5計算期間	180,523,898	2,065,395,074
第6計算期間	287,056,004	1,416,879,908
第7計算期間	213,369,846	696,011,702
第8計算期間	122,826,944	1,586,765,325
第9計算期間	227,608,795	1,163,074,115
第10計算期間	159,562,024	1,117,350,709
第11計算期間	48,454,636	537,462,741
第12計算期間	34,334,302	427,232,156
第13計算期間	46,465,749	310,561,024
第14計算期間	20,220,258	389,917,952
第15計算期間	12,709,017	408,309,790
第16計算期間	12,621,574	407,427,943
第17計算期間	8,788,572	365,109,667
第18計算期間	18,292,380	434,594,932
第19計算期間	7,448,631	490,630,955

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324
第4計算期間	2,278,919,156	10,886,978,597
第5計算期間	226,859,362	6,670,815,337
第6計算期間	398,143,626	4,613,079,433
第7計算期間	284,570,545	4,182,089,512
第8計算期間	108,436,378	5,849,150,571
第9計算期間	107,132,818	5,624,497,695
第10計算期間	92,831,691	4,569,076,002
第11計算期間	36,964,114	1,793,363,306
第12計算期間	25,965,966	1,426,678,849
第13計算期間	23,048,616	1,495,063,349
第14計算期間	36,750,716	1,888,596,359
第15計算期間	15,987,652	1,442,608,414
第16計算期間	14,802,081	1,327,932,445
第17計算期間	10,255,852	1,705,004,398
第18計算期間	7,393,403	1,509,326,322
第19計算期間	6,683,284	1,166,132,962

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

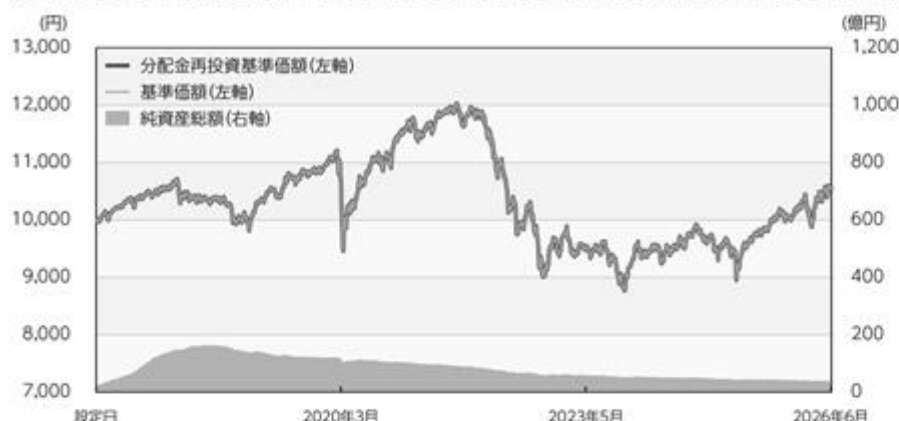
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<<参考情報>>

データの基準日:2026年6月30日

(基本コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2026年6月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2024年 6月	0円
2024年12月	0円
2025年 6月	0円
2025年12月	0円
2026年 6月	0円
設定来累計	0円

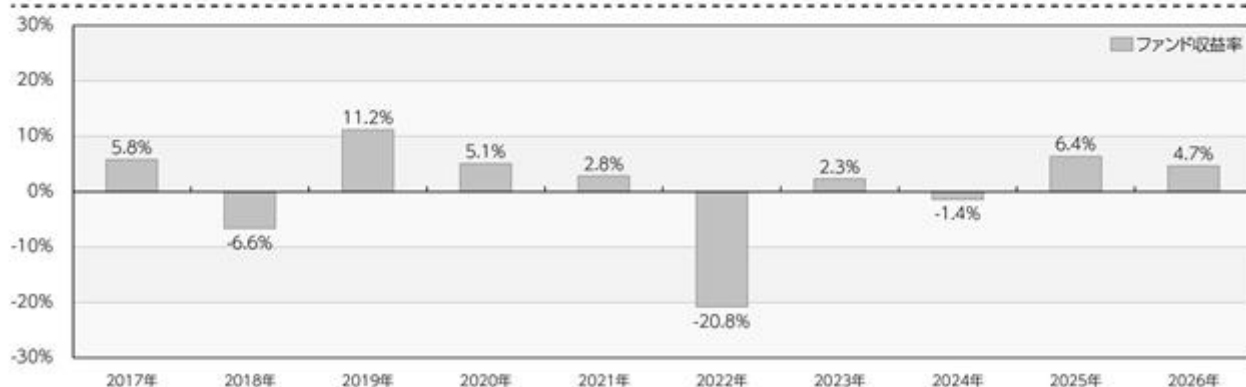
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※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	種類	国/地域	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	親投資信託受益証券	日本	48.61
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.73
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.69
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.23
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.02

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。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2026年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2026年6月30日

(リスク抑制コース)

基準価額・純資産の推移〈2017年1月18日～2026年6月30日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2024年 6月	0円
2024年12月	0円
2025年 6月	0円
2025年12月	0円
2026年 6月	0円
設定来累計	0円

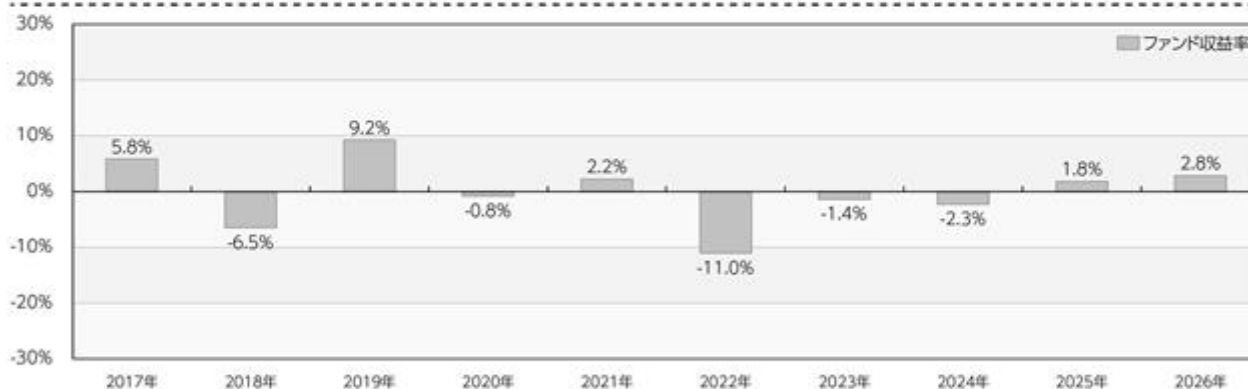
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※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	種類	国/地域	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	親投資信託受益証券	日本	40.19
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	12.17
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	12.14
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	8.46
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	8.29

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。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2026年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2026年6月30日

主要な資産の状況

■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	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	5.32
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.89
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.08
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.75
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	2.44

■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	US T N/B 4.875 10/31/28	国債証券	アメリカ	4.875	2028/10/31	0.58
2	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	国債証券	中国	1.62	2027/8/15	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	0.53
4	US T N/B 4.25 11/15/34	国債証券	アメリカ	4.25	2034/11/15	0.51
5	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30	国債証券	中国	1.43	2030/1/25	0.49

■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	9.16
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	7.38
3	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	6.10
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	3.59

■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	14.54
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	7.74
3	SK HYNIX INC	株式	韓国	半導体・半導体製造装置	7.44
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	2.62
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	1.58

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2026年6月30日

■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	2.85
2	SOUTH AFRICA 6.125 12/11/37	国債証券	南アフリカ	6.125	2037/12/11	2.10
3	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30	国債証券	サウジアラビア	4.75	2030/1/16	1.72
4	REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	国債証券	ポーランド	5.5	2054/3/18	1.64
5	ROMANIA 7.125 01/17/33	国債証券	ルーマニア	7.125	2033/1/17	1.53

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時30分までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

ただし、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。）には取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

「分配金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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞

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

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）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は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時30分までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口

数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して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
株式	計算日 [※] における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日 [※] における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
不動産投資信託証券	計算日 [※] における金融商品取引所等の最終相場
上場先物取引等	計算日 [※] における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	計算日 [※] における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2017年1月18日（設定日）から原則として2027年6月11日までです。

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

（４）【計算期間】

- 計算期間は、原則として毎年6月12日から12月11日まで、および12月12日から翌年6月11日までとします。
- 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

り次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- 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。イ.償還規定c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引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。受託会社と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は、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて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。

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半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。

二. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年6月11日、12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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金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、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として償還日（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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

- （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19期計算期間（2025年12月12日から2026年6月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ワールドアセットバランス（基本コース）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	237,343	248,153
コール・ローン	59,356,301	90,421,861
親投資信託受益証券	4,050,051,792	3,709,290,944
派生商品評価勘定	—	1,424,650
未収入金	90,000,000	45,004,856
流動資産合計	4,199,645,436	3,846,390,464
資産合計	4,199,645,436	3,846,390,464
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,765,657	13,309,471
未払金	149,926	188,530
未払解約金	7,045,431	3,280,829
未払受託者報酬	718,518	658,162
未払委託者報酬	26,347,288	24,134,454
その他未払費用	85,166	78,020
流動負債合計	40,111,986	41,649,466
負債合計	40,111,986	41,649,466
純資産の部		
元本等		
元本	4,141,241,166	3,658,058,842
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,292,284	146,682,156
（分配準備積立金）	872,697,874	814,537,756
元本等合計	4,159,533,450	3,804,740,998
純資産合計	4,159,533,450	3,804,740,998
負債純資産合計	4,199,645,436	3,846,390,464

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自 2025年6月12日 至 2025年12月11日	第19期 自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
営業収益		
受取利息	287,756	403,287
有価証券売買等損益	416,006,211	260,139,152
為替差損益	△221,580,881	△92,895,191
営業収益合計	194,713,086	167,647,248
営業費用		
受託者報酬	718,518	658,162
委託者報酬	26,347,288	24,134,454
その他費用	1,347,632	1,442,676
営業費用合計	28,413,438	26,235,292
営業利益又は営業損失（△）	166,299,648	141,411,956
経常利益又は経常損失（△）	166,299,648	141,411,956
当期純利益又は当期純損失（△）	166,299,648	141,411,956
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（△）	11,881,452	11,049,611
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△150,055,743	18,292,284
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,296,353	204,180
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,296,353	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	204,180
剰余金減少額又は欠損金増加額	366,522	2,176,653
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	2,176,653
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	366,522	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,292,284	146,682,156

（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19期	
	自 2025年12月12日	至 2026年6月11日
１． 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
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	第18期	第19期
	2025年12月11日現在	2026年6月11日現在
１． 期首元本額	4,557,543,718円	4,141,241,166円
期中追加設定元本額	18,292,380円	7,448,631円
期中一部解約元本額	434,594,932円	490,630,955円
２． 受益権の総数	4,141,241,166口	3,658,058,842口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第18期	第19期
	自 2025年6月12日 至 2025年12月11日	自 2025年12月12日 至 2026年6月11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（48,762,334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（163,327,353円）及び分配準備積立金（823,935,540円）より分配対象収益は1,036,025,227円（1万口当たり2,501.72円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（45,128,388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（145,746,729円）及び分配準備積立金（769,409,368円）より分配対象収益は960,284,485円（1万口当たり2,625.12円）ですが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第18期	第19期
	自 2025年6月12日 至 2025年12月11日	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11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	357,258,516	206,700,861
合計	357,258,516	206,700,861

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第18期 2025年12月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	2,221,364,694	—	2,227,130,351	△5,765,657
アメリカ・ドル	1,769,754,240	—	1,771,808,520	△2,054,280
イギリス・ポンド	49,336,800	—	49,916,352	△579,552
イスラエル・シェケル	2,389,300	—	2,414,070	△24,770
オーストラリア・ドル	43,682,195	—	44,548,000	△865,805
カナダ・ドル	34,505,263	—	34,972,030	△466,767
シンガポール・ドル	16,817,500	—	16,866,430	△48,930
スイス・フラン	19,413,120	—	19,499,790	△86,670

スウェーデン・クローナ	6,748,395	—	6,884,884	△136,489
デンマーク・クローネ	3,868,800	—	3,902,976	△34,176
ニュージーランド・ドル	890,900	—	904,830	△13,930
ノルウェー・クローネ	1,227,056	—	1,232,584	△5,528
メキシコ・ペソ	11,492,408	—	11,603,792	△111,384
ユーロ	93,878,252	—	94,704,428	△826,176
香港・ドル	146,495,390	—	146,697,974	△202,584
南アフリカ・ランド	20,865,075	—	21,173,691	△308,616
合計	2,221,364,694	—	2,227,130,351	△5,765,657

種類	第19期 2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	1,879,161,978	—	1,891,046,799	△11,884,821
アメリカ・ドル	1,553,365,518	—	1,565,826,176	△12,460,658
イギリス・ポンド	36,337,976	—	36,424,302	△86,326
イスラエル・シェケル	2,270,840	—	2,157,644	113,196
オーストラリア・ドル	35,384,330	—	34,744,614	639,716
カナダ・ドル	25,369,410	—	25,314,982	54,428
シンガポール・ドル	13,719,717	—	13,712,941	6,776
スイス・フラン	14,271,166	—	14,069,300	201,866
スウェーデン・クローナ	4,639,572	—	4,558,626	80,946
デンマーク・クローネ	2,481,280	—	2,477,560	3,720
ニュージーランド・ドル	951,239	—	929,981	21,258
ノルウェー・クローネ	1,030,218	—	1,015,764	14,454
メキシコ・ペソ	9,769,849	—	9,830,304	△60,455
ユーロ	68,598,629	—	68,506,647	91,982
香港・ドル	94,258,352	—	94,960,384	△702,032
南アフリカ・ランド	16,713,882	—	16,517,574	196,308
合計	1,879,161,978	—	1,891,046,799	△11,884,821

（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18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0044円 （10,044円）	1.0401円 （10,401円）

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2026年6月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	41,208,645	547,201,355	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	142,909,832	380,368,808	
	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	1,627,790,613	1,855,192,961	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	182,156,403	548,618,654	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	133,019,770	377,909,166	
親投資信託受益証券 合計		2,127,085,263	3,709,290,944	
合計			3,709,290,944	

（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。

【ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	271,944	284,355
コール・ローン	97,549,107	1,139,950,112
親投資信託受益証券	10,570,923,231	7,871,357,605
派生商品評価勘定	—	3,093,225
未収入金	226,000,000	969,114,394
流動資産合計	10,894,744,282	9,983,799,691
資産合計	10,894,744,282	9,983,799,691
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,377,486	28,212,495
未払金	401,067	3,102,804
未払解約金	41,543,705	28,026,973
未払受託者報酬	1,883,754	1,687,834
未払委託者報酬	69,072,291	61,888,778
その他未払費用	223,442	200,200
流動負債合計	128,501,745	123,119,084
負債合計	128,501,745	123,119,084
純資産の部		
元本等		
元本	11,310,650,261	10,151,200,583
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△544,407,724	△290,519,976
（分配準備積立金）	1,085,459,346	1,071,289,935
元本等合計	10,766,242,537	9,860,680,607
純資産合計	10,766,242,537	9,860,680,607
負債純資産合計	10,894,744,282	9,983,799,691

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自 2025年6月12日 至 2025年12月11日	第19期 自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
営業収益		
受取利息	6,253,869	3,946,517
有価証券売買等損益	919,829,758	508,634,374
為替差損益	△505,189,789	△234,972,237
営業収益合計	420,893,838	277,608,654
営業費用		
受託者報酬	1,883,754	1,687,834
委託者報酬	69,072,291	61,888,778
その他費用	2,014,771	1,763,638
営業費用合計	72,970,816	65,340,250
営業利益又は営業損失（△）	347,923,022	212,268,404
経常利益又は経常損失（△）	347,923,022	212,268,404
当期純利益又は当期純損失（△）	347,923,022	212,268,404
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（△）	27,813,227	14,295,179
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△979,446,189	△544,407,724
剰余金増加額又は欠損金減少額	115,374,527	56,124,876
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	115,374,527	56,124,876
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	445,857	210,353
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	445,857	210,353
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△544,407,724	△290,519,976

(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19期	
	自 2025年12月12日	至 2026年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
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	第18期	第19期
	2025年12月11日現在	2026年6月11日現在
1. 期首元本額	12,812,583,180円	11,310,650,261円
期中追加設定元本額	7,393,403円	6,683,284円
期中一部解約元本額	1,509,326,322円	1,166,132,962円
2. 受益権の総数	11,310,650,261口	10,151,200,583口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は544,407,724円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は290,519,976円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期	第19期
	自 2025年6月12日 至 2025年12月11日	自 2025年12月12日 至 2026年6月11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（106,238,671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（329,651,966円）及び分配準備積立金（979,220,675円）より分配対象収益は1,415,111,312円（1万口当たり1,251.13円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（97,714,926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（296,480,176円）及び分配準備積立金（973,575,009円）より分配対象収益は1,367,770,111円（1万口当たり1,347.39円）であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第18期	第19期
	自 2025年6月12日 至 2025年12月11日	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11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	799,368,904	334,507,920
合計	799,368,904	334,507,920

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第18期 2025年12月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	5,895,233,219	—	5,910,610,705	△15,377,486
アメリカ・ドル	4,694,505,984	—	4,699,955,232	△5,449,248
イギリス・ポンド	129,509,100	—	131,030,424	△1,521,324
イスラエル・シェケル	5,734,320	—	5,793,768	△59,448
オーストラリア・ドル	117,840,340	—	120,176,000	△2,335,660
カナダ・ドル	92,385,059	—	93,634,790	△1,249,731
シンガポール・ドル	43,245,000	—	43,370,820	△125,820
スイス・フラン	54,356,736	—	54,599,412	△242,676

スウェーデン・クローナ	17,940,855	—	18,303,716	△362,861
デンマーク・クローネ	10,639,200	—	10,733,184	△93,984
ニュージーランド・ドル	2,672,700	—	2,714,490	△41,790
ノルウェー・クローネ	3,221,022	—	3,235,533	△14,511
メキシコ・ペソ	31,688,625	—	31,995,750	△307,125
ユーロ	249,138,438	—	251,330,982	△2,192,544
香港・ドル	384,999,465	—	385,531,869	△532,404
南アフリカ・ランド	57,356,375	—	58,204,735	△848,360
合計	5,895,233,219	—	5,910,610,705	△15,377,486

種類	第19期 2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	3,988,857,316	—	4,013,976,586	△25,119,270
アメリカ・ドル	3,294,343,248	—	3,320,769,536	△26,426,288
イギリス・ポンド	74,813,480	—	74,991,210	△177,730
イスラエル・シェケル	5,109,390	—	4,854,699	254,691
オーストラリア・ドル	73,051,520	—	71,730,816	1,320,704
カナダ・ドル	51,891,975	—	51,780,645	111,330
シンガポール・ドル	32,428,422	—	32,412,406	16,016
スイス・フラン	32,619,808	—	32,158,400	461,408
スウェーデン・クローナ	10,825,668	—	10,636,794	188,874
デンマーク・クローネ	5,706,944	—	5,698,388	8,556
ニュージーランド・ドル	1,902,478	—	1,859,962	42,516
ノルウェー・クローネ	2,403,842	—	2,370,116	33,726
メキシコ・ペソ	23,009,364	—	23,151,744	△142,380
ユーロ	144,613,326	—	144,419,418	193,908
香港・ドル	196,845,567	—	198,311,664	△1,466,097
南アフリカ・ランド	39,292,284	—	38,830,788	461,496
合計	3,988,857,316	—	4,013,976,586	△25,119,270

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第18期 2025年12月11日現在	第19期 2026年6月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9519円 (9,519円)	0.9714円 (9,714円)

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2026年6月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	87,375,747	1,160,245,069	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	303,469,294	807,713,872	
	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	3,454,357,113	3,936,930,801	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	387,046,240	1,165,705,865	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	281,859,204	800,761,998	
親投資信託受益証券 合計		4,514,107,598	7,871,357,605	
合計			7,871,357,605	

（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）

「ワールドアセットバランス（基本コース）」、「ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）」は、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2026年6月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	31,986,605,276
コール・ローン	512,640,116
株式	2,658,440,434,754
投資信託受益証券	3,026,688,193
投資証券	39,250,529,161
派生商品評価勘定	123,592,026
未収入金	90,944,762
未収配当金	3,082,830,820
差入委託証拠金	10,052,726,679
流動資産合計	2,746,566,991,787
資産合計	2,746,566,991,787
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	933,281,004
未払解約金	302,833,900
流動負債合計	1,236,114,904
負債合計	1,236,114,904
純資産の部	
元本等	
元本	206,745,417,387
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,538,585,459,496
元本等合計	2,745,330,876,883
純資産合計	2,745,330,876,883
負債純資産合計	2,746,566,991,787

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	193,945,842,846円
同期中追加設定元本額	19,811,610,668円
同期中一部解約元本額	7,012,036,127円

元本の内訳

ファンド名

インデックスオープン・世界株式	31,089,680円
インデックスオープン・先進国株式	43,177,105円
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,706,415,952円
たわらノーロード 先進国株式	95,042,515,142円
たわらノーロード 先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,813,454,454円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	1,261,968,507円
たわらノーロード バランス（堅実型）	62,849,475円
たわらノーロード バランス（標準型）	789,243,673円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,395,621,434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）	52,204,909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）	342,628,958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）	450,124,948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）	725,279,880円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	626,417円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	19,166,636円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	10,640,512円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	24,656,616円
たわらノーロード 全世界株式	20,045,591,560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）	20,243,331円
D I A M外国株式インデックスファンド＜DC年金＞	57,317,813,209円
One DC 先進国株式インデックスファンド	4,347,435,542円
One グローバルバランス	62,587,059円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞１安定型	108,055,541円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞２安定・成長型	627,572,874円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞３成長型	921,981,607円
D I A M DC バランス３０インデックスファンド	50,732,407円
D I A M DC バランス５０インデックスファンド	174,909,344円
D I A M DC バランス７０インデックスファンド	201,685,387円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,927,979円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	509,942,661円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	102,863,586円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国１０）	107,111,273円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国２０）	158,544,616円
D I A M DC ８資産バランスファンド（新興国３０）	297,435,927円
投資のソムリエ	2,323,757,609円
クルーズコントロール	38,404,013円
投資のソムリエ＜DC年金＞	507,903,401円
D I A M ８資産バランスファンドN＜DC年金＞	152,589,901円
４資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	389,261,951円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	254,574,454円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	420,352,551円
ワールドアセットバランス（基本コース）	41,208,645円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	87,375,747円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	98,576,709円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	54,342,720円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	2,935,139円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	198,562,654円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	175,956,634円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	119,176,042円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	91,102,136円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	79,008,322円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	65,074,610円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	36,239,380円
4資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	247,200,599円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	15,733,502円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	22,338,941円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	608,733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）	4,193,518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）	5,555,275円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04（適格機関投資家限定）	10,890,824円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	18,391,324円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	4,687,111円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2022-05（適格機関投資家限定）	17,597,282円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01（適格機関投資家限定）	11,423,560円
MSCIコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	215,482,552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）	11,988,178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）	837,649,289円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	1,027,563,843円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	10,219,142円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	2,619,592円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	7,424,044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）	1,658,119円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	6,281,866円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	22,098,323円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	796,543円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,131,605円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	402,103円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	21,750円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	37,022,941円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	104,080,569円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	394,702,364円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	11,917,610円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	12,793,975円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	49,663,606円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	1,895,604円

D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	88,533円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	20,589,219円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,468,719円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	6,186,580円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	9,299,996円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	17,833,478円
動的パッケージファンド<DC年金>	11,302,813円
コア資産形成ファンド	3,716,401円
たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジなし）<ラップ専用>	3,206,377,690円
One外国株式インデックスファンド	122,372,629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>	645,257,468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]	1,502,048,917円
計	206,745,417,387円
2. 受益権の総数	206,745,417,387口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	120,199,503,161
投資信託受益証券	△71,597,657
投資証券	1,083,167,368
合計	121,211,072,872

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2026年2月17日から2026年6月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	2,263,716,076	—	2,263,816,904	100,828
アメリカ・ドル	1,767,457,942	—	1,767,529,481	71,539
イギリス・ポンド	87,595,560	—	87,606,412	10,852
オーストラリア・ドル	43,594,438	—	43,598,939	4,501
カナダ・ドル	98,937,128	—	98,944,172	7,044
ユーロ	266,131,008	—	266,137,900	6,892
合計	2,263,716,076	—	2,263,816,904	100,828

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

株式関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	47,196,692,500	—	46,386,902,694	△809,789,806
合計	47,196,692,500	—	46,386,902,694	△809,789,806

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	13.2788円 (132,788円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2026年6月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,998,281	238.000	475,590,878.000	
	ABBOTT LABORATORIES	360,322	89.170	32,129,912.740	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	193,675	272.360	52,749,323.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	336,723	452.400	152,333,485.200	
	ADOBE INC	84,028	233.380	19,610,454.640	
	CHUBB LTD	71,817	330.580	23,741,263.860	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	45,147	276.510	12,483,596.970	
	ALLSTATE CORP	53,455	223.340	11,938,639.700	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	131,689	205.880	27,112,131.320	
	AMGEN INC	111,509	337.730	37,659,934.570	

AMERICAN EXPRESS CO	109,328	313.340	34,256,835.520	
AMERICAN ELECTRIC POWER	112,689	128.530	14,483,917.170	
AFLAC INC	96,261	117.110	11,273,125.710	
AMERICAN INTL GROUP	107,917	74.940	8,087,299.980	
ANALOG DEVICES	101,026	392.670	39,669,879.420	
COMFORT SYSTEMS USA INC	7,114	1,719.480	12,232,380.720	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	127,012	139.360	17,700,392.320	
VALERO ENERGY CORP	62,618	257.990	16,154,817.820	
APPLE INC	3,031,272	291.580	883,858,289.760	
APPLIED MATERIALS INC	164,143	497.010	81,580,712.430	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	99,892	81.280	8,119,221.760	
AMEREN CORP	58,769	108.770	6,392,304.130	
AUTODESK INC	43,162	221.280	9,550,887.360	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	83,467	231.100	19,289,223.700	
AUTOZONE INC	3,422	3,110.050	10,642,591.100	
AVERY DENNISON CORP	15,877	156.070	2,477,923.390	
BALL CORP	51,188	54.720	2,801,007.360	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	286,952	483.680	138,792,943.360	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	141,767	139.750	19,811,938.250	
BECTON DICKINSON & CO	57,747	147.790	8,534,429.130	
AMETEK INC	47,821	221.780	10,605,741.380	
VERIZON COMM INC	863,185	46.950	40,526,535.750	
WR BERKLEY CORP	47,466	68.150	3,234,807.900	
BEST BUY CO INC	40,496	75.640	3,063,117.440	
YUM! BRANDS INC	56,238	151.080	8,496,437.040	
FIRSTENERGY CORP	116,401	46.430	5,404,498.430	
BOEING CO	154,246	209.000	32,237,414.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	308,522	48.340	14,913,953.480	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	23,522	184.995	4,351,452.390	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	36,292	210.460	7,638,014.320	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	4,001	1,133.030	4,533,253.030	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	422,005	55.600	23,463,478.000	
ONEOK INC	130,263	90.570	11,797,919.910	
UNITED RENTALS INC	13,076	1,056.350	13,812,832.600	
SEMPRA	133,629	91.030	12,164,247.870	
FEDEX CORP	44,850	319.250	14,318,362.500	
VERISIGN INC	16,703	288.090	4,811,967.270	
AMPHENOL CORP	254,149	149.220	37,924,113.780	
QUANTA SERVICES INC	31,029	650.920	20,197,396.680	
MASTEC INC	12,794	335.580	4,293,410.520	
CSX CORP	386,402	46.410	17,932,916.820	

CONSTELLATION BRANDS INC	30,084	142.270	4,280,050.680	
CARDINAL HEALTH INC	47,962	216.300	10,374,180.600	
CARLISLE COS INC	8,371	327.820	2,744,181.220	
CARNIVAL CORP LTD	261,654	25.990	6,800,387.460	
CASEY'S GENERAL STORES INC	7,323	915.600	6,704,938.800	
CATERPILLAR INC	96,032	856.160	82,218,757.120	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	16,461	125.690	2,068,983.090	
JPMORGAN CHASE & CO	553,428	309.140	171,086,731.920	
CHURCH & DWIGHT CO INC	47,891	98.190	4,702,417.290	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	32,053	166.430	5,334,580.790	
CINTAS CORP	71,020	180.400	12,812,008.000	
CISCO SYSTEMS INC	815,415	118.800	96,871,302.000	
CLOROX COMPANY	25,012	99.320	2,484,191.840	
COCA-COLA CO/THE	798,487	83.590	66,745,528.330	
COPART INC	183,663	31.360	5,759,671.680	
COEUR MINING INC	203,453	15.410	3,135,210.730	
COLGATE-PALMOLIVE CO	157,014	89.950	14,123,409.300	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	45,093	386.230	17,416,269.390	
CIENA CORP	29,237	434.650	12,707,862.050	
NRG ENERGY, INC.	40,981	120.650	4,944,357.650	
COMCAST CORP-CL A	742,651	23.970	17,801,344.470	
CONSOLIDATED EDISON INC	76,947	107.600	8,279,497.200	
CMS ENERGY CORP	61,821	73.460	4,541,370.660	
COOPER COS INC	41,316	67.690	2,796,680.040	
CORNING INC	163,249	168.170	27,453,584.330	
HEICO CORP-CL A	14,337	237.450	3,404,320.650	
CUMMINS INC	28,593	630.520	18,028,458.360	
CURTISS-WRIGHT CORP	7,388	719.020	5,312,119.760	
DR HORTON INC	54,313	146.710	7,968,260.230	
DANAHER CORP	132,128	183.630	24,262,664.640	
MOODY'S CORP	31,208	450.690	14,065,133.520	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	96,679	51.810	5,008,938.990	
TARGET CORP	94,042	127.980	12,035,495.160	
DEERE & CO	50,181	560.050	28,103,869.050	
MORGAN STANLEY	243,834	206.660	50,390,734.440	
REPUBLIC SERVICES INC	42,963	212.590	9,133,504.170	
COSTAR GROUP INC	84,266	34.230	2,884,425.180	
DECKERS OUTDOOR CORP	29,843	111.180	3,317,944.740	
THE WALT DISNEY CO	365,243	98.610	36,016,612.230	
DOLLAR TREE INC	38,951	110.320	4,297,074.320	
DOVER CORP	28,812	213.760	6,158,853.120	
OMNICOM GROUP	64,516	73.980	4,772,893.680	
DTE ENERGY CO	42,598	146.070	6,222,289.860	
DUKE ENERGY CORP	160,388	125.040	20,054,915.520	

DARDEN RESTAURANTS INC	23,659	203.640	4,817,918.760	
EBAY INC	88,439	106.410	9,410,793.990	
BANK OF AMERICA CORP	1,400,578	54.540	76,387,524.120	
CITIGROUP INC	351,855	133.380	46,930,419.900	
EATON CORP PLC	80,264	375.460	30,135,921.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	57,120	385.130	21,998,625.600	
ECOLAB INC	51,525	256.990	13,241,409.750	
ELECTRONIC ARTS INC	46,324	203.200	9,413,036.800	
SALESFORCE INC	165,083	170.920	28,215,986.360	
ERIE INDEMNITY CO	4,706	231.980	1,091,697.880	
EMERSON ELECTRIC CO	116,342	137.110	15,951,651.620	
ATMOS ENERGY CORP	33,172	169.270	5,615,024.440	
ENTERGY CORP	94,996	110.480	10,495,158.080	
EOG RESOURCES INC	108,621	140.280	15,237,353.880	
EQUIFAX INC	26,113	166.060	4,336,324.780	
EQT CORP	122,739	52.610	6,457,298.790	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	51,478	85.390	4,395,706.420	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	28,659	164.710	4,720,423.890	
EXXON MOBIL CORP	857,984	150.620	129,229,550.080	
NEXTERA ENERGY INC	430,322	85.120	36,629,008.640	
FAIR ISAAC CORP	4,652	1,220.150	5,676,137.800	
FASTENAL CO	234,357	46.030	10,787,452.710	
FIFTH THIRD BANCORP	185,702	52.650	9,777,210.300	
M&T BANK CORP	29,858	223.930	6,686,101.940	
FISERV INC	114,716	53.280	6,112,068.480	
FORD MOTOR CO	795,014	14.300	11,368,700.200	
FREEPORT-MCMORAN INC	298,163	62.080	18,509,959.040	
FLEX LTD	75,823	139.490	10,576,550.270	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,770	2,112.870	3,739,779.900	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	52,875	220.140	11,639,902.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	47,501	341.070	16,201,166.070	
GENERAL MILLS INC	108,036	33.820	3,653,777.520	
GENUINE PARTS CO	27,885	98.430	2,744,720.550	
GILEAD SCIENCES INC	256,711	121.480	31,185,252.280	
MCKESSON CORP	25,083	790.440	19,826,606.520	
NVIDIA CORP	4,766,484	200.420	955,298,723.280	
GRACO INC	36,793	73.470	2,703,181.710	
GE AEROSPACE	215,755	318.710	68,763,276.050	
WW GRAINGER INC	8,993	1,317.630	11,849,446.590	
HALLIBURTON CO	174,094	39.730	6,916,754.620	
MONSTER BEVERAGE CORP	149,257	91.210	13,613,730.970	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	60,612	1,001.290	60,690,189.480	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	38,546	303.000	11,679,438.000	
MILlicom INTERNATIONAL CELLULAR SA	18,620	89.250	1,661,835.000	
HEICO CORP	9,043	320.880	2,901,717.840	
HERSHEY FOODS CORP	30,749	176.610	5,430,580.890	

HP INC	182,679	24.690	4,510,344.510	
F5 INC	12,072	390.770	4,717,375.440	
UNITED THERAPEUTICS CORP	8,650	544.100	4,706,465.000	
HOME DEPOT INC	205,776	318.920	65,626,081.920	
CENTERPOINT ENERGY INC	137,066	42.740	5,858,200.840	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,572	504.800	3,317,545.600	
HUBBELL INC	11,173	467.590	5,224,383.070	
HUMANA INC	24,900	364.460	9,075,054.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,087	280.750	4,235,675.250	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	421,929	16.840	7,105,284.360	
COHERENT CORP	38,473	354.770	13,649,066.210	
BIOGEN INC	30,654	194.240	5,954,232.960	
IDEX CORP	14,254	214.500	3,057,483.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	55,626	250.170	13,915,956.420	
INTUIT INC	57,242	284.220	16,269,321.240	
IDEXX LABORATORIES INC	16,673	556.940	9,285,860.620	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	45,948	449.120	20,636,165.760	
INTEL CORP	907,376	107.040	97,125,527.040	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	52,909	74.230	3,927,435.070	
INTERNATIONAL PAPER CO	108,812	31.850	3,465,662.200	
JABIL CIRCUIT INC	21,288	352.360	7,501,039.680	
INCYTE CORP	32,676	105.390	3,443,723.640	
EMCOR GROUP INC	8,954	776.720	6,954,750.880	
JOHNSON & JOHNSON	496,924	238.490	118,511,404.760	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	57,091	129.260	7,379,582.660	
KLA CORPORATION	27,115	2,135.640	57,907,878.600	
DEVON ENERGY CORP	225,955	46.600	10,529,503.000	
KEYCORP	192,791	21.980	4,237,546.180	
KIMBERLY-CLARK CORP	70,313	101.580	7,142,394.540	
KROGER CO	114,966	64.460	7,410,708.360	
LAM RESEARCH CORP	258,098	321.800	83,055,936.400	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,512	601.350	5,720,041.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	17,694	216.640	3,833,228.160	
LENNAR CORP	42,935	89.850	3,857,709.750	
ELI LILLY & CO	165,849	1,136.370	188,465,828.130	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	154,755	103.260	15,980,001.300	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	58,215	131.620	7,662,258.300	
LOCKHEED MARTIN CORP	42,370	525.020	22,245,097.400	
LOEWS CORP	35,267	108.050	3,810,599.350	
LOWE'S COS INC	115,849	216.190	25,045,395.310	
DOMINION ENERGY INC	182,410	66.770	12,179,515.700	
MCCORMICK & CO INC	50,907	49.690	2,529,568.830	

MCDONALD'S CORPORATION	145,898	282.520	41,219,102.960	
S&P GLOBAL INC	62,080	426.380	26,469,670.400	
EVEREST GROUP LTD	8,099	336.550	2,725,718.450	
MARKEL GROUP INC	2,702	1,820.940	4,920,179.880	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	119,668	85.980	10,289,054.640	
MARSH & MCLENNAN COS	98,963	167.150	16,541,665.450	
MASCO CORP	45,618	70.870	3,232,947.660	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	12,497	552.870	6,909,216.390	
METLIFE INC	112,337	86.130	9,675,585.810	
MEDTRONIC PLC	265,677	80.250	21,320,579.250	
CVS HEALTH CORP	262,496	98.020	25,729,857.920	
MERCK & CO.INC.	510,871	119.090	60,839,627.390	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	81,106	110.170	8,935,448.020	
MICROSOFT CORP	1,456,414	397.360	578,720,667.040	
MICRON TECH INC	232,888	891.880	207,708,149.440	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	110,020	87.910	9,671,858.200	
3M CO	108,220	156.850	16,974,307.000	
ENTEGRIS INC	30,003	128.880	3,866,786.640	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34,449	411.640	14,180,586.360	
ILLUMINA INC	30,724	162.470	4,991,728.280	
INSMED INC	43,039	91.880	3,954,423.320	
XCEL ENERGY INC	130,650	78.100	10,203,765.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19,683	160.860	3,166,207.380	
NETAPP INC	40,052	160.660	6,434,754.320	
NEWMONT CORP	224,428	92.770	20,820,185.560	
NVR INC	548	6,305.040	3,455,161.920	
NIKE INC-CL B	241,514	43.960	10,616,955.440	
NORDSON CORP	10,461	278.570	2,914,120.770	
NORFOLK SOUTHERN CORP	45,582	308.930	14,081,647.260	
EVERSOURCE ENERGY	79,691	69.180	5,513,023.380	
NISOURCE INC	93,648	46.630	4,366,806.240	
TAPESTRY INC	39,685	140.920	5,592,410.200	
NORTHERN TRUST CORP	36,485	166.130	6,061,253.050	
NORTHROP GRUMMAN CORP	27,740	542.140	15,038,963.600	
WELLS FARGO & CO	634,421	81.970	52,003,489.370	
NUCOR CORP	46,149	250.490	11,559,863.010	
CHENIERE ENERGY INC	43,236	241.810	10,454,897.160	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	122,784	177.630	21,810,121.920	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	149,419	57.100	8,531,824.900	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	39,038	235.950	9,211,016.100	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	171,761	90.460	15,537,500.060	
ORACLE CORP	356,314	201.260	71,711,755.640	

PACCAR INC	109,559	113.990	12,488,630.410	
PTC INC	25,446	135.080	3,437,245.680	
EXELON CORP	214,119	45.610	9,765,967.590	
PARKER HANNIFIN CORP	26,107	875.600	22,859,289.200	
PAYCHEX INC	69,211	101.100	6,997,232.100	
PPL CORPORATION	158,459	35.580	5,637,971.220	
PEPSICO INC	281,929	144.320	40,687,993.280	
PENTAIR PLC	35,336	71.400	2,522,990.400	
PFIZER INC	1,176,234	25.600	30,111,590.400	
CONOCOPHILLIPS	252,689	119.920	30,302,464.880	
PG&E CORP	445,717	16.720	7,452,388.240	
ALTRIA GROUP INC	344,559	73.130	25,197,599.670	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	83,119	232.640	19,336,804.160	
BROWN & BROWN INC	64,590	60.180	3,887,026.200	
GARMIN LTD	32,924	231.720	7,629,149.280	
PPG INDUSTRIES INC	44,165	112.970	4,989,320.050	
COSTCO WHOLESALE CORP	91,632	983.370	90,108,159.840	
T ROWE PRICE GROUP INC	42,210	106.430	4,492,410.300	
QUEST DIAGNOSTICS	22,778	203.780	4,641,700.840	
PROCTER & GAMBLE CO	479,179	149.050	71,421,629.950	
PROGRESSIVE CORP	121,236	204.200	24,756,391.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	104,578	78.590	8,218,785.020	
PULTE GROUP INC	38,191	118.490	4,525,251.590	
GLOBAL PAYMENTS INC	50,003	62.470	3,123,687.410	
QUALCOMM INC	220,565	191.200	42,172,028.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	37,191	150.590	5,600,592.690	
RELIANCE INC	10,580	394.290	4,171,588.200	
REGENERON PHARMACEUTICALS	21,556	601.650	12,969,167.400	
RESMED INC	29,381	193.570	5,687,280.170	
US BANCORP	315,066	56.810	17,898,899.460	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	74,749	91.310	6,825,331.190	
ROSS STORES INC	65,030	231.920	15,081,757.600	
ROLLINS INC	59,922	47.770	2,862,473.940	
ROPER TECHNOLOGIES INC	22,280	334.100	7,443,748.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	23,385	440.070	10,291,036.950	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	52,772	268.730	14,181,419.560	
RPM INTERNATIONAL INC	26,441	104.280	2,757,267.480	
ACCENTURE PLC-CL A	125,396	170.500	21,380,018.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	263,183	64.180	16,891,084.940	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18,910	263.910	4,990,538.100	
AXON ENTERPRISE INC	15,159	447.590	6,785,016.810	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	43,946	303.360	13,331,458.560	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	109,688	38.970	4,274,541.360	
BOOKING HOLDINGS INC	163,340	160.640	26,238,937.600	
SLB LTD	310,327	55.510	17,226,251.770	
SCHWAB (CHARLES) CORP	341,482	89.270	30,484,098.140	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	40,666	88.170	3,585,521.220	
ELEVANCE HEALTH INC	45,380	404.560	18,358,932.800	
CENCORA INC	38,352	281.240	10,786,116.480	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	43,108	109.210	4,707,824.680	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	48,976	303.910	14,884,296.160	
CENTENE CORP	104,991	65.340	6,860,111.940	
SNAP-ON INC	10,624	378.450	4,020,652.800	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	71,227	105.170	7,490,943.590	
EDISON INTERNATIONAL	76,731	71.500	5,486,266.500	
SOUTHERN CO	232,889	94.020	21,896,223.780	
TRUIST FINANCIAL CORP	261,788	49.760	13,026,570.880	
AT&T INC	1,437,642	23.210	33,367,670.820	
CHEVRON CORP	381,646	189.800	72,436,410.800	
STATE STREET CORP	57,489	161.800	9,301,720.200	
STARBUCKS CORP	235,054	98.760	23,213,933.040	
STEEL DYNAMICS INC	27,961	268.340	7,503,054.740	
STRYKER CORP	71,389	308.840	22,047,778.760	
NETFLIX INC	869,501	82.000	71,299,082.000	
GEN DIGITAL INC	108,241	24.620	2,664,893.420	
SYNOPSYS INC	37,643	460.540	17,336,107.220	
SYSCO CORP	100,556	78.540	7,897,668.240	
INTUITIVE SURGICAL INC	73,531	412.020	30,296,242.620	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	234,196	33.580	7,864,301.680	
TERADYNE INC	32,525	347.590	11,305,364.750	
TEXAS INSTRUMENTS INC	188,272	282.010	53,094,586.720	
TEXTRON INC	38,875	91.330	3,550,453.750	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	76,132	482.040	36,698,669.280	
TRACTOR SUPPLY CO	106,564	30.770	3,278,974.280	
TRIMBLE INC	48,211	50.600	2,439,476.600	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,175	302.810	2,475,471.750	
TYSON FOODS INC	56,217	56.130	3,155,460.210	
UNION PACIFIC CORP	122,730	267.030	32,772,591.900	
RTX CORP	277,731	177.410	49,272,256.710	
UNITEDHEALTH GROUP INC	187,427	407.460	76,369,005.420	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	52,711	435.710	22,966,709.810	
VULCAN MATERIALS CO	26,210	272.670	7,146,680.700	
WALMART INC	904,759	120.590	109,104,887.810	
WASTE MANAGEMENT INC	83,039	224.280	18,623,986.920	
WATERS CORP	19,824	363.180	7,199,680.320	

WATSCO INC	7,083	375.660	2,660,799.780	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	14,539	330.920	4,811,245.880	
WESTERN DIGITAL CORP	71,585	490.090	35,083,092.650	
WABTEC CORP	34,663	256.520	8,891,752.760	
NASDAQ INC	94,302	86.720	8,177,869.440	
CME GROUP INC	74,932	263.800	19,767,061.600	
WILLIAMS COS INC	252,765	72.260	18,264,798.900	
WILLIAMS-SONOMA INC	23,215	206.940	4,804,112.100	
DICK'S SPORTING GOODS INC	13,092	214.970	2,814,387.240	
ALLIANT ENERGY CORP	51,637	73.000	3,769,501.000	
WEC ENERGY GROUP INC	68,860	114.010	7,850,728.600	
STRATEGY INC-CL A	54,158	115.350	6,247,125.300	
TJX COMPANIES INC	228,712	167.660	38,345,853.920	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	241,849	7.250	1,753,405.250	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	32,128	61.000	1,959,808.000	
TPG INC-CVR	42,879	0.010	428.790	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	26,682	291.220	7,770,332.040	
CBRE GROUP INC	58,510	134.060	7,843,850.600	
REGIONS FINANCIAL CORP	175,370	28.580	5,012,074.600	
DOMINO'S PIZZA INC	5,925	314.770	1,865,012.250	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9,572	1,473.040	14,099,938.880	
CRH PLC	136,350	99.980	13,632,273.000	
T-MOBILE US INC	102,826	185.550	19,079,364.300	
LAS VEGAS SANDS CORP	58,121	50.810	2,953,128.010	
DEXCOM INC	79,725	74.770	5,961,038.250	
EXPEDIA GROUP INC	23,401	218.940	5,123,414.940	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	109.260	3,383,672.940	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,656	450.620	8,406,766.720	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	116,878	140.340	16,402,658.520	
LIVE NATION	33,805	167.500	5,662,337.500	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	272,180	30.420	8,279,715.600	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	16,804	102.780	1,727,115.120	
TRANSDIGM GROUP INC	11,750	1,212.360	14,245,230.000	
MASTERCARD INC	168,931	489.080	82,620,773.480	
LEIDOS HOLDINGS INC	26,042	121.690	3,169,050.980	
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	135.070	4,580,493.840	
FIRST SOLAR INC	21,246	249.270	5,295,990.420	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	22,446	146.440	3,286,992.240	

SUPER MICRO COMPUTER INC	101,720	29.270	2,977,344.400	
DELTA AIR LINES INC	30,555	76.470	2,336,540.850	
INTERACTIVE BROKERS GROUP INC	91,011	85.420	7,774,159.620	
INSULET CORP	13,390	150.710	2,018,006.900	
LULULEMON ATHLETICA INC	21,544	118.930	2,562,227.920	
MERCADOLIBRE INC	9,454	1,588.290	15,015,693.660	
ULTA BEAUTY INC	8,638	470.750	4,066,338.500	
MSCI INC	15,204	608.520	9,251,938.080	
ECHOSTAR CORP	27,136	115.240	3,127,152.640	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	321,570	182.950	58,831,231.500	
VISA INC	346,807	322.960	112,004,788.720	
KEURIG DR PEPPER INC	267,013	31.700	8,464,312.100	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	41,490	126.460	5,246,825.400	
MARATHON PETROLEUM CORP	60,882	263.280	16,029,012.960	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	391,550	31.840	12,466,952.000	
XYLEM INC	50,406	107.130	5,399,994.780	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	55,397	65.150	3,609,114.550	
FABRINET	7,484	580.250	4,342,591.000	
HCA HEALTHCARE INC	32,021	373.340	11,954,720.140	
VERISK ANALYTICS INC	28,116	183.130	5,148,883.080	
CORPAY INC	13,937	348.990	4,863,873.630	
NXP SEMICONDUCTOR NV	52,562	285.560	15,009,604.720	
TARGA RESOURCES CORP	42,287	272.540	11,524,898.980	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	20,737	301.080	6,243,495.960	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	47,078	68.250	3,213,073.500	
DOLLAR GENERAL CORP	43,366	109.960	4,768,525.360	
FORTINET INC	128,927	138.880	17,905,381.760	
HYATT HOTELS CORP	9,487	190.630	1,808,506.810	
NEBIUS GROUP NV	41,742	211.690	8,836,363.980	
TESLA INC	581,165	381.590	221,766,752.350	
GENERAL MOTORS CO	190,561	79.400	15,130,543.400	
XPO LOGISTICS INC	23,951	216.260	5,179,643.260	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	16,613	289.180	4,804,147.340	
PHILLIPS 66	82,619	181.720	15,013,524.680	
META PLATFORMS INC	453,412	570.980	258,889,183.760	
IQVIA HOLDINGS INC	33,630	182.170	6,126,377.100	
DIAMONDBACK ENERGY INC	39,671	196.550	7,797,335.050	
SERVICENOW INC	216,807	106.060	22,994,550.420	
PALO ALTO NETWORKS INC	167,533	263.220	44,098,036.260	
WORKDAY INC	42,662	137.470	5,864,745.140	
ABBVIE INC	365,375	224.950	82,191,106.250	
ZOETIS INC	90,719	81.290	7,374,547.510	

NEWS CORP/NEW-CL A	74,879	26.970	2,019,486.630	
CDW CORP	26,509	129.300	3,427,613.700	
HOWMET AEROSPACE INC	82,891	249.490	20,680,475.590	
COMPASS GROUP PLC	344,275	33.180	11,423,044.500	
TWILIO INC	30,284	207.090	6,271,513.560	
BLOOM ENERGY CORP	55,814	234.230	13,073,313.220	
OKTA INC	33,875	114.920	3,892,915.000	
BAKER HUGHES CO	200,369	63.020	12,627,254.380	
TECHNIPFMC LTD	83,671	69.950	5,852,786.450	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	10.180	1,648,773.160	
BROADCOM INC	928,729	372.100	345,580,060.900	
ARES MANAGEMENT CORP	43,107	128.310	5,531,059.170	
MONGODB INC	15,583	348.280	5,427,247.240	
BURLINGTON STORES INC	12,574	327.010	4,111,823.740	
VEEVA SYSTEMS INC	32,022	163.760	5,243,922.720	
EVERGY INC	48,779	82.830	4,040,364.570	
ALLEGION PLC	18,940	129.350	2,449,889.000	
STERIS PLC	21,164	208.100	4,404,228.400	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	30,259	503.100	15,223,302.900	
KKR & CO INC	128,333	95.020	12,194,201.660	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	11,993	92.930	1,114,509.490	
ZOOM COMMUNICATIONS INC	51,232	93.960	4,813,758.720	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	46,923	338.220	15,870,297.060	
CIGNA GROUP	54,639	295.810	16,162,762.590	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	30,052	162.250	4,875,937.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	62,449	369.830	23,095,513.670	
DOW INC	145,651	34.240	4,987,090.240	
AMCOR PLC	91,979	38.170	3,510,838.430	
FOX CORP-A	44,561	68.000	3,030,148.000	
FOX CORP-B	27,507	61.030	1,678,752.210	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	51,186	647.740	33,155,219.640	
CLOUDFLARE INC	64,526	219.670	14,174,426.420	
TRADEWEB MARKETS INC	24,737	100.990	2,498,189.630	
CARRIER GLOBAL CORP	156,129	67.970	10,612,088.130	
OTIS WORLDWIDE CORP	83,060	69.660	5,785,959.600	
UBER TECHNOLOGIES INC	368,438	68.610	25,278,531.180	
CORTEVA INC	140,971	74.460	10,496,700.660	
AST SPACEMOBILE INC	49,318	87.320	4,306,447.760	
BLACKSTONE INC	153,592	118.480	18,197,580.160	
CARLYLE GROUP INC	55,171	44.110	2,433,592.810	
DATADOG INC	63,721	227.630	14,504,811.230	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	45,186	815.990	36,871,324.140	
VERTIV HOLDINGS CO	75,128	280.980	21,109,465.440	
INGERSOLL RAND INC	79,632	70.480	5,612,463.360	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	95,719	63.760	6,103,043.440	

CIRCLE INTERNET GROUP INC	30,911	78.930	2,439,805.230	
REVOLUTION MEDICINES INC	33,656	144.190	4,852,858.640	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	150,179	14.760	2,216,642.040	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDING LTD	33,424	237.680	7,944,216.320	
FTAI AVIATION LTD	20,450	225.760	4,616,792.000	
AON PLC	41,341	336.330	13,904,218.530	
SOFI TECHNOLOGIES INC	255,173	15.870	4,049,595.510	
WARNER BROS DISCOVERY INC	478,669	26.230	12,555,487.870	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	11,625	375.180	4,361,467.500	
COINBASE GLOBAL INC	43,801	153.970	6,744,039.970	
ROCKET COS INC	170,295	12.540	2,135,499.300	
AFFIRM HOLDINGS INC	57,758	62.810	3,627,779.980	
AIRBNB INC	87,646	129.100	11,315,098.600	
CONSTELLATION ENERGY CORP	63,717	242.300	15,438,629.100	
IREN LTD	65,395	51.520	3,369,150.400	
ASTERA LABS INC	27,279	330.860	9,025,529.940	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	60,836	27.180	1,653,522.480	
APPROVIN CORP	47,450	492.980	23,391,901.000	
REDDIT INC	24,095	172.210	4,149,399.950	
ROYALTY PHARMA PLC	83,460	54.520	4,550,239.200	
ROBLOX CORP	123,872	41.500	5,140,688.000	
EXPAND ENERGY CORP	47,257	88.560	4,185,079.920	
BLACKROCK INC	30,407	1,010.680	30,731,746.760	
SNOWFLAKE INC	68,079	239.900	16,332,152.100	
DOORDASH INC	77,894	151.000	11,761,994.000	
ARISTA NETWORKS INC	220,544	151.760	33,469,757.440	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	88,471	131.140	11,602,086.940	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	449,954	130.210	58,588,510.340	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	52,125	47.600	2,481,150.000	
MEDLINE INC	76,732	36.540	2,803,787.280	
JACOBS SOLUTIONS INC	23,919	121.760	2,912,377.440	
MARVELL TECHNOLOGY INC	176,372	252.590	44,549,803.480	
LINDE PLC	95,761	509.160	48,757,670.760	
ROBINHOOD MARKETS INC	155,596	86.360	13,437,270.560	
IONQ INC	70,744	56.630	4,006,232.720	
TOAST INC	93,856	24.300	2,280,700.800	
GE VERNOVA INC	55,667	867.090	48,268,299.030	
GRAB HOLDINGS LTD	445,513	3.270	1,456,827.510	
SYNCHRONY FINANCIAL	70,641	69.560	4,913,787.960	
VERALTO CORP	47,699	82.620	3,940,891.380	
SAMSARA INC	67,082	32.640	2,189,556.480	

LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	41,459	88.610	3,673,681.990	
BUNGE GLOBAL SA	27,820	128.210	3,566,802.200	
KENVUE INC	396,743	18.050	7,161,211.150	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	90,573	64.960	5,883,622.080	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	35,245	324.000	11,419,380.000	
TE CONNECTIVITY PLC	59,532	202.000	12,025,464.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	110,186	38.950	4,291,744.700	
SHARKNINJA INC	18,042	128.220	2,313,345.240	
FERGUSON ENTERPRISES INC	40,472	224.560	9,088,392.320	
LABCORP HOLDINGS INC	16,433	268.630	4,414,396.790	
ROCKET LAB CORP	107,596	105.050	11,302,959.800	
APTIV PLC	43,097	65.200	2,809,924.400	
COREWEAVE INC	56,394	95.610	5,391,830.340	
AMRIZE LTD	101,552	50.510	5,129,391.520	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS INC	28,482	93.110	2,651,959.020	
FEDEX FREIGHT HOLDING CO INC	22,425	175.350	3,932,223.750	
QNTITY ELECTRONICS INC	43,012	139.740	6,010,496.880	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	28,625	112.940	3,232,907.500	
LUMENTUM HOLDINGS INC	14,781	853.260	12,612,036.060	
TRANSUNION	39,291	67.850	2,665,894.350	
BLOCK INC	108,820	66.630	7,250,676.600	
DUPONT DE NEMOURS INC	80,396	45.060	3,622,643.760	
CARVANA CO	136,080	67.250	9,151,380.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	40,260	97.510	3,925,752.600	
NATERA INC	27,136	216.500	5,874,944.000	
KRAFT HEINZ CO	197,902	24.050	4,759,543.100	
FORTIVE CORP	61,432	60.060	3,689,605.920	
WASTE CONNECTIONS INC	50,733	159.030	8,068,068.990	
ALPHABET INC-CL A	1,201,935	356.380	428,345,595.300	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	275,822	45.490	12,547,142.780	
PAYPAL HOLDINGS INC	174,416	40.700	7,098,731.200	
SEA LTD ADR	79,292	82.440	6,536,832.480	
ALPHABET INC-CL C	954,159	353.320	337,123,457.880	
EVERPURE INC-A	65,520	66.530	4,359,045.600	
ZSCALER INC	23,062	124.730	2,876,523.260	
ATLASSIAN CORP PLC	36,837	91.540	3,372,058.980	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	17,132	137.790	2,360,618.280	
VISTRA CORP	70,177	138.540	9,722,321.580	
アメリカ・ドル 小計	75,009,960		12,733,518,042.860 (2,045,130,332,863)	

イギリス・ボン ド	ANTOFAGASTA PLC	72,481	38.120	2,762,975.720	
	SEVERN TRENT PLC	59,179	29.240	1,730,393.960	
	BARCLAYS PLC	2,823,408	4.458	12,586,752.860	
	BT GROUP PLC	1,171,195	2.027	2,374,012.260	
	BUNZL PLC	61,315	25.760	1,579,474.400	
	AVIVA PLC	643,467	6.130	3,944,452.710	
	DIAGEO PLC	461,394	15.070	6,953,207.580	
	SCHRODERS PLC	168,541	5.830	982,594.030	
	NATIONAL GRID PLC	1,015,985	11.995	12,186,740.070	
	KINGFISHER PLC	336,026	2.795	939,192.670	
	BAE SYSTEMS PLC	615,526	19.400	11,941,204.400	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	414,060	45.660	18,905,979.600	
	HALMA PLC	76,539	46.420	3,552,940.380	
	NEXT PLC	24,259	139.700	3,388,982.300	
	IMPERIAL BRANDS PLC	150,861	28.030	4,228,633.830	
	ANGLO AMERICAN PLC	220,325	37.120	8,178,464.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,542,558	12.934	45,819,445.170	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,077,905	2.732	2,944,836.460	
	CENTRICA PLC	963,585	1.848	1,780,705.080	
	UNILEVER PLC	451,307	44.015	19,864,277.600	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	143,835	13.110	1,885,676.850	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	74,161	19.375	1,436,869.370	
	PEARSON PLC	116,743	11.490	1,341,377.070	
	PRUDENTIAL PLC	499,870	9.262	4,629,795.940	
	RIO TINTO PLC	220,198	74.790	16,468,608.420	
	VODAFONE GROUP PLC	3,849,443	1.128	4,342,171.700	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	134,013	46.480	6,228,924.240	
	RELX PLC	369,379	25.480	9,411,776.920	
	RENTOKIL INITIAL PLC	492,609	4.520	2,226,592.680	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,736,987	12.336	21,427,471.630	
	NATWEST GROUP PLC	1,636,775	5.862	9,594,775.050	
	SSE PLC	244,486	23.600	5,769,869.600	
	BP PLC	3,259,442	5.405	17,617,284.010	
	THE SAGE GROUP PLC	186,583	8.502	1,586,328.660	
	SMITHS GROUP PLC	70,278	24.820	1,744,299.960	
	SPIRAX GROUP PLC	18,173	67.800	1,232,129.400	
	STANDARD CHARTERED PLC	368,111	17.910	6,592,868.010	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,036,234	0.972	11,699,219.440	
	TESCO PLC	1,286,682	4.692	6,037,111.940	
	3I GROUP PLC	196,566	21.870	4,298,898.420	
	SMITH & NEPHEW PLC	157,186	11.605	1,824,143.530	
	GSK PLC	839,075	19.215	16,122,826.120	

	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	93,966	90.140	8,470,095.240	
	ASTRAZENECA PLC	313,660	134.640	42,231,182.400	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	439,486	3.625	1,593,136.750	
	INTERTEK GROUP PLC	29,397	54.650	1,606,546.050	
	SAINSBURY (J) PLC	371,991	3.094	1,150,940.150	
	ADMIRAL GROUP PLC	55,777	34.280	1,912,035.560	
	EXPERIAN PLC	181,172	25.560	4,630,756.320	
	FRESNILLO PLC NPR	40,047	28.200	1,129,325.400	
	INFORMA PLC	259,912	8.074	2,098,529.480	
	GLENCORE PLC	1,951,650	5.640	11,007,306.000	
	COCA-COLA HBC AG	40,130	45.220	1,814,678.600	
	STANDARD LIFE PLC	135,828	7.725	1,049,271.300	
	AIRTEL AFRICA PLC	194,933	3.472	676,807.370	
	M&G PLC	454,395	3.168	1,439,523.360	
	ENDEAVOUR MINING PLC	38,875	36.530	1,420,103.750	
	HALEON PLC	1,841,743	3.381	6,226,933.080	
	SHELL PLC	1,154,020	32.390	37,378,707.800	
	WISE GROUP PLC	120,090	7.920	951,112.800	
	SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	82,201	61.000	5,014,261.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	253,295	4.488	1,136,787.960	
イギリス・ポンド 小計		50,339,313		453,102,324.410 (97,299,193,144)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	270,286	68.270	18,452,425.220	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	305,127	66.200	20,199,407.400	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,768	2,452.600	14,146,596.800	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	22,660	694.900	15,746,434.000	
	HAREL INSURANCE INVESTMENTS & FINANCES LTD	24,133	162.100	3,911,959.300	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	29.410	7,177,716.370	
	ICL GROUP LTD	161,905	16.470	2,666,575.350	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	50,192	168.300	8,447,313.600	
	NOVA LTD	5,865	1,590.300	9,327,109.500	
	ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD	29,169	273.600	7,980,638.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	200.700	5,909,410.800	
	AZRIELI GROUP	10,380	419.000	4,349,220.000	
	OPC ENERGY LTD	34,792	103.000	3,583,576.000	
イスラエル・シュケル 小計		1,193,778		121,898,382.740 (6,587,315,464)	
オーストラリア・ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	709,399	35.410	25,119,818.590	
	FORTESCUE LTD	330,859	19.660	6,504,687.940	
	TELSTRA GROUP LTD	824,041	5.180	4,268,532.380	
	LYNAS CORP LTD	171,192	16.870	2,888,009.040	

	ASX LTD	45,184	48.200	2,177,868.800	
	BHP GROUP LTD	1,051,303	60.200	63,288,440.600	
	COMPUTERSHARE LT	109,500	36.230	3,967,185.000	
	CSL LIMITED	100,489	102.950	10,345,342.550	
	REA GROUP LTD	9,317	149.430	1,392,239.310	
	TRANSURBAN GROUP	659,024	15.540	10,241,232.960	
	COCHLEAR LTD	12,995	104.930	1,363,565.350	
	ORIGIN ENERGY LTD	375,434	11.000	4,129,774.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	345,707	160.240	55,396,089.680	
	RIO TINTO LIMITED	76,617	179.440	13,748,154.480	
	APA GROUP	278,473	10.550	2,937,890.150	
	ARISTOCRAT LEISU	116,857	52.820	6,172,386.740	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444,982	7.870	3,502,008.340	
	PRO MEDICUS LTD	11,011	161.580	1,779,157.380	
	MACQUARIE GROUP LTD	73,524	237.470	17,459,744.280	
	SUNCORP GROUP LTD	235,880	18.270	4,309,527.600	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	624,381	36.330	22,683,761.730	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	179,494	9.320	1,672,884.080	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	313,634	23.420	7,345,308.280	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	269,243	18.540	4,991,765.220	
	SANTOS LTD	654,961	7.910	5,180,741.510	
	SONIC HEALTHCARE	88,200	20.280	1,788,696.000	
	WESFARMERS LTD	232,684	83.390	19,403,518.760	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	383,553	31.040	11,905,485.120	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	243,597	37.630	9,166,555.110	
	BRAMBLES LTD	276,036	18.000	4,968,648.000	
	PILBARA MINERALS LTD	657,319	5.760	3,786,157.440	
	EVOLUTION MINING LTD	393,664	10.730	4,224,014.720	
	CAR GROUP LTD	70,405	26.930	1,896,006.650	
	SGH LTD	39,806	42.000	1,671,852.000	
	XERO LTD	31,885	76.820	2,449,405.700	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	1,113,206	2.760	3,072,448.560	
	LOTTERY CORP LTD	486,416	5.460	2,655,831.360	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	627,081	34.560	21,671,919.360	
	MEDIBANK PVT LTD	629,748	4.840	3,047,980.320	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	76,399	43.570	3,328,704.430	
	SOUTH32 LTD(AUD)	867,426	4.480	3,886,068.480	
	COLES GROUP LTD	264,538	23.730	6,277,486.740	
	WISETECH GLOBAL LTD	38,698	38.050	1,472,458.900	
オーストラリア・ドル	小計	14,544,162		389,539,353.640 (43,776,432,562)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	104,626	212.410	22,223,608.660	

BARRICK MINING CORP	345,227	51.820	17,889,663.140	
BANK OF MONTREAL	142,910	229.390	32,782,124.900	
BANK OF NOVA SCOTIA	255,687	113.860	29,112,521.820	
NATIONAL BANK OF CANADA	80,178	205.870	16,506,244.860	
BCE INC	68,397	34.490	2,359,012.530	
BROOKFIELD CORP	416,157	62.270	25,914,096.390	
BOMBARDIER INC 'B'	17,199	301.930	5,192,894.070	
SAPUTO INC	56,192	41.780	2,347,701.760	
DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17,626	103.210	1,819,179.460	
CGI INC	38,154	93.270	3,558,623.580	
CCL INDUSTRIES INC	27,743	83.160	2,307,107.880	
CAE INC	55,407	35.440	1,963,624.080	
CAMECO CORP	90,352	132.440	11,966,218.880	
ROGERS COMM-CL B	74,725	53.880	4,026,183.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	189,614	153.740	29,151,256.360	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	434,754	63.590	27,646,006.860	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	179.620	1,600,593.820	
CANADIAN UTILITIES LTD	31,617	51.520	1,628,907.840	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	106,683	166.500	17,762,719.500	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,184	79.630	2,960,961.920	
CELESTICA INC	23,369	507.090	11,850,186.210	
EMPIRE CO LTD	20,608	49.450	1,019,065.600	
KINROSS GOLD CORP	252,455	32.990	8,328,490.450	
RB GLOBAL INC	35,429	147.380	5,221,526.020	
FORTIS INC	105,011	78.770	8,271,716.470	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	135,943	39.720	5,399,655.960	
TELUS CORP	31,890	16.580	528,736.200	
GREAT WEST LIFECO INC	50,854	81.920	4,165,959.680	
IMPERIAL OIL LTD	32,165	167.450	5,386,029.250	
ENBRIDGE INC	451,909	78.850	35,633,024.650	
IGM FINANCIAL INC	12,478	79.440	991,252.320	
MANULIFE FINANCIAL CORP	347,046	54.770	19,007,709.420	
LOBLAW CO LTD	120,170	66.470	7,987,699.900	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	142,970	83.430	11,927,987.100	
MAGNA INTERNATIONAL INC	54,200	89.330	4,841,686.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	113,356	104.470	11,842,301.320	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,943	2,279.690	8,988,817.670	
METRO INC	40,887	93.750	3,833,156.250	
EMERA INC	64,335	72.830	4,685,518.050	
PAN AMERICAN SILVER CORP	87,130	61.580	5,365,465.400	
POWER CORP OF CANADA	108,654	84.280	9,157,359.120	
ROYAL BANK OF CANADA	288,455	275.760	79,544,350.800	
ATKINSREALIS GROUP INC	32,972	79.870	2,633,473.640	

CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	184,943	124.940	23,106,778.420	
STANTEC INC	22,549	99.590	2,245,654.910	
SUNCOR ENERGY INC	240,270	86.660	20,821,798.200	
LUNDIN MINING CORP	138,909	35.800	4,972,942.200	
TECK RESOURCES LTD-CL B	96,471	83.550	8,060,152.050	
THOMSON REUTERS CORP	29,819	114.510	3,414,573.690	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,754	205.240	3,643,830.960	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	340,119	159.650	54,299,998.350	
TC ENERGY CORP	211,052	96.150	20,292,649.800	
WESTON (GEORGE) LTD	36,807	104.830	3,858,477.810	
INTACT FINANCIAL CORP	35,418	282.250	9,996,730.500	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	92,215	149.990	13,831,327.850	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,067	3,143.700	12,785,427.900	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	39,792	290.950	11,577,482.400	
TOURMALINE OIL CORP	72,309	64.090	4,634,283.810	
KEYERA CORP	54,385	59.040	3,210,890.400	
WHITECAP RESOURCES INC	278,574	16.610	4,627,114.140	
ALTAGAS LTD	59,998	56.030	3,361,687.940	
PEMBINA PIPELINE CORP	119,897	68.230	8,180,572.310	
DOLLARAMA INC	56,558	179.570	10,156,120.060	
CENOVUS ENERGY INC W/I	285,254	39.620	11,301,763.480	
ARC RESOURCES LTD	112,620	31.920	3,594,830.400	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	73,200	26.060	1,907,592.000	
TMX GROUP LTD	61,220	50.330	3,081,202.600	
IVANHOE MINES LTD	136,822	11.100	1,518,724.200	
NUTRIEN LTD	96,968	90.780	8,802,755.040	
TFI INTERNATIONAL INC	14,528	214.250	3,112,624.000	
WSP GLOBAL INC	28,163	183.460	5,166,783.980	
IA FINANCIAL CORP INC	19,845	177.000	3,512,565.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC	48,982	51.000	2,498,082.000	
EQUINOX GOLD CORP	162,179	13.600	2,205,634.400	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	68,283	63.810	4,357,138.230	
LUNR ROYALTIES CORP	4,762	20.600	98,097.200	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	52.210	1,511,061.820	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	69,235	102.190	7,075,124.650	
LUNDIN GOLD INC	22,677	73.090	1,657,461.930	
SHOPIFY INC	253,335	150.930	38,235,851.550	
FIRSTSERVICE CORP	7,857	199.310	1,565,978.670	
HYDRO ONE LTD	68,595	56.170	3,852,981.150	
ALAMOS GOLD INC	88,473	45.960	4,066,219.080	
カナダ・ドル 小計	8,939,418		853,531,383.870	

				(98,318,280,108)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	10.560	3,060,288.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	6.130	994,286.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	425,081	61.830	26,282,758.230	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	178,500	21.700	3,873,450.000	
	KEPPEL LTD	310,000	10.550	3,270,500.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	689,298	23.230	16,012,392.540	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,553,230	4.270	6,632,292.100	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	345,800	6.950	2,403,310.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	253,966	37.880	9,620,232.080	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	381,600	3.500	1,335,600.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	508,500	3.370	1,713,645.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.560	1,037,542.400	
シンガポール・ドル 小計		5,503,265		76,236,296.350 (9,508,190,881)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	30,835	88.300	2,722,730.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	530,802	79.730	42,320,843.460	
	CIE FINANC RICHEMONT	111,046	169.050	18,772,326.300	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,599	263.200	2,000,056.800	
	SIKA INHABER	30,549	149.600	4,570,130.400	
	SGS SA-REG	32,234	89.940	2,899,125.960	
	NOVARTIS AG-REG SHS	378,420	119.040	45,047,116.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	717	1,142.000	818,814.000	
	SWISSCOM AG-REG	5,126	659.500	3,380,597.000	
	ABB LTD	323,009	79.600	25,711,516.400	
	GEBERIT AG	6,586	504.000	3,319,344.000	
	LONZA GROUP AG-REG	14,580	499.000	7,275,420.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	217	9,210.000	1,998,570.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	94,300.000	1,886,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,936	3,156.000	6,110,016.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	30,974	561.200	17,382,608.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	7,648	330.000	2,523,840.000	
	HOLCIM LTD	105,046	71.720	7,533,899.120	
	SONOVA HOLDING AG	10,293	203.200	2,091,537.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	10,478	192.750	2,019,634.500	
	STRAUMANN HOLDING AG	22,266	94.260	2,098,793.160	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6,261	199.550	1,249,382.550	
	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	16,170	201.200	3,253,404.000	
	SCHINDLER NAMEN	5,064	251.500	1,273,596.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,861	852.400	4,995,916.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	117.800	577,573.400	

	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	692.500	862,162.500	
	SWISS PRIME SITE AG	15,640	129.500	2,025,380.000	
	AVOLTA AG	21,652	47.760	1,034,099.520	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,868	707.600	3,444,596.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	44,986	63.740	2,867,407.640	
	SWISS RE LTD	60,185	120.450	7,249,283.250	
	BKW AG	3,194	140.000	447,160.000	
	ALCON INC	99,146	53.660	5,320,174.360	
	SANDOZ GROUP AG	85,536	66.020	5,647,086.720	
	BELIMO HOLDING AG	1,988	872.000	1,733,536.000	
	GALDERMA GROUP AG	38,378	166.650	6,395,693.700	
	UBS GROUP AG	653,375	37.780	24,684,507.500	
	ROCHE HOLDING AG	143,478	323.900	46,472,524.200	
	VAT GROUP AG	5,632	629.600	3,545,907.200	
スイス・フラン	小計	2,877,943		325,562,312.540 (65,392,446,097)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	528,528	179.350	94,791,496.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	289,975	159.650	46,294,508.750	
	ERICSSON LM-B SHS	553,049	111.600	61,720,268.400	
	LUNDBERGS B	14,872	531.500	7,904,468.000	
	SKF AB-B SHS	66,600	236.600	15,757,560.000	
	SANDVIK AB	220,531	364.500	80,383,549.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	300,082	183.250	54,990,026.500	
	SKANSKA AB-B SHS	62,329	236.000	14,709,644.000	
	SWEDBANK AB	163,144	336.800	54,946,899.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	138,616	100.350	13,910,115.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	288,078	134.300	38,688,875.400	
	TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	405.600	15,069,662.400	
	VOLVO AB-B SHS	327,975	307.000	100,688,325.000	
	TELE2 AB-B SHS	126,566	180.500	22,845,163.000	
	INDUSTRIVARDEN A	24,631	510.500	12,574,125.500	
	INDUSTRIVARDEN C	31,300	496.300	15,534,190.000	
	SAAB AB-B	63,945	524.900	33,564,730.500	
	SECURITAS AB-B SHS	99,643	156.600	15,604,093.800	
	INVESTOR AB-B SHS	349,119	377.850	131,914,614.150	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	165.700	17,343,653.300	
	ASSA ABLOY AB-B	208,377	329.900	68,743,572.300	
	TELIA CO AB	468,019	50.180	23,485,193.420	
	BOLIDEN AB	65,558	502.400	32,936,339.200	
	ALFA LAVAL AB	58,487	530.200	31,009,807.400	
	FASTIGHETS AB BALDER	117,966	51.080	6,025,703.280	
	INDUTRADE AB	58,393	191.200	11,164,741.600	
	NIBE INDUSTRIER AB	292,985	35.660	10,447,845.100	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	435.000	15,825,735.000	
	HEXAGON AB-B SHS	404,109	80.660	32,595,431.940	
	SAGAX AB	44,607	161.900	7,221,873.300	
	EPIROC AB-A	125,482	259.700	32,587,675.400	
	EPIROC AB-B	80,804	223.200	18,035,452.800	
	ESSITY AB-B	115,540	263.000	30,387,020.000	
	EQT AB	97,156	285.600	27,747,753.600	
	ADDTECH AB	47,848	322.200	15,416,625.600	
	OCTAVE INTELLIGENCE PLC	40,410	182.600	7,378,866.000	
	BEIJER REF AB	71,081	126.300	8,977,530.300	
	LIFCO AB	49,888	303.600	15,145,996.800	
	EVOLUTION AB	26,852	723.000	19,413,996.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	191.350	5,288,531.300	
スウェーデン・クローナ 小計		6,228,387		1,269,071,660.140 (21,447,311,056)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	18,112	852.600	15,442,291.200	
	A P MOLLER A/S	851	18,235.000	15,517,985.000	
	AP MOLLER MAERSK A	296	17,720.000	5,245,120.000	
	DANSKE BANK A/S	126,706	329.000	41,686,274.000	
	GENMAB A/S	12,165	1,608.000	19,561,320.000	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	75,035	392.300	29,436,230.500	
	ROCKWOOL AS	16,770	202.400	3,394,248.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	664,597	283.100	188,147,410.700	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	195,996	166.300	32,594,134.800	
	COLOPLAST-B	25,816	383.100	9,890,109.600	
	DSV A/S	40,848	1,539.500	62,885,496.000	
	DEMANT A/S	17,700	253.800	4,492,260.000	
	TRYG A/S	79,447	149.800	11,901,160.600	
	PANDORA A/S	14,742	617.600	9,104,659.200	
	ORSTED A/S	106,744	156.000	16,652,064.000	
デンマーク・クローネ 小計		1,395,825		465,950,763.600 (11,555,578,937)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	303,739	8.260	2,508,884.140	
	CONTACT ENERGY L	183,385	9.600	1,760,496.000	
	FISHER & PAYKEL	116,144	38.700	4,494,772.800	
	INFRATIL LTD	218,942	15.050	3,295,077.100	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.880	1,407,131.040	
ニュージーランド・ドル 小計		1,061,518		13,466,361.080 (1,253,987,544)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	102,370	190.100	19,460,537.000	
	NORSK HYDRO ASA	280,113	110.000	30,812,430.000	
	TELENOR ASA	119,422	148.800	17,769,993.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	89,335	298.000	26,621,830.000	
	ORKLA ASA	156,830	99.500	15,604,585.000	
	EQUINOR ASA	141,794	352.700	50,010,743.800	

	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	469.900	13,821,638.600	
	AKER BP ASA	72,231	347.600	25,107,495.600	
	SALMAR ASA	12,897	524.000	6,758,028.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	41,223	252.800	10,421,174.400	
	DNB BANK ASA	173,149	285.000	49,347,465.000	
	VAR ENERGI ASA	184,231	48.520	8,938,888.120	
ノルウェー・クロネ 小計		1,403,009		274,674,809.120 (4,661,231,511)	
ユーロ	RYANAIR HOLDINGS	88,153	23.750	2,093,633.750	
	KERRY GROUP PLC-A	31,648	76.800	2,430,566.400	
	KINGSPAN GROUP PLC	29,826	80.300	2,395,027.800	
	AIR LIQUIDE	131,640	167.720	22,078,660.800	
	AIRBUS SE	122,733	174.960	21,473,365.680	
	AXA SA	324,162	40.530	13,138,285.860	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	124,161	34.700	4,308,386.700	
	ADIDAS AG	35,785	172.100	6,158,598.500	
	GENERALI	167,223	41.050	6,864,504.150	
	DASSAULT AVIATION SA	4,132	297.800	1,230,509.600	
	DANONE	132,926	66.340	8,818,310.840	
	SAFRAN SA	71,409	291.500	20,815,723.500	
	INTESA SANPAOLO	2,850,690	5.595	15,949,610.550	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53,290	67.620	3,603,469.800	
	ACCOR SA	38,165	45.100	1,721,241.500	
	BOUYGUES	46,470	48.890	2,271,918.300	
	BPER BANCA SPA	330,915	12.652	4,186,736.580	
	BNP PARIBAS	202,031	91.960	18,578,770.760	
	THALES SA	18,414	234.000	4,308,876.000	
	CAPGEMINI SA	30,992	99.600	3,086,803.200	
	LOTUS BAKERIES NV	77	11,560.000	890,120.000	
	UNICREDIT SPA	282,635	70.650	19,968,162.750	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	15,271	288.800	4,410,264.800	
	D'IETEREN TRDG	4,146	165.000	684,090.000	
	COMMERZBANK AG	134,133	36.220	4,858,297.260	
	EIFFAGE	12,706	123.400	1,567,920.400	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	84,108	37.690	3,170,030.520	
	PUBLICIS GROUPE	44,953	88.840	3,993,624.520	
	IBERDROLA SA	1,251,718	20.060	25,109,463.080	
	ENI SPA	377,838	23.505	8,881,082.190	
	INDRA SISTEMAS SA	15,276	53.960	824,292.960	
	JERONIMO MARTINS	45,606	17.700	807,226.200	
	KESKO OYJ-B	56,685	21.460	1,216,460.100	
	KBC GROUPE	47,056	110.600	5,204,393.600	
	HANNOVER RUECK SE	11,943	230.800	2,756,444.400	
	WARTSILA OYJ	101,897	32.800	3,342,221.600	
	L'OREAL	49,413	384.050	18,977,062.650	

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	51,411	487.650	25,070,574.150	
GEA GROUP AG	31,889	54.600	1,741,139.400	
BOLLORE	114,808	5.410	621,111.280	
MICHELIN(CGDE) -B	136,013	32.450	4,413,621.850	
CONTINENTAL AG	21,977	68.540	1,506,303.580	
DEUTSCHE POST AG-REG	188,184	50.820	9,563,510.880	
OMV AG	31,189	57.700	1,799,605.300	
VERBUND AG	10,663	58.450	623,252.350	
PERNOD-RICARD	42,072	63.060	2,653,060.320	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	33,246	30.450	1,012,340.700	
RENAULT SA	34,278	26.690	914,879.820	
REPSOL SA	228,703	23.160	5,296,761.480	
MERCK KGAA	25,862	136.450	3,528,869.900	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	93,273	74.320	6,932,049.360	
RWE AG	118,579	55.600	6,592,992.400	
SOCIETE GENERALE-A	131,179	68.760	9,019,868.040	
VINCI S.A.	96,469	122.850	11,851,216.650	
SODEXO	17,430	49.140	856,510.200	
SOFINA	3,443	214.600	738,867.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	113,320	257.700	29,202,564.000	
SAP SE	215,663	149.700	32,284,751.100	
TELEFONICA S.A	760,673	3.938	2,995,530.270	
TOTALENERGIES SE	402,823	77.240	31,114,048.520	
E.ON SE	453,875	18.000	8,169,750.000	
HENKEL AG & CO KGAA	25,036	64.050	1,603,555.800	
SIEMENS AG-REG	153,817	258.400	39,746,312.800	
UPM-KYMMENE OYJ	103,401	24.810	2,565,378.810	
ING GROEP NV-CVA	601,564	25.050	15,069,178.200	
BAYER AG	202,870	35.370	7,175,511.900	
STORA ENSO OYJ-R SHS	136,215	9.560	1,302,215.400	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,704	68.660	2,039,476.640	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	150,471	47.110	7,088,688.810	
BASF SE	184,768	47.980	8,865,168.640	
BEIERSDORF AG	18,636	70.740	1,318,310.640	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	77,021	23.190	1,786,116.990	
HOCHTIEF AG	3,095	462.200	1,430,509.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	26,569	172.000	4,569,868.000	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	42,494	38.830	1,650,042.020	
ASM INTERNATIONAL NV	9,599	906.600	8,702,453.400	
ORANGE	389,060	18.020	7,010,861.200	
SAMPO OYJ-A SHS	484,110	9.008	4,360,862.880	
ALLIANZ SE	78,103	381.500	29,796,294.500	
EDP SA	624,219	4.380	2,734,079.220	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	182,188	36.180	6,591,561.840	
HERMES INTL	5,368	1,635.500	8,779,364.000	
ENDESA S.A.	63,990	37.280	2,385,547.200	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	8.044	873,956.460	
ERSTE GROUP BANK AG	63,085	101.400	6,396,819.000	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	26,927	460.300	12,394,498.100	
ARCELOR MITTAL (NL)	88,596	55.700	4,934,797.200	
DASSAULT SYSTEMES SA	134,189	19.335	2,594,544.310	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35,984	117.800	4,238,915.200	
RHEINMETALL STAMM	9,643	1,197.200	11,544,599.600	
HEINEKEN NV	57,687	69.760	4,024,245.120	
AKZO NOBEL	34,435	57.320	1,973,814.200	
ASML HOLDING NV	80,136	1,507.200	120,780,979.200	
AEGON LTD	232,433	7.276	1,691,182.500	
BANKINTER S.A.	139,390	13.780	1,920,794.200	
VOLKSWAGEN AG PFD	40,684	86.300	3,511,029.200	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,159,510	19.240	22,308,972.400	
KERING	14,490	256.000	3,709,440.000	
ACCIONA S.A.	5,005	233.600	1,169,168.000	
FORTUM OYJ	95,817	20.500	1,964,248.500	
AGEAS	31,169	65.100	2,029,101.900	
UCB SA	25,044	264.400	6,621,633.600	
NEMETSCHEK SE	10,222	61.300	626,608.600	
CARREFOUR SA	125,695	16.325	2,051,970.870	
NATURGY ENERGY GROUP SA	84,865	29.400	2,495,031.000	
NOKIA OYJ	1,034,047	11.740	12,139,711.780	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	158,010	22.460	3,548,904.600	
WOLTERS KLUWER-CVA	47,174	63.080	2,975,735.920	
SANOFI	226,323	76.010	17,202,811.230	
STMICROELECTRONICS NV	131,433	61.330	8,060,785.890	
ELISA OYJ	34,206	40.100	1,371,660.600	
BANCO SANTANDER SA	2,981,707	10.444	31,140,947.900	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	85,537	15.120	1,293,319.440	
QIAGEN N.V.	41,781	32.265	1,348,063.960	
DEUTSCHE BANK AG-REG	373,357	27.095	10,116,107.910	
BMW VORZUG	12,776	67.450	861,741.200	
BUZZI UNICEM	14,138	43.940	621,223.720	
ENEL SPA	1,566,822	9.607	15,052,458.950	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,704,453	0.913	1,556,165.580	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	708,377	28.630	20,280,833.510	
SARTORIUS AG	4,533	236.300	1,071,147.900	
LEONARDO SPA	82,251	52.320	4,303,372.320	
CTS EVENTIM AG	11,578	50.000	578,900.000	

INFINEON TECHNOLOGIES AG	270,188	75.100	20,291,118.800	
RATIONAL AG	860	652.500	561,150.000	
KONINKLIJKE KPN NV	794,750	4.452	3,538,227.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	65.420	1,507,145.960	
DEUTSCHE BOERSE AG	37,265	246.800	9,197,002.000	
BANCO SABADELL	1,070,505	2.834	3,033,811.170	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15,900	80.350	1,277,565.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	25,531	63.550	1,622,495.050	
INDITEX	221,359	55.020	12,179,172.180	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	413,654	10.276	4,250,708.500	
MAPFRE SA	164,994	3.984	657,336.090	
ESSILORLUXOTTICA	61,880	178.600	11,051,768.000	
SNAM SPA	390,173	6.368	2,484,621.660	
CREDIT AGRICOLE SA	183,415	16.315	2,992,415.720	
TENARIS SA	76,002	26.680	2,027,733.360	
TELECOM ITALIA SPA	3,428,390	0.767	2,629,575.130	
TERNA SPA	302,512	10.160	3,073,521.920	
BIOMERIEUX	6,736	70.150	472,530.400	
NESTE OYJ	84,986	28.450	2,417,851.700	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	26,147	47.740	1,248,257.780	
RECORDATI SPA	23,751	50.850	1,207,738.350	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	103,040	5.488	565,483.520	
MTU AERO ENGINES AG	10,833	300.300	3,253,149.900	
KONE OYJ	67,111	49.460	3,319,310.060	
ELIA GROUP	10,817	133.500	1,444,069.500	
FINANCIERE DE TUBIZE SA	3,656	230.800	843,804.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	6,975	178.600	1,245,735.000	
ENGIE	376,351	26.940	10,138,895.940	
ALSTOM	68,028	16.115	1,096,271.220	
IPSEN SA	8,274	155.100	1,283,297.400	
LEGRAND SA	51,838	136.400	7,070,703.200	
ADP	6,104	102.700	626,880.800	
ORION OYJ	21,796	68.750	1,498,475.000	
METSO CORPORATION	133,678	14.740	1,970,413.720	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	19.350	1,539,969.750	
SYMRISE AG	26,736	82.860	2,215,344.960	
REXEL SA	41,104	35.640	1,464,946.560	
PRYSMIAN SPA	58,055	136.300	7,912,896.500	
CAIXABANK	714,469	11.330	8,094,933.770	
BUREAU VERITAS SA	72,096	25.100	1,809,609.600	
GETLINK	72,777	18.380	1,337,641.260	
EDP RENEWABLES SA	67,001	13.370	895,803.370	
AMADEUS IT GROUP SA	93,451	52.000	4,859,452.000	
BRENNTAG SE	28,127	55.580	1,563,298.660	

INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	253,234	4.706	1,191,719.200	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	15.400	659,674.400	
TALANX AG	13,274	99.200	1,316,780.800	
VONOVIA SE	164,754	19.970	3,290,137.380	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	192,866	17.020	3,282,579.320	
KNORR-BREMSE AG	14,544	96.750	1,407,132.000	
ITALGAS SPA	122,960	10.665	1,311,368.400	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65,799	35.100	2,309,544.900	
FERRARI NV	24,750	303.900	7,521,525.000	
ASR NEDERLAND NV	34,744	63.960	2,222,226.240	
AYVENS SA	65,316	11.380	743,296.080	
AIB GROUP PLC	449,244	9.940	4,465,485.360	
NORDEA BANK ABP	626,610	15.800	9,900,438.000	
MONCLER SPA	43,309	55.360	2,397,586.240	
PROSUS NV	268,508	39.900	10,713,469.200	
DR ING HC F PORSCHE AG	27,385	47.730	1,307,086.050	
EXOR NV	16,552	66.200	1,095,742.400	
SIEMENS ENERGY AG	159,956	138.680	22,182,698.080	
HENSOLDT AG	13,720	77.900	1,068,788.000	
INPOST SA	60,024	15.290	917,766.960	
EURONEXT NV	16,722	144.000	2,407,968.000	
NN GROUP NV	51,556	71.860	3,704,814.160	
FINECOBANK SPA	124,605	21.140	2,634,149.700	
ARGENX SE	12,682	763.000	9,676,366.000	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	207,674	17.745	3,685,175.130	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	91,652	40.940	3,752,232.880	
DSM-FIRMENICH AG	36,128	71.500	2,583,152.000	
SYENQO SA	15,096	64.700	976,711.200	
ZALANDO SE	42,234	25.150	1,062,185.100	
STELLANTIS NV	404,098	5.771	2,332,049.550	
FERROVIAL NV	98,621	56.060	5,528,693.260	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	39,582	12.820	507,441.240	
MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	91,000	15.360	1,397,760.000	
CSG NV	39,041	14.332	559,535.610	
VERISURE PLC	50,000	10.980	549,000.000	
AENA SME SA	149,081	24.880	3,709,135.280	
CELLNEX TELECOM SAU	95,346	28.380	2,705,919.480	
BANCO BPM SPA	232,070	14.025	3,254,781.750	
ABN AMRO BANK NV	126,896	33.250	4,219,292.000	
SCOUT24 SE	15,592	74.450	1,160,824.400	
BANCA MEDIOLANUM SPA	55,270	19.875	1,098,491.250	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	184,485	70.440	12,995,123.400	
POSTE ITALIANE SPA	86,197	27.280	2,351,454.160	
AMUNDI SA	11,288	80.850	912,634.800	

	ABIVAX SA	11,120	84.100	935,192.000	
	BAWAG GROUP AG	15,890	154.700	2,458,183.000	
	ADYEN NV	5,508	803.100	4,423,474.800	
	DELIVERY HERO SE	34,547	36.940	1,276,166.180	
ユーロ 小計		40,890,006		1,306,564,018.710 (242,158,575,228)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	331,796	73.050	24,237,697.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	127,814	56.950	7,279,007.300	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	240,191	383.000	91,993,153.000	
	MTR CORP	356,941	31.420	11,215,086.220	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	26.840	7,997,568.480	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	257,320	55.950	14,397,054.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,376,406	6.820	16,207,088.920	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	431,904	31.200	13,475,404.800	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	753,495	46.280	34,871,748.600	
	SINO LAND CO	659,200	11.430	7,534,656.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	280,565	116.200	32,601,653.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	81.650	4,329,083.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	309,156	113.900	35,212,868.400	
	AIA GROUP LTD	2,151,716	70.250	151,158,049.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	11.860	9,454,032.960	
	SANDS CHINA LTD	588,200	14.890	8,758,298.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	276,000	33.480	9,240,480.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	351,135	22.280	7,823,287.800	
	WH GROUP LTD	1,550,000	8.750	13,562,500.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	536,445	66.250	35,539,481.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	379,695	45.080	17,116,650.600	
香港・ドル 小計		13,106,107		554,004,849.130 (11,351,559,359)	
合計		222,492,691		2,658,440,434,754 (2,658,440,434,754)	

(2) 株式以外の有価証券

2026年6月11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	12,939,629.110	
		SCENTRE GROUP	1,177,078.000	4,449,354.840	
		STOCKLAND	480,103.000	1,906,008.910	
		VICINITY CENTRES	815,965.000	2,088,870.400	
	オーストラリア・ドル 小計		2,881,465.000	21,383,863.260 (2,403,118,552)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	867,778.000	2,169,445.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,214,726.000	2,830,311.580	
	シンガポール・ドル 小計		2,082,504.000	4,999,756.580 (623,569,641)	
投資信託受益証券 合計			4,963,969	3,026,688,193 (3,026,688,193)	
投資証券	アメリカ・ドル	AMERICAN TOWER CORP	96,877.000	18,648,822.500	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	133,913.000	2,867,077.330	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,084.000	5,240,193.560	
		CROWN CASTLE INC	88,932.000	8,304,470.160	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	71,051.000	12,844,599.780	
		EQUINIX INC	20,410.000	21,192,315.300	
		EQUITY RESIDENTIAL	71,367.000	4,825,122.870	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,115.000	3,733,053.600	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	42,248.000	6,320,300.800	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	57,433.000	2,780,331.530	
		INVITATION HOMES INC	129,667.000	3,852,406.570	
		IRON MOUNTAIN INC	60,039.000	7,406,411.040	
		KIMCO REALTY	136,267.000	3,458,456.460	
		MID AMERICA	23,159.000	3,237,165.020	
		PROLOGIS INC	192,985.000	28,131,423.450	
		PUBLIC STORAGE	32,426.000	10,501,808.620	
		REALTY INCOME CORP	195,908.000	12,167,845.880	
		REGENCY CENTERS CORP	33,164.000	2,656,436.400	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	22,004.000	4,562,089.320	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	66,133.000	14,074,425.060	
		SUN COMMUNITIES INC	25,617.000	3,244,136.880	
		VENTAS INC	95,737.000	8,075,415.950	
		VICI PROPERTIES INC	222,086.000	6,309,463.260	
		WELLTOWER INC	145,634.000	30,781,202.240	
		WEYERHAEUSER CO	143,943.000	3,477,662.880	
		WP CAREY INC	44,884.000	3,404,002.560	
	アメリカ・ドル 小計		2,193,083.000	232,096,639.020 (37,277,041,192)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	176,057.000	1,141,729.640	
		SEGRO PLC	250,449.000	1,825,773.210	
	イギリス・ポンド 小計		426,506.000	2,967,502.850	

				(637,241,562)	
ユーロ	COVIVIO	8,731.000	471,037.450		
	GECINA SA	8,697.000	637,924.950		
	KLEPIERRE	48,371.000	1,771,346.020		
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	22,812.000	2,258,388.000		
ユーロ 小計		88,611.000	5,138,696.420 (952,405,994)		
香港・ドル	LINK REIT	499,016.000	18,733,060.640		
香港・ドル 小計		499,016.000	18,733,060.640 (383,840,413)		
投資証券 合計		3,207,216	39,250,529,161 (39,250,529,161)		
合計			42,277,217,354 (42,277,217,354)		

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

（注）

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

通貨	銘柄数	組入株 式 時価比 率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 514銘柄	74.49	—	—	—	77.11
	投資証券 26銘柄	—	—	—	1.36	
イギリス・ポンド	株式 62銘柄	3.54	—	—	—	3.63
	投資証券 2銘柄	—	—	—	0.02	
イスラエル・シェケル	株式 13銘柄	0.24	—	—	—	0.24
オーストラリア・ドル	株式 43銘柄	1.59	—	—	—	1.71
	投資信託受益証 券 4銘柄	—	—	0.09	—	
カナダ・ドル	株式 84銘柄	3.58	—	—	—	3.64
	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	0.35	—	—	—	0.38
	投資信託受益証 券 2銘柄	—	—	0.02	—	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.38	—	—	—	2.42
スウェーデン・クローナ	株式 40銘柄	0.78	—	—	—	0.79
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.42	—	—	—	0.43
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	0.17	—	—	—	0.17
ユーロ	株式 215銘柄	8.82	—	—	—	9.00
	投資証券 4銘柄	—	—	—	0.03	

香港・ドル	株式	21銘柄	0.41	—	—	—	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2026年6月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,026,101,057
国債証券	261,177,349,855
派生商品評価勘定	368,356,048
未収入金	1,161,646,522
未収利息	1,934,195,504
前払費用	414,953,338
流動資産合計	266,082,602,324
資産合計	
266,082,602,324	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,369,300,934
前受金	338,468,123
未払金	6,217,052
未払解約金	992,141,000
流動負債合計	2,706,127,109
負債合計	
2,706,127,109	
純資産の部	
元本等	
元本	231,097,611,684
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	32,278,863,531
元本等合計	263,376,475,215
純資産合計	263,376,475,215
負債純資産合計	266,082,602,324

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	233,385,760,966円
同期中追加設定元本額	59,102,491,297円
同期中一部解約元本額	61,390,640,579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＞	14,183,328,627円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,058,746,170円
たわらノーロード バランス（標準型）	8,006,006,452円
たわらノーロード バランス（積極型）	5,392,244,622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）	69,114,488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）	2,535,020,276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）	3,336,923,733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）	514,629,315円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	5,978,218円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	32,823,558円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	304,237,727円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	40,308,050円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	91,804円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	157,152,462円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	458,581,413円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	49,154,213円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け）	13,445,189円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け）	4,580,565円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け）	1,737,849円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け）	781,008円

未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	20,179円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	19,234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）	28,741円
投資のソムリエ	67,771,128,383円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	14,629,181,538円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	18,773,716,125円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	31,007,883,488円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,627,790,613円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,454,357,113円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,334,009,019円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	664,059,344円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	212,489,668円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	5,739,492,296円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,618,604,750円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	7,845,450,953円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	1,980,548,731円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	795,301,321円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	442,867,023円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	190,457,333円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	10,862,123円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	7,347,565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）	19,093,462,651円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	8,107,953,919円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	312,473,958円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	48,356,620円
DIAM世界アセットバランスファンド２VA（適格機関投資家限定）	245,197,523円
DIAM世界アセットバランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	29,401,479円
DIAM世界アセットバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	147,409,353円
DIAM世界アセットバランスファンド３VA（適格機関投資家限定）	276,963,258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）	354,057,049円
計	231,097,611,684円
２． 受益権の総数	231,097,611,684口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
----	-------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2026年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△3,069,642,414
合計	△3,069,642,414

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2025年6月24日から2026年6月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	265,171,697,459	—	266,172,642,345	△1,000,944,886
アメリカ・ドル	117,704,313,658	—	118,841,153,775	△1,136,840,117
イギリス・ポンド	15,110,102,081	—	15,132,288,600	△22,186,519
イスラエル・シェケル	1,240,541,499	—	1,181,770,923	58,770,576
オーストラリア・ドル	3,517,664,542	—	3,454,529,446	63,135,096
オフショア・人民元	33,740,685,328	—	33,934,014,463	△193,329,135
カナダ・ドル	5,636,789,910	—	5,620,500,770	16,289,140
シンガポール・ドル	983,766,505	—	982,985,890	780,615
スウェーデン・クローナ	477,214,884	—	467,832,955	9,381,929
デンマーク・クローネ	541,832,058	—	540,625,412	1,206,646
ニュージーランド・ドル	763,987,427	—	746,812,483	17,174,944
ノルウェー・クローネ	443,584,123	—	437,172,768	6,411,355
ポーランド・ズロチ	1,989,912,820	—	1,975,426,253	14,486,567
マレーシア・リンギット	1,345,381,679	—	1,320,265,401	25,116,278
メキシコ・ペソ	2,453,571,398	—	2,469,995,384	△16,423,986
ユーロ	77,284,608,915	—	77,136,068,583	148,540,332
韓国・ウォン	1,937,740,632	—	1,931,199,239	6,541,393
合計	265,171,697,459	—	266,172,642,345	△1,000,944,886

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月11日現在
1口当たり純資産額	1.1397円
（1万口当たり純資産額）	（11,397円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2026年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.375 07/31/27	2,600,000.000	2,495,289.050	
		US T N/B 0.375 09/30/27	2,820,000.000	2,689,464.850	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,600,000.000	2,514,761.830	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,500,000.000	2,410,951.550	
		US T N/B 0.5 08/31/27	2,900,000.000	2,778,732.410	
		US T N/B 0.5 10/31/27	1,300,000.000	1,237,742.190	
		US T N/B 0.625 05/15/30	1,690,000.000	1,471,356.250	
		US T N/B 0.625 08/15/30	5,190,000.000	4,477,388.640	
		US T N/B 0.625 11/30/27	2,200,000.000	2,092,148.430	
		US T N/B 0.625 12/31/27	2,860,000.000	2,711,302.330	
		US T N/B 0.75 01/31/28	870,000.000	823,917.180	
		US T N/B 0.875 11/15/30	2,690,000.000	2,326,482.220	
		US T N/B 1.0 07/31/28	7,770,000.000	7,273,600.180	
		US T N/B 1.125 02/15/31	4,000,000.000	3,475,468.760	
		US T N/B 1.125 02/29/28	1,520,000.000	1,445,009.370	
		US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,309,136.720	
		US T N/B 1.125 08/15/40	1,060,000.000	653,887.500	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,970,000.000	3,716,757.430	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,500,000.000	3,325,888.670	
		US T N/B 1.25 04/30/28	2,600,000.000	2,464,871.080	
		US T N/B 1.25 05/15/50	2,700,000.000	1,261,406.250	
		US T N/B 1.25 05/31/28	3,140,000.000	2,969,814.440	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,570,000.000	3,368,559.960	
		US T N/B 1.25 08/15/31	2,000,000.000	1,719,921.880	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,250,000.000	3,043,764.650	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,300,000.000	2,070,802.720	
		US T N/B 1.375 10/31/28	2,300,000.000	2,155,171.870	
		US T N/B 1.375 11/15/31	2,800,000.000	2,405,429.680	
		US T N/B 1.375 11/15/40	1,730,000.000	1,101,658.590	
		US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	3,264,843.750	
		US T N/B 1.5 02/15/30	1,500,000.000	1,362,539.070	
		US T N/B 1.5 11/30/28	3,840,000.000	3,601,424.980	
		US T N/B 1.625 05/15/31	2,950,000.000	2,605,333.970	
		US T N/B 1.625 08/15/29	1,200,000.000	1,109,460.930	
		US T N/B 1.625 11/15/50	3,100,000.000	1,591,656.250	
		US T N/B 1.75 01/31/29	1,600,000.000	1,503,624.990	
		US T N/B 1.75 08/15/41	500,000.000	330,253.900	
		US T N/B 1.75 11/15/29	3,000,000.000	2,767,734.360	
		US T N/B 1.875 02/15/32	4,780,000.000	4,194,450.000	
		US T N/B 1.875 02/15/41	2,900,000.000	1,983,781.250	

US T N/B 1.875 02/15/51	2,000,000.000	1,092,656.240	
US T N/B 1.875 02/28/29	2,600,000.000	2,447,097.660	
US T N/B 1.875 11/15/51	2,500,000.000	1,350,683.600	
US T N/B 2.0 02/15/50	1,000,000.000	572,890.620	
US T N/B 2.0 08/15/51	1,300,000.000	727,923.830	
US T N/B 2.0 11/15/41	2,000,000.000	1,365,664.050	
US T N/B 2.25 02/15/52	4,370,000.000	2,588,115.410	
US T N/B 2.25 05/15/41	1,000,000.000	719,082.020	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,900,000.000	2,840,697.260	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	2,888,789.040	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,890,000.000	1,767,754.290	
US T N/B 2.25 11/15/27	2,140,000.000	2,085,873.030	
US T N/B 2.375 02/15/42	1,000,000.000	719,218.750	
US T N/B 2.375 03/31/29	2,200,000.000	2,095,457.030	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,820,000.000	2,680,982.790	
US T N/B 2.375 05/15/51	1,180,000.000	725,884.370	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,880,000.000	1,804,837.490	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,110,000.000	1,457,136.330	
US T N/B 2.5 02/15/46	900,000.000	611,085.940	
US T N/B 2.5 05/15/46	800,000.000	541,093.750	
US T N/B 2.625 02/15/29	1,400,000.000	1,345,175.770	
US T N/B 2.625 05/31/27	3,300,000.000	3,258,026.720	
US T N/B 2.625 07/31/29	7,600,000.000	7,250,875.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	2,200,000.000	2,151,359.360	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,900,000.000	3,744,533.200	
US T N/B 2.75 07/31/27	2,150,000.000	2,119,597.660	
US T N/B 2.75 08/15/32	3,580,000.000	3,270,525.790	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,080,000.000	813,839.060	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,300,000.000	905,175.770	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,500,000.000	1,124,355.460	
US T N/B 2.75 11/15/47	800,000.000	555,374.990	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,150,000.000	3,038,519.540	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,440,000.000	3,360,046.860	
US T N/B 2.875 05/15/32	2,500,000.000	2,310,253.900	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,590,000.000	1,204,052.330	
US T N/B 2.875 05/15/49	2,700,000.000	1,887,574.210	
US T N/B 2.875 05/15/52	3,900,000.000	2,656,341.780	
US T N/B 2.875 08/15/28	2,900,000.000	2,823,421.870	
US T N/B 2.875 08/15/45	500,000.000	365,644.530	
US T N/B 2.875 11/15/46	2,550,000.000	1,834,605.440	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,390,000.000	1,019,369.530	
US T N/B 3.0 02/15/48	1,700,000.000	1,232,433.590	
US T N/B 3.0 02/15/49	2,100,000.000	1,507,652.340	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,200,000.000	942,609.360	
US T N/B 3.0 05/15/45	2,500,000.000	1,873,339.850	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,200,000.000	877,617.190	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,010,000.000	1,449,869.520	
US T N/B 3.0 08/15/52	3,200,000.000	2,233,687.480	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,500,000.000	1,131,035.160	

US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	744,101.560	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,000,000.000	802,500.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,260,000.000	994,071.080	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,220,000.000	1,642,713.280	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,000,000.000	1,543,359.380	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,000,000.000	2,902,910.160	
US T N/B 3.125 11/15/28	3,210,000.000	3,133,574.410	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,280,000.000	1,032,000.000	
US T N/B 3.25 05/15/42	1,550,000.000	1,259,738.280	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,390,000.000	3,364,416.000	
US T N/B 3.25 06/30/29	1,000,000.000	973,125.000	
US T N/B 3.375 02/29/28	7,000,000.000	6,914,414.080	
US T N/B 3.375 05/15/33	2,900,000.000	2,723,054.690	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,800,000.000	1,448,085.930	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,300,000.000	1,895,074.210	
US T N/B 3.375 09/15/27	700,000.000	694,203.120	
US T N/B 3.375 09/15/28	6,300,000.000	6,193,687.500	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,550,000.000	1,964,396.470	
US T N/B 3.5 01/15/29	5,200,000.000	5,113,773.440	
US T N/B 3.5 01/31/28	5,900,000.000	5,842,152.320	
US T N/B 3.5 01/31/30	1,500,000.000	1,463,408.200	
US T N/B 3.5 02/15/29	4,500,000.000	4,422,832.020	
US T N/B 3.5 02/15/33	1,600,000.000	1,518,124.990	
US T N/B 3.5 02/15/39	700,000.000	622,179.670	
US T N/B 3.5 02/28/31	2,000,000.000	1,935,585.930	
US T N/B 3.5 03/15/29	2,200,000.000	2,161,371.100	
US T N/B 3.5 04/30/28	2,800,000.000	2,767,679.680	
US T N/B 3.5 04/30/30	1,900,000.000	1,850,273.420	
US T N/B 3.5 09/30/27	1,000,000.000	992,929.690	
US T N/B 3.5 09/30/29	2,700,000.000	2,641,253.910	
US T N/B 3.5 10/15/28	2,800,000.000	2,758,328.130	
US T N/B 3.5 10/31/27	2,000,000.000	1,984,062.500	
US T N/B 3.5 11/15/28	2,800,000.000	2,756,796.860	
US T N/B 3.5 11/30/30	3,400,000.000	3,295,742.190	
US T N/B 3.5 12/15/28	2,000,000.000	1,968,125.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	2,000,000.000	1,672,578.120	
US T N/B 3.625 02/15/53	4,350,000.000	3,426,899.400	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,000,000.000	2,973,691.410	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,600,000.000	2,544,800.770	
US T N/B 3.625 05/15/53	3,880,000.000	3,054,439.050	
US T N/B 3.625 05/31/28	2,650,000.000	2,624,224.610	
US T N/B 3.625 08/15/28	1,600,000.000	1,582,437.500	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,800,000.000	1,513,828.110	
US T N/B 3.625 08/31/27	200,000.000	199,000.000	
US T N/B 3.625 08/31/29	2,000,000.000	1,965,156.240	
US T N/B 3.625 08/31/30	2,300,000.000	2,244,746.080	
US T N/B 3.625 09/30/30	2,300,000.000	2,243,802.740	
US T N/B 3.625 09/30/31	2,500,000.000	2,421,191.400	
US T N/B 3.625 10/31/30	8,200,000.000	7,994,519.560	

US T N/B 3.625 12/31/30	1,000,000.000	973,789.060	
US T N/B 3.75 01/31/31	4,500,000.000	4,403,320.290	
US T N/B 3.75 02/28/33	2,000,000.000	1,926,328.120	
US T N/B 3.75 04/15/28	3,000,000.000	2,979,492.180	
US T N/B 3.75 05/15/28	3,500,000.000	3,474,775.390	
US T N/B 3.75 05/31/30	2,200,000.000	2,161,242.180	
US T N/B 3.75 06/30/27	5,500,000.000	5,486,251.980	
US T N/B 3.75 06/30/30	2,500,000.000	2,454,248.050	
US T N/B 3.75 08/15/27	3,200,000.000	3,189,124.990	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	878,046.880	
US T N/B 3.75 08/31/31	3,500,000.000	3,411,542.960	
US T N/B 3.75 10/31/32	1,500,000.000	1,448,525.380	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	853,320.310	
US T N/B 3.75 11/30/32	3,000,000.000	2,895,292.980	
US T N/B 3.75 12/31/28	3,200,000.000	3,167,124.990	
US T N/B 3.75 12/31/30	2,390,000.000	2,339,539.260	
US T N/B 3.875 02/15/43	2,500,000.000	2,187,988.270	
US T N/B 3.875 03/15/28	1,000,000.000	995,703.120	
US T N/B 3.875 03/31/31	4,000,000.000	3,932,187.520	
US T N/B 3.875 04/15/29	4,500,000.000	4,462,910.140	
US T N/B 3.875 04/30/30	3,900,000.000	3,850,183.580	
US T N/B 3.875 04/30/31	2,500,000.000	2,456,835.950	
US T N/B 3.875 05/15/29	4,000,000.000	3,965,937.520	
US T N/B 3.875 05/15/43	1,900,000.000	1,658,789.070	
US T N/B 3.875 05/31/27	3,000,000.000	2,997,399.780	
US T N/B 3.875 06/15/28	2,500,000.000	2,487,011.710	
US T N/B 3.875 06/30/30	3,900,000.000	3,846,832.030	
US T N/B 3.875 07/15/28	4,400,000.000	4,375,250.000	
US T N/B 3.875 07/31/27	5,000,000.000	4,991,015.600	
US T N/B 3.875 07/31/30	3,000,000.000	2,958,339.840	
US T N/B 3.875 08/15/33	5,100,000.000	4,931,460.910	
US T N/B 3.875 08/15/34	3,500,000.000	3,358,154.310	
US T N/B 3.875 08/15/40	600,000.000	541,078.120	
US T N/B 3.875 08/31/32	4,200,000.000	4,090,652.320	
US T N/B 3.875 09/30/29	2,500,000.000	2,474,414.050	
US T N/B 3.875 09/30/32	5,500,000.000	5,353,046.870	
US T N/B 3.875 10/15/27	1,000,000.000	997,441.410	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,100,000.000	2,076,867.190	
US T N/B 3.875 12/31/27	2,800,000.000	2,790,046.860	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,500,000.000	2,471,191.400	
US T N/B 3.875 12/31/32	2,500,000.000	2,428,808.600	
US T N/B 4.0 01/31/29	3,600,000.000	3,583,687.490	
US T N/B 4.0 01/31/31	1,500,000.000	1,483,300.780	
US T N/B 4.0 01/31/33	4,000,000.000	3,911,796.880	
US T N/B 4.0 02/15/34	5,500,000.000	5,341,230.440	
US T N/B 4.0 02/28/30	5,100,000.000	5,060,554.660	
US T N/B 4.0 02/29/28	3,100,000.000	3,093,703.120	
US T N/B 4.0 03/31/30	2,000,000.000	1,983,906.240	
US T N/B 4.0 04/30/32	2,000,000.000	1,965,664.060	

US T N/B 4.0 05/31/30	2,000,000.000	1,982,617.180	
US T N/B 4.0 06/30/28	2,800,000.000	2,792,125.000	
US T N/B 4.0 06/30/32	2,000,000.000	1,963,632.820	
US T N/B 4.0 07/31/29	1,210,000.000	1,202,815.620	
US T N/B 4.0 07/31/30	2,500,000.000	2,476,855.470	
US T N/B 4.0 07/31/32	3,000,000.000	2,943,691.410	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,400,000.000	2,383,593.740	
US T N/B 4.0 11/15/35	4,100,000.000	3,934,078.120	
US T N/B 4.0 11/15/42	2,500,000.000	2,228,466.800	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,170,000.000	3,516,890.040	
US T N/B 4.0 12/15/27	1,500,000.000	1,497,832.030	
US T N/B 4.125 02/15/36	8,800,000.000	8,515,375.000	
US T N/B 4.125 02/29/32	2,500,000.000	2,475,244.150	
US T N/B 4.125 03/31/29	5,000,000.000	4,991,699.200	
US T N/B 4.125 03/31/31	1,753,000.000	1,741,735.600	
US T N/B 4.125 03/31/32	3,700,000.000	3,662,277.350	
US T N/B 4.125 05/31/32	2,700,000.000	2,669,677.720	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,600,000.000	2,598,679.680	
US T N/B 4.125 07/31/31	3,000,000.000	2,977,910.160	
US T N/B 4.125 08/15/44	2,000,000.000	1,785,234.370	
US T N/B 4.125 08/15/53	3,950,000.000	3,401,397.450	
US T N/B 4.125 08/31/30	2,500,000.000	2,487,548.820	
US T N/B 4.125 09/30/27	2,580,000.000	2,581,864.460	
US T N/B 4.125 10/31/27	1,500,000.000	1,500,615.240	
US T N/B 4.125 10/31/29	4,000,000.000	3,988,125.000	
US T N/B 4.125 10/31/31	2,500,000.000	2,478,515.620	
US T N/B 4.125 11/15/27	2,800,000.000	2,801,257.810	
US T N/B 4.125 11/15/32	4,200,000.000	4,142,906.240	
US T N/B 4.125 11/30/29	6,000,000.000	5,982,421.860	
US T N/B 4.125 11/30/31	2,500,000.000	2,478,076.170	
US T N/B 4.25 01/15/28	3,000,000.000	3,005,742.170	
US T N/B 4.25 01/31/30	3,700,000.000	3,702,457.020	
US T N/B 4.25 02/15/28	2,000,000.000	2,003,945.320	
US T N/B 4.25 02/15/54	3,800,000.000	3,341,921.850	
US T N/B 4.25 02/28/29	2,500,000.000	2,504,296.870	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,400,000.000	2,398,218.730	
US T N/B 4.25 03/31/33	2,000,000.000	1,983,437.500	
US T N/B 4.25 05/15/35	4,800,000.000	4,709,062.490	
US T N/B 4.25 05/15/39	600,000.000	573,046.860	
US T N/B 4.25 06/30/29	2,900,000.000	2,904,134.750	
US T N/B 4.25 06/30/31	2,500,000.000	2,496,533.200	
US T N/B 4.25 08/15/35	5,000,000.000	4,899,121.100	
US T N/B 4.25 08/15/54	4,700,000.000	4,134,714.830	
US T N/B 4.25 11/15/34	9,300,000.000	9,146,695.260	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	938,203.120	
US T N/B 4.375 01/31/32	2,500,000.000	2,506,982.420	
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	589,253.900	
US T N/B 4.375 05/15/34	4,100,000.000	4,077,578.120	
US T N/B 4.375 05/15/36	3,000,000.000	2,959,453.140	

US T N/B 4.375 05/15/40	1,300,000.000	1,242,820.300	
US T N/B 4.375 05/15/41	300,000.000	284,214.840	
US T N/B 4.375 07/15/27	2,400,000.000	2,409,281.250	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,700,000.000	2,508,152.330	
US T N/B 4.375 08/31/28	2,500,000.000	2,511,279.300	
US T N/B 4.375 11/15/39	760,000.000	729,926.550	
US T N/B 4.375 11/30/28	2,700,000.000	2,712,814.430	
US T N/B 4.375 11/30/30	2,600,000.000	2,612,035.160	
US T N/B 4.375 12/31/29	4,100,000.000	4,120,419.920	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,630,000.000	2,641,608.960	
US T N/B 4.5 02/15/44	1,000,000.000	940,703.120	
US T N/B 4.5 05/31/29	3,000,000.000	3,025,078.140	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,830,000.000	1,785,393.750	
US T N/B 4.5 11/15/33	6,100,000.000	6,126,925.760	
US T N/B 4.5 11/15/54	5,600,000.000	5,136,687.460	
US T N/B 4.5 12/31/31	2,500,000.000	2,523,046.870	
US T N/B 4.625 02/15/35	7,600,000.000	7,668,875.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	900,000.000	884,953.120	
US T N/B 4.625 02/15/46	1,500,000.000	1,420,898.430	
US T N/B 4.625 02/15/55	2,500,000.000	2,341,210.950	
US T N/B 4.625 04/30/29	3,500,000.000	3,540,947.270	
US T N/B 4.625 04/30/31	2,100,000.000	2,131,869.130	
US T N/B 4.625 05/15/44	1,000,000.000	954,257.810	
US T N/B 4.625 05/15/54	4,500,000.000	4,213,476.540	
US T N/B 4.625 05/31/31	8,500,000.000	8,628,994.130	
US T N/B 4.625 06/15/27	2,800,000.000	2,818,049.580	
US T N/B 4.625 09/30/28	1,500,000.000	1,515,117.180	
US T N/B 4.625 09/30/30	2,500,000.000	2,536,083.970	
US T N/B 4.625 11/15/44	1,400,000.000	1,332,132.810	
US T N/B 4.625 11/15/45	5,500,000.000	5,213,398.410	
US T N/B 4.625 11/15/55	1,500,000.000	1,406,015.620	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,400,000.000	1,385,398.430	
US T N/B 4.75 02/15/45	2,200,000.000	2,125,406.250	
US T N/B 4.75 02/15/56	2,300,000.000	2,201,351.560	
US T N/B 4.75 05/15/55	2,700,000.000	2,580,503.910	
US T N/B 4.75 08/15/55	2,400,000.000	2,294,625.000	
US T N/B 4.75 11/15/43	2,500,000.000	2,429,345.700	
US T N/B 4.75 11/15/53	4,230,000.000	4,036,593.140	
US T N/B 4.875 08/15/45	1,000,000.000	979,648.440	
US T N/B 4.875 10/31/28	9,300,000.000	9,446,583.990	
US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,561,181.650	
US T N/B 5.0 05/15/37	300,000.000	312,228.510	
US T N/B 5.0 05/15/45	1,000,000.000	995,937.500	
US T N/B 5.25 11/15/28	2,100,000.000	2,153,074.220	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,048,125.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,500,000.000	2,572,167.970	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,600,000.000	2,788,195.300	
アメリカ・ドル 小計	782,873,000.000 (125,737,232,530)	728,287,334.360 (116,970,228,770)	

イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/31/28	930,000.000	871,524.440	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,250,000.000	1,825,043.400	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,752,000.000	1,477,859.650	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,650,000.000	1,496,641.220	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	870,000.000	204,264.820	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,950,000.000	1,345,262.510	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,380,000.000	475,134.000	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,070,000.000	476,578.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,530,000.000	1,178,143.520	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,550,000.000	1,384,199.600	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	1,300,000.000	1,073,108.280	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,720,000.000	1,081,133.420	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	870,000.000	250,127.340	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,410,000.000	1,365,186.230	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	780,000.000	323,210.010	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,230,000.000	708,480.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	950,000.000	472,530.000	
	UK TREASURY 1.5 07/31/53	2,800,000.000	1,199,225.180	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,150,000.000	1,082,390.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,200,000.000	524,270.280	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	900,000.000	459,765.650	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	950,000.000	414,536.740	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,050,000.000	754,562.160	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,070,000.000	554,474.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,300,000.000	972,530.830	
	UK TREASURY 3.25 01/31/33	1,700,000.000	1,565,455.150	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,000,000.000	767,182.470	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	400,000.000	269,183.410	
	UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,050,000.000	923,567.520	

UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,120,000.000	836,372.340	
UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,670,000.000	1,233,823.050	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	970,000.000	739,237.000	
UK TREASURY 4.0 05/22/29	1,000,000.000	988,745.870	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	2,050,000.000	1,999,784.760	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,050,000.000	791,473.680	
UK TREASURY 4.125 03/07/31	1,000,000.000	985,072.520	
UK TREASURY 4.125 03/07/33	1,200,000.000	1,163,528.320	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	2,490,000.000	2,470,048.870	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,600,000.000	1,514,356.080	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,020,000.000	1,005,273.160	
UK TREASURY 4.25 07/31/34	1,600,000.000	1,541,376.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	835,120.670	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,090,000.000	1,090,043.700	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,040,000.000	930,787.110	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	730,000.000	615,357.280	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	950,000.000	786,060.910	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	821,443.710	
UK TREASURY 4.375 01/31/40	1,650,000.000	1,508,902.330	
UK TREASURY 4.375 03/07/28	2,220,000.000	2,220,850.030	
UK TREASURY 4.375 03/07/30	1,300,000.000	1,297,665.830	
UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,500,000.000	1,235,637.860	
UK TREASURY 4.5 03/07/35	2,630,000.000	2,562,840.090	
UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,230,000.000	1,233,356.780	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,750,000.000	1,716,428.260	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	880,000.000	793,276.000	
UK TREASURY 4.625 01/31/34	1,030,000.000	1,021,887.470	
UK TREASURY 4.625 03/07/37	1,300,000.000	1,254,060.100	
UK TREASURY 4.75 10/22/35	1,350,000.000	1,332,614.990	

	UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,990,000.000	1,829,307.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	1,726,247.820	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	530,000.000	509,860.000	
	UK TREASURY 4.875 07/31/36	930,000.000	921,122.770	
	UK TREASURY 5.25 01/31/41	800,000.000	794,404.690	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,100,000.000	1,144,891.880	
イギリス・ポンド 小計		84,172,000.000 (18,075,095,280)	68,946,829.260 (14,805,642,115)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,450,000.000	1,463,009.400	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	2,960,000.000	3,029,708.000	
	ISRAEL FIXED BOND 07/31/28	1,300,000.000	1,318,935.800	
	ISRAEL FIXED BOND 07/31/31	1,000,000.000	1,013,310.000	
	ISRAEL FIXED BOND 08/31/29	1,500,000.000	1,552,818.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,810,000.000	1,656,421.500	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	1,490,000.000	1,317,247.910	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,655,000.000	2,112,655.180	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,620,000.000	1,250,895.960	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,300,000.000	1,267,800.300	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,820,000.000	1,732,549.000	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	2,000,000.000	2,009,442.000	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,475,000.000	1,739,421.770	
イスラエル・シュケル 小計		22,380,000.000 (1,209,401,772)	21,464,214.820 (1,159,913,290)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,190,000.000	986,593.300	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	730,000.000	625,639.200	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,580,000.000	1,305,475.000	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,390,000.000	2,065,485.800	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,010,000.000	506,989.700	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,100,000.000	1,761,921.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	900,000.000	862,146.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,890,000.000	1,754,260.200	

	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	800,000.000	604,072.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	2,000,000.000	1,695,220.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,260,000.000	1,228,260.600	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,200,000.000	1,151,352.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,670,000.000	1,577,482.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	770,000.000	547,570.100	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,150,000.000	1,025,547.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,600,000.000	1,546,608.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	920,000.000	764,391.200	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,780,000.000	1,617,254.600	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	800,000.000	720,832.000	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,370,000.000	1,277,662.000	
	AUSTRALIAN 4.25 03/21/36	1,080,000.000	1,026,842.400	
	AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	580,000.000	559,479.600	
	AUSTRALIAN 4.25 10/21/36	750,000.000	709,965.000	
	AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	1,360,000.000	1,295,726.400	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	960,000.000	949,036.800	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	670,000.000	608,909.400	
	AUSTRALIAN 4.75 10/21/37	1,560,000.000	1,533,043.200	
オーストラリア・ドル 小計		34,070,000.000 (3,828,786,600)	30,307,764.500 (3,405,986,575)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.32 02/25/29	22,000,000.000	22,023,643.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.4 11/25/28	12,000,000.000	12,036,828.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28	53,000,000.000	53,158,576.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27	10,000,000.000	10,028,655.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30	54,000,000.000	54,128,412.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	30,000,000.000	30,118,275.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28	42,000,000.000	42,197,883.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.49 12/25/31	20,500,000.000	20,495,805.080	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.54 01/25/31	35,000,000.000	35,154,066.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.55 07/25/30	5,000,000.000	5,035,027.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35	38,000,000.000	37,751,693.180	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	63,500,000.000	63,832,492.350	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30	36,000,000.000	36,287,568.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.65 05/15/35	9,000,000.000	8,970,724.440	

CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 03/25/33	5,000,000.000	5,027,374.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.66 12/25/32	5,000,000.000	5,028,339.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 05/25/35	10,000,000.000	9,977,270.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.74 10/15/29	18,000,000.000	18,237,589.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.75 02/25/36	14,000,000.000	14,014,295.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32	39,000,000.000	39,563,511.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 11/15/35	11,000,000.000	11,040,143.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32	48,000,000.000	48,773,232.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.83 08/25/35	12,000,000.000	12,097,092.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	12,500,000.000	12,751,700.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	11,000,000.000	11,196,924.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.92 01/15/55	13,000,000.000	12,023,698.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 11/25/34	20,000,000.000	20,598,338.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	29,000,000.000	29,632,133.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	30,000,000.000	31,082,817.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	39,000,000.000	40,268,853.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	28,500,000.000	29,856,209.550	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	7,000,000.000	7,275,262.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	26,500,000.000	27,911,286.650	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	13,000,000.000	13,372,087.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.38 01/15/56	3,500,000.000	3,575,061.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	15,000,000.000	15,232,825.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28	7,500,000.000	7,718,275.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,500,000.000	20,775,417.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	5,000,000.000	5,321,881.500	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	22,500,000.000	23,615,795.250	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	20,500,000.000	21,121,873.650	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	14,500,000.000	15,427,462.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	11,000,000.000	11,544,689.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	10,500,000.000	10,781,353.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	12,220,000.000	12,820,087.540	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	7,590,000.000	7,914,392.040	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	32,100,000.000	34,549,621.620	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	39,000,000.000	40,934,052.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	10,500,000.000	11,195,647.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	5,000,000.000	5,347,094.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	8,400,000.000	8,769,472.320	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	2,300,000.000	2,463,382.110	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	8,000,000.000	8,411,100.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	13,000,000.000	13,562,383.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	29,500,000.000	31,138,489.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	3,000,000.000	3,236,994.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	36,000,000.000	36,656,337.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	15,000,000.000	16,327,869.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	7,000,000.000	7,538,036.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	42,000,000.000	43,711,873.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	14,500,000.000	16,690,432.350	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	12,000,000.000	12,444,000.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	6,800,000.000	7,926,355.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	7,600,000.000	8,989,128.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	13,500,000.000	13,961,843.100	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	6,900,000.000	8,318,009.340	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	19,000,000.000	22,843,580.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	9,000,000.000	11,185,265.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.69 05/17/28	10,000,000.000	10,539,685.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	5,800,000.000	7,379,213.560	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	15,000,000.000	19,238,316.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	15,800,000.000	20,272,242.140	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	4,000,000.000	5,284,798.000	
オフショア・人民元 小計		1,362,510,000.000 (32,259,331,764)	1,415,712,144.820 (33,518,967,026)	
カナダ・ドル	CANADA 0.5 12/01/30	2,070,000.000	1,847,823.350	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,140,000.000	1,122,889.630	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,720,000.000	1,603,910.890	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,530,000.000	1,414,691.310	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,250,000.000	1,144,443.250	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,650,000.000	1,059,086.760	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,030,000.000	1,013,794.690	
	CANADA 2.0 06/01/32	900,000.000	840,214.260	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,860,000.000	1,298,555.540	
	CANADA 2.25 02/01/28	1,200,000.000	1,189,630.230	
	CANADA 2.25 06/01/29	940,000.000	921,895.400	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,000,000.000	975,431.660	
	CANADA 2.5 05/01/28	1,900,000.000	1,888,494.050	
	CANADA 2.5 11/01/27	300,000.000	299,024.050	
	CANADA 2.5 12/01/32	2,000,000.000	1,910,825.850	
	CANADA 2.75 03/01/30	1,000,000.000	989,619.530	
	CANADA 2.75 03/01/31	1,900,000.000	1,868,334.640	
	CANADA 2.75 06/01/33	400,000.000	386,203.720	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,100,000.000	1,100,893.660	
	CANADA 2.75 09/01/30	630,000.000	621,482.220	
	CANADA 2.75 12/01/48	700,000.000	587,928.740	
	CANADA 2.75 12/01/55	1,460,000.000	1,172,108.900	
	CANADA 2.75 12/01/64	1,060,000.000	821,174.320	
	CANADA 3.0 03/01/32	500,000.000	494,822.760	
	CANADA 3.0 06/01/34	1,570,000.000	1,528,768.600	
	CANADA 3.25 06/01/35	2,150,000.000	2,117,708.030	
	CANADA 3.25 06/01/36	1,000,000.000	977,445.270	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,650,000.000	1,663,041.400	
	CANADA 3.25 12/01/34	1,570,000.000	1,551,656.270	

	CANADA 3.25 12/01/35	2,650,000.000	2,600,087.630	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,500,000.000	1,517,524.800	
	CANADA 3.5 03/01/34	700,000.000	706,795.790	
	CANADA 3.5 09/01/29	1,400,000.000	1,421,373.680	
	CANADA 3.5 12/01/45	650,000.000	626,801.740	
	CANADA 3.5 12/01/57	810,000.000	754,919.580	
	CANADA 4.0 03/01/29	2,090,000.000	2,147,730.230	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	590,747.180	
	CANADA 5.0 06/01/37	750,000.000	847,564.050	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,050,000.000	1,133,151.700	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,000,000.000	1,150,792.440	
カナダ・ドル 小計		50,350,000.000 (5,799,816,500)	47,909,387.800 (5,518,682,381)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 07/01/31	240,000.000	237,239.870	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	310,000.000	299,769.870	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	260,000.000	251,939.900	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	660,000.000	669,599.700	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	540,000.000	555,390.000	
	SINGAPORE 2.5 04/01/30	420,000.000	431,717.740	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	230,000.000	234,530.930	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	350,000.000	363,299.850	
	SINGAPORE 2.75 03/01/35	180,000.000	189,809.960	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	490,000.000	544,563.950	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	430,000.000	468,699.900	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	230,000.000	237,819.880	
	SINGAPORE 2.875 08/01/28	830,000.000	851,999.150	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	700,000.000	731,619.000	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	300,000.000	310,799.880	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	407,000.000	502,441.500	
	SINGAPORE 3.25 06/01/54	240,000.000	298,772.400	
	SINGAPORE 3.375 05/01/34	100,000.000	109,449.960	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	450,000.000	489,914.860	
シンガポール・ドル 小計		7,367,000.000 (918,812,240)	7,779,378.300 (970,244,062)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,200,000.000	3,740,431.960	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,560,000.000	4,426,366.720	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	4,540,000.000	4,293,453.030	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	3,720,000.000	3,489,732.000	
	SWEDEN 2.25 05/11/35	2,850,000.000	2,735,617.210	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,120,000.000	2,080,250.000	
	SWEDEN 2.5 10/15/36	2,650,000.000	2,564,736.250	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,420,000.000	3,627,332.690	
スウェーデン・クローナ 小計		28,060,000.000 (474,214,000)	26,957,919.860 (455,588,846)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	2,510,000.000	2,183,581.020	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,110,000.000	1,972,230.210	

	DENMARK 0.5 11/15/27	2,850,000.000	2,777,952.000	
	DENMARK 0.5 11/15/29	1,940,000.000	1,815,262.290	
	DENMARK 2.0 11/15/28	1,300,000.000	1,286,675.670	
	DENMARK 2.25 11/15/33	2,400,000.000	2,320,132.430	
	DENMARK 2.25 11/15/35	3,100,000.000	2,931,360.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	4,970,000.000	5,761,365.130	
デンマーク・クローネ 小計		23,180,000.000 (574,864,000)	21,048,558.750 (522,004,257)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,440,000.000	1,354,085.950	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	920,000.000	816,132.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	310,000.000	207,231.260	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	807,238.970	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	570,000.000	479,052.350	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	250,000.000	166,994.650	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	450,000.000	441,731.560	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	960,000.000	917,099.960	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	920,000.000	913,625.520	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	470,000.000	459,237.000	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	540,000.000	552,406.870	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	370,000.000	371,369.480	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	490,000.000	480,436.540	
ニュージーランド・ドル 小計		8,600,000.000 (800,832,000)	7,966,642.110 (741,853,713)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,270,000.000	1,938,813.390	
	NORWAY 1.375 08/19/30	2,910,000.000	2,572,292.310	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,570,000.000	3,272,000.450	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,860,000.000	2,727,010.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,850,000.000	2,517,650.580	
	NORWAY 3.0 08/15/33	3,390,000.000	3,116,563.400	
	NORWAY 3.5 10/06/42	1,630,000.000	1,462,191.500	
	NORWAY 3.625 04/13/34	2,890,000.000	2,754,271.150	
	NORWAY 3.625 05/31/39	2,300,000.000	2,128,743.150	
	NORWAY 3.75 06/12/35	1,549,000.000	1,479,626.650	
ノルウェー・クローネ 小計	NORWAY 4.125 06/03/36	1,300,000.000	1,273,740.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,519,000.000 (466,997,430)	25,242,902.580 (428,372,057)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 01/25/28	2,300,000.000	2,148,152.410	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,970,000.000	2,541,868.430	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,350,000.000	2,766,128.100	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,550,000.000	2,506,622.830	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,060,000.000	2,001,328.940	
	POLAND 2.75 10/25/29	3,000,000.000	2,812,793.840	

	POLAND 4.0 07/25/31	4,200,000.000	3,969,422.940	
	POLAND 4.5 01/25/31	1,300,000.000	1,269,166.970	
	POLAND 4.5 07/25/30	2,750,000.000	2,700,847.500	
	POLAND 4.75 07/25/29	4,550,000.000	4,548,180.000	
	POLAND 5.0 01/25/30	3,100,000.000	3,113,868.470	
	POLAND 5.0 10/25/34	2,630,000.000	2,537,160.800	
	POLAND 5.0 10/25/35	3,450,000.000	3,294,061.850	
	POLAND 5.75 04/25/29	500,000.000	514,072.900	
	POLAND 6.0 10/25/33	4,100,000.000	4,236,441.840	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,750,000.000	2,909,972.170	
ポーランド・ズロチ 小計		45,560,000.000 (1,986,484,340)	43,870,089.990 (1,912,801,729)	
マレーシア・リングット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,927,577.500	
	MALAYSIA 3.336 05/15/30	1,000,000.000	998,815.010	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,200,000.000	1,204,381.200	
	MALAYSIA 3.519 04/20/28	800,000.000	804,753.040	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	900,000.000	903,215.970	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,073,000.000	2,093,446.410	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	700,000.000	686,772.520	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,000,000.000	1,016,764.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,051,000.000	1,068,315.530	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,530,000.000	1,558,999.460	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,500,000.000	1,515,863.850	
	MALAYSIA 3.917 07/15/55	400,000.000	387,980.650	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	1,888,000.000	1,920,534.200	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,050,000.000	1,054,119.780	
	MALAYSIA 4.18 05/16/44	1,000,000.000	1,032,480.500	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	800,000.000	829,094.960	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,050,000.000	1,101,407.260	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	2,120,000.000	2,255,421.780	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,100,000.000	1,143,955.230	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	520,000.000	537,458.580	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,520,000.000	1,620,745.440	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	600,000.000	657,008.520	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	1,200,000.000	1,318,820.400	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,400,000.000	1,520,554.970	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,930,000.000	2,129,958.030	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	810,000.000	917,039.710	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	950,000.000	1,069,635.300	
マレーシア・リングット 小計		32,092,000.000 (1,264,325,315)	33,275,120.600 (1,310,936,599)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 02/21/36	5,000,000.000	4,635,400.000	
	MEXICAN BONDS 02/28/30	35,000,000.000	35,126,945.350	
	MEXICAN BONDS 03/01/29	26,000,000.000	26,334,714.380	
	MEXICAN BONDS 03/02/28	7,000,000.000	7,119,490.000	
	MEXICAN BONDS 04/15/32	11,000,000.000	10,594,493.470	
	MEXICAN BONDS 04/29/55	5,400,000.000	4,546,724.290	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	2,000,000.000	1,851,859.460	

	MEXICAN BONDS 05/26/33	33,140,000.000	30,779,927.920	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	22,690,000.000	19,159,530.390	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	11,700,000.000	12,395,135.950	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,730,000.000	18,825,633.880	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	25,100,000.000	24,288,712.770	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	27,070,000.000	23,006,153.860	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	15,991,000.000	14,758,647.980	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	12,996,000.000	11,104,503.020	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	5,201,000.000	5,259,244.950	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	9,400,000.000	8,781,111.700	
メキシコ・ペソ 小計		273,418,000.000 (2,523,538,773)	258,568,229.370 (2,386,481,330)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	500,000.000	450,912.370	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,330,000.000	1,162,136.620	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	950,000.000	891,066.750	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	462,308.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	450,000.000	329,085.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	600,000.000	565,172.240	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	670,000.000	648,303.720	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	650,000.000	335,204.310	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	350,000.000	106,911.000	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	840,000.000	749,292.600	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	332,929.030	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	70,770.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	200,000.000	142,022.500	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	228,685.470	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,110,000.000	1,051,556.280	
	AUSTRIA 2.5 10/20/29	500,000.000	494,836.500	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,100,000.000	1,088,646.900	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34	380,000.000	373,540.000	
	AUSTRIA 2.9 05/23/29	300,000.000	301,152.750	
	AUSTRIA 2.95 02/20/35	700,000.000	684,880.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	670,000.000	623,804.500	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	320,000.000	283,836.800	
	AUSTRIA 3.2 02/20/36	350,000.000	346,640.000	
	AUSTRIA 3.2 07/15/39	300,000.000	290,010.000	
	AUSTRIA 3.45 10/20/30	400,000.000	409,120.000	
	AUSTRIA 3.75 03/20/56	400,000.000	392,080.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	280,000.000	277,944.100	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	700,000.000	750,047.550	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	580,000.000	602,178.620	

BELGIUM 0.0 10/22/27	750,000.000	722,979.050	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,000,000.000	848,918.170	
BELGIUM 0.1 06/22/30	650,000.000	580,125.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,000,000.000	846,700.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	480,000.000	297,711.060	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	256,843.060	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,350,000.000	1,294,785.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	950,000.000	897,071.170	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,000,000.000	905,240.400	
BELGIUM 1.25 04/22/33	1,000,000.000	880,682.350	
BELGIUM 1.4 06/22/53	770,000.000	408,688.880	
BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	399,316.330	
BELGIUM 1.6 06/22/47	420,000.000	266,432.460	
BELGIUM 1.7 06/22/50	580,000.000	353,691.650	
BELGIUM 1.9 06/22/38	1,400,000.000	1,146,073.880	
BELGIUM 2.15 06/22/66	530,000.000	306,446.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	450,000.000	285,138.900	
BELGIUM 2.6 10/22/30	500,000.000	491,658.170	
BELGIUM 2.7 10/22/29	900,000.000	894,401.960	
BELGIUM 2.75 04/22/39	750,000.000	667,919.960	
BELGIUM 2.85 10/22/34	700,000.000	670,668.580	
BELGIUM 3.0 06/22/33	850,000.000	835,852.570	
BELGIUM 3.0 06/22/34	640,000.000	623,147.400	
BELGIUM 3.1 06/22/35	1,900,000.000	1,839,903.570	
BELGIUM 3.3 06/22/54	390,000.000	320,695.330	
BELGIUM 3.45 06/22/43	500,000.000	459,860.250	
BELGIUM 3.5 06/22/55	420,000.000	356,094.310	
BELGIUM 3.75 06/22/45	500,000.000	472,152.860	
BELGIUM 4.0 03/28/32	350,000.000	366,151.730	
BELGIUM 4.25 03/28/41	530,000.000	545,853.300	
BELGIUM 5.0 03/28/35	780,000.000	868,973.500	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,360,000.000	1,424,410.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,660,000.000	1,630,933.400	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	500,000.000	491,350.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,000,000.000	983,950.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	1,340,000.000	1,328,409.000	
BUNDESOBL 2.2 10/10/30	2,200,000.000	2,149,466.000	
BUNDESOBL 2.4 04/18/30	1,700,000.000	1,678,665.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	1,350,000.000	1,341,022.500	
BUNDESOBL 2.5 10/11/29	1,000,000.000	992,950.000	
BUNDESSCHAT 2.0 12/16/27	800,000.000	791,912.000	
BUNDESSCHAT 2.1 03/15/28	1,300,000.000	1,286,675.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,100,000.000	996,534.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,200,000.000	1,056,768.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,280,000.000	1,093,239.900	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,570,000.000	1,200,783.100	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,500,000.000	1,107,060.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,150,000.000	1,027,697.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,620,000.000	1,448,101.800	

DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,400,000.000	1,214,346.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	900,000.000	781,085.250	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,807,000.000	770,269.890	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,560,000.000	666,572.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,249,000.000	891,706.010	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,156,380.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	1,250,000.000	1,172,687.500	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,400,000.000	2,251,620.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	950,000.000	902,300.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,210,000.000	1,167,710.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,770,000.000	1,727,086.900	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,950,000.000	1,792,328.850	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	550,000.000	428,857.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,070,000.000	1,344,310.250	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,250,000.000	1,170,100.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,770,000.000	1,221,795.600	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,000,000.000	692,930.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,600,000.000	1,567,440.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	1,300,000.000	1,233,037.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,060,000.000	1,022,136.800	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,900,000.000	1,832,265.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	1,700,000.000	1,673,905.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,800,000.000	1,730,070.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,200,000.000	1,153,968.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,350,000.000	1,172,799.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,130,000.000	1,818,441.700	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	1,300,000.000	1,048,892.000	
DEUTSCHLAND 2.5 11/15/32	1,200,000.000	1,173,468.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,250,000.000	1,133,175.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,000,000.000	907,940.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	1,410,000.000	1,380,460.500	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,600,000.000	1,555,824.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/35	1,400,000.000	1,350,790.000	
DEUTSCHLAND 2.9 02/15/36	1,600,000.000	1,577,200.000	
DEUTSCHLAND 2.9 08/15/56	950,000.000	827,915.500	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,350,000.000	1,319,746.500	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,150,000.000	1,240,326.750	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,040,000.000	2,246,733.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,700,000.000	2,811,213.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,480,000.000	1,669,573.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,120,000.000	1,296,052.800	

DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,490,000.000	1,662,154.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,300,000.000	1,358,097.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	700,000.000	782,586.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,220,000.000	1,268,970.800	
FINLAND 0.0 09/15/30	280,000.000	247,701.860	
FINLAND 0.125 04/15/36	80,000.000	58,330.160	
FINLAND 0.125 04/15/52	206,000.000	80,248.430	
FINLAND 0.125 09/15/31	400,000.000	344,751.800	
FINLAND 0.25 09/15/40	450,000.000	279,646.980	
FINLAND 0.5 04/15/43	140,000.000	83,127.480	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	486,444.500	
FINLAND 0.5 09/15/28	220,000.000	209,330.550	
FINLAND 0.5 09/15/29	280,000.000	259,893.200	
FINLAND 0.75 04/15/31	300,000.000	270,427.350	
FINLAND 1.125 04/15/34	400,000.000	342,678.400	
FINLAND 1.375 04/15/47	300,000.000	193,719.000	
FINLAND 1.5 09/15/32	550,000.000	500,824.080	
FINLAND 2.5 04/15/30	450,000.000	443,722.500	
FINLAND 2.625 07/04/42	560,000.000	485,803.640	
FINLAND 2.75 04/15/38	600,000.000	555,491.540	
FINLAND 2.875 04/15/29	750,000.000	751,275.000	
FINLAND 2.95 04/15/55	250,000.000	206,525.000	
FINLAND 3.0 09/15/33	370,000.000	366,358.900	
FINLAND 3.0 09/15/34	850,000.000	834,608.200	
FINLAND 3.0 09/15/35	200,000.000	194,620.000	
FINLAND 3.2 04/15/45	210,000.000	192,465.000	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,150,000.000	1,771,170.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,800,000.000	3,433,035.900	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,280,000.000	1,990,303.740	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,900,000.000	3,279,424.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,480,000.000	3,243,638.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,010,000.000	1,247,189.920	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	980,000.000	247,450.980	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,520,000.000	808,105.720	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,530,000.000	2,443,110.300	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,000,000.000	3,842,512.910	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,350,000.000	1,018,806.070	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,350,000.000	566,419.310	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,390,000.000	2,270,447.420	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	950,000.000	799,908.570	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,290,000.000	1,021,680.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	1,100,000.000	817,080.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,270,000.000	3,024,641.590	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	770,000.000	439,117.330	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	450,000.000	222,453.900	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,510,000.000	1,938,949.900	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,600,000.000	1,064,805.990	

FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,961,000.000	1,807,705.680	
FRANCE OAT 2.4 09/24/28	1,900,000.000	1,879,845.750	
FRANCE OAT 2.4 09/24/29	2,300,000.000	2,260,900.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,130,000.000	3,068,399.660	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,300,000.000	1,028,878.500	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	3,300,000.000	3,288,199.200	
FRANCE OAT 2.7 02/25/31	1,900,000.000	1,863,561.800	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	1,850,000.000	1,841,822.630	
FRANCE OAT 2.75 02/25/30	2,800,000.000	2,773,624.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,090,000.000	3,087,695.040	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,800,000.000	3,699,256.300	
FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,608,000.000	1,220,579.330	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	1,700,000.000	1,357,110.000	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	2,800,000.000	2,676,633.190	
FRANCE OAT 3.2 05/25/35	2,200,000.000	2,122,250.900	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,500,000.000	1,300,483.120	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	3,200,000.000	3,200,164.800	
FRANCE OAT 3.5 11/25/35	5,800,000.000	5,692,120.000	
FRANCE OAT 3.6 05/25/42	1,900,000.000	1,767,190.000	
FRANCE OAT 3.75 05/25/56	1,470,000.000	1,274,557.620	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,150,000.000	1,051,562.580	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,470,000.000	1,324,508.580	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,900,000.000	2,907,825.650	
FRANCE OAT 4.1 05/25/46	930,000.000	903,402.000	
FRANCE OAT 4.4 05/25/57	1,000,000.000	970,300.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,510,000.000	1,573,963.600	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,280,000.000	2,468,220.840	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,090,000.000	3,306,089.260	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,810,000.000	2,057,743.750	
IRISH 0.0 10/18/31	430,000.000	369,623.260	
IRISH 0.2 10/18/30	480,000.000	429,353.520	
IRISH 0.35 10/18/32	230,000.000	195,454.000	
IRISH 0.4 05/15/35	280,000.000	220,633.840	
IRISH 0.55 04/22/41	260,000.000	171,784.270	
IRISH 0.9 05/15/28	370,000.000	357,915.360	
IRISH 1.1 05/15/29	250,000.000	238,553.810	
IRISH 1.3 05/15/33	550,000.000	492,536.000	
IRISH 1.35 03/18/31	480,000.000	448,940.420	
IRISH 1.5 05/15/50	535,000.000	351,565.670	
IRISH 1.7 05/15/37	450,000.000	384,334.420	
IRISH 2.0 02/18/45	360,000.000	282,742.560	
IRISH 2.4 05/15/30	560,000.000	551,807.120	
IRISH 2.6 10/18/34	450,000.000	433,611.100	
IRISH 3.0 10/18/43	300,000.000	278,374.500	
IRISH 3.1 06/18/36	400,000.000	395,333.600	
IRISH 3.15 10/18/55	190,000.000	169,325.910	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	230,000.000	219,926.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	700,000.000	655,480.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	800,000.000	762,000.000	

ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,900,000.000	1,664,981.870	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,650,000.000	1,482,829.830	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,100,000.000	818,620.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	550,000.000	479,490.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,600,000.000	1,466,560.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,600,000.000	1,564,640.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,149,476.900	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,400,000.000	1,314,923.740	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,332,000.000	1,079,985.600	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	440,000.000	279,268.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,200,000.000	1,096,885.800	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,850,000.000	1,734,690.420	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	750,000.000	435,267.750	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,500,000.000	1,109,100.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,150,000.000	1,135,610.050	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,000,000.000	992,630.450	
ITALY BTPS 2.1 08/26/27	900,000.000	892,800.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	400,000.000	255,520.000	
ITALY BTPS 2.2 02/28/28	1,500,000.000	1,483,650.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,000,000.000	867,800.000	
ITALY BTPS 2.35 01/15/29	600,000.000	591,060.000	
ITALY BTPS 2.4 03/15/29	1,700,000.000	1,674,500.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,000,000.000	933,739.500	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,190,000.000	832,762.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	500,000.000	473,800.000	
ITALY BTPS 2.65 06/15/28	1,200,000.000	1,194,360.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,200,000.000	1,197,600.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,130,000.000	869,535.000	
ITALY BTPS 2.7 10/01/30	1,100,000.000	1,080,090.000	
ITALY BTPS 2.7 10/15/27	850,000.000	848,980.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	750,000.000	516,900.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.000	994,600.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	900,000.000	898,318.450	
ITALY BTPS 2.85 02/01/31	800,000.000	787,440.000	
ITALY BTPS 2.95 07/01/30	600,000.000	596,040.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,280,000.000	1,149,184.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,300,000.000	1,301,342.510	
ITALY BTPS 3.0 10/01/29	1,500,000.000	1,498,275.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	500,000.000	447,505.000	
ITALY BTPS 3.15 03/15/33	1,000,000.000	980,300.000	
ITALY BTPS 3.15 11/15/31	1,400,000.000	1,389,920.000	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	1,430,000.000	1,333,761.000	
ITALY BTPS 3.25 07/15/32	700,000.000	694,400.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	300,000.000	254,193.820	
ITALY BTPS 3.25 11/15/32	1,000,000.000	989,200.000	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,700,000.000	1,659,140.920	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	950,000.000	958,835.000	
ITALY BTPS 3.45 02/01/36	1,900,000.000	1,845,660.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,180,000.000	1,020,351.300	

ITALY BTPS 3.45 07/15/27	500,000.000	503,850.000	
ITALY BTPS 3.45 07/15/31	1,800,000.000	1,816,920.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.000	1,012,500.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	740,000.000	751,731.960	
ITALY BTPS 3.6 10/01/35	1,600,000.000	1,578,720.000	
ITALY BTPS 3.65 08/01/35	900,000.000	893,070.000	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,110,000.000	1,134,087.000	
ITALY BTPS 3.8 07/01/36	500,000.000	498,000.000	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	1,000,000.000	1,018,500.000	
ITALY BTPS 3.85 02/01/35	1,200,000.000	1,212,240.000	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	500,000.000	507,250.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	776,475.000	
ITALY BTPS 3.85 10/01/40	1,400,000.000	1,352,120.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,450,000.000	1,487,845.000	
ITALY BTPS 3.95 10/01/41	850,000.000	822,970.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,000,000.000	1,022,800.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,350,000.000	1,398,195.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	700,000.000	723,520.000	
ITALY BTPS 4.05 10/30/37	650,000.000	656,630.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	1,000,000.000	1,028,600.000	
ITALY BTPS 4.1 04/30/46	600,000.000	576,900.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	1,100,000.000	1,105,830.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,000,000.000	1,040,700.000	
ITALY BTPS 4.3 10/01/54	950,000.000	908,580.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	930,000.000	977,709.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	940,000.000	992,922.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	900,000.000	915,840.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	750,000.000	742,950.000	
ITALY BTPS 4.65 10/01/55	450,000.000	453,240.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,400,000.000	1,455,627.600	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	750,000.000	791,785.500	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	430,000.000	471,323.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	860,000.000	942,302.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,710,000.000	1,870,398.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,890,000.000	2,025,513.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,320,000.000	1,498,596.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,091,832.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,470,000.000	1,543,059.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,100,000.000	1,025,904.820	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,250,000.000	854,823.750	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,300,000.000	524,271.800	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,000,000.000	892,987.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	380,000.000	329,025.370	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	700,000.000	648,902.100	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	447,000.000	307,426.030	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	500,000.000	433,550.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	400,000.000	392,052.500	

NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,360,000.000	1,307,079.000	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	890,000.000	643,903.720	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	550,000.000	544,650.830	
NETHERLANDS 2.5 01/15/31	800,000.000	789,120.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,520,000.000	1,479,407.120	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	1,000,000.000	968,769.740	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	500,000.000	480,150.000	
NETHERLANDS 2.5 07/15/35	700,000.000	666,050.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,030,000.000	909,194.390	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	470,000.000	454,491.690	
NETHERLANDS 3.5 01/15/56	450,000.000	441,765.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,030,000.000	1,064,591.620	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,300,000.000	1,389,700.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	520,000.000	544,076.000	
PORTUGUESE 0.3 10/17/31	100,000.000	87,103.670	
PORTUGUESE 0.475 10/18/30	350,000.000	316,326.960	
PORTUGUESE 0.7 10/15/27	200,000.000	195,034.000	
PORTUGUESE 0.9 10/12/35	300,000.000	241,555.500	
PORTUGUESE 1.0 04/12/52	280,000.000	145,410.640	
PORTUGUESE 1.15 04/11/42	300,000.000	205,799.250	
PORTUGUESE 1.65 07/16/32	850,000.000	785,891.190	
PORTUGUESE 1.95 06/15/29	1,000,000.000	978,500.000	
PORTUGUESE 2.125 10/17/28	950,000.000	938,548.080	
PORTUGUESE 2.25 04/18/34	50,000.000	46,655.550	
PORTUGUESE 2.875 10/14/33	500,000.000	489,550.000	
PORTUGUESE 2.875 10/20/34	200,000.000	194,219.400	
PORTUGUESE 3.0 06/15/35	380,000.000	370,229.020	
PORTUGUESE 3.25 06/13/36	300,000.000	295,011.000	
PORTUGUESE 3.5 06/18/38	370,000.000	366,049.880	
PORTUGUESE 3.625 06/12/54	480,000.000	443,616.000	
PORTUGUESE 3.875 02/15/30	550,000.000	570,707.500	
PORTUGUESE 4.1 02/15/45	450,000.000	460,350.000	
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	630,000.000	663,846.870	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.0 10/09/30	500,000.000	456,750.000	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.0 10/13/51	250,000.000	124,041.500	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.625 01/16/29	300,000.000	304,981.680	

SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/23/35	800,000.000	810,708.960	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 3.75 02/27/40	510,000.000	492,711.000	
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 4.0 10/19/32	500,000.000	521,596.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,850,000.000	1,771,116.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,490,000.000	1,296,747.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,600,000.000	2,375,603.750	
SPAIN 0.5 10/31/31	2,100,000.000	1,840,059.900	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,280,000.000	1,188,569.600	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,354,069.350	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,650,000.000	1,615,300.500	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	939,550.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,160,000.000	866,770.560	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,150,000.000	750,835.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	930,000.000	487,313.560	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,000,000.000	711,520.540	
SPAIN 1.25 10/31/30	769,000.000	717,630.800	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,200,000.000	1,171,025.370	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,700,000.000	1,653,590.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	730,000.000	703,263.680	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,000,000.000	983,192.670	
SPAIN 1.45 10/31/71	674,000.000	304,417.530	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,800,000.000	1,581,119.420	
SPAIN 1.9 10/31/52	730,000.000	467,613.010	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,407,323.140	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,610,000.000	1,520,001.000	
SPAIN 2.4 05/31/28	1,100,000.000	1,092,124.000	
SPAIN 2.5 05/31/27	1,450,000.000	1,447,056.500	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,200,000.000	1,159,934.080	
SPAIN 2.6 05/31/31	700,000.000	685,615.000	
SPAIN 2.7 01/31/30	1,200,000.000	1,191,840.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,300,000.000	1,039,344.310	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,220,000.000	1,028,423.690	
SPAIN 3.0 01/31/33	800,000.000	790,720.000	
SPAIN 3.1 07/30/31	1,200,000.000	1,204,816.440	
SPAIN 3.15 04/30/33	1,000,000.000	996,609.770	
SPAIN 3.15 04/30/35	1,000,000.000	979,807.010	
SPAIN 3.2 10/31/35	1,200,000.000	1,174,800.000	
SPAIN 3.25 04/30/34	1,450,000.000	1,442,416.500	
SPAIN 3.3 04/30/36	600,000.000	589,619.650	
SPAIN 3.45 07/30/43	800,000.000	747,960.190	
SPAIN 3.45 07/30/66	890,000.000	757,040.230	
SPAIN 3.45 10/31/34	1,300,000.000	1,307,307.950	
SPAIN 3.5 01/31/41	700,000.000	670,590.370	
SPAIN 3.5 05/31/29	1,350,000.000	1,375,716.820	
SPAIN 3.55 10/31/33	1,720,000.000	1,750,788.000	
SPAIN 3.9 07/30/39	1,200,000.000	1,215,636.840	

	SPAIN 3.95 10/31/56	700,000.000	664,888.250	
	SPAIN 4.0 10/31/54	500,000.000	483,581.350	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,180,000.000	1,244,139.490	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,000,000.000	1,094,262.700	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,080,000.000	1,205,604.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,004,595.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,200,000.000	1,381,512.600	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,100,000.000	1,261,433.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	800,000.000	864,875.760	
ユーロ 小計		441,908,000.000 (81,903,228,720)	405,889,015.200 (75,227,470,077)	
韓国・ウォン	KOREA TREASURY BOND (TAX) 3.75 12/10/33	800,000,000.000	776,044,808.000	
	KOREA TREASURY BOND (TAX) 4.0 12/10/31	500,000,000.000	495,831,200.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.125 09/10/39	1,000,000,000.000	681,145,860.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.375 06/10/30	800,000,000.000	720,934,496.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.375 12/10/29	1,100,000,000.000	1,006,257,868.000	
	KOREA TREASURY BOND 1.5 03/10/50	2,030,000,000.000	1,171,064,715.100	
	KOREA TREASURY BOND 2.0 06/10/31	500,000,000.000	451,864,065.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.25 06/10/28	700,000,000.000	679,522,557.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.375 12/10/28	1,800,000,000.000	1,736,592,066.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.625 03/10/48	500,000,000.000	377,155,795.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.625 09/10/55	2,350,000,000.000	1,690,062,378.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.75 09/10/45	500,000,000.000	395,704,360.000	
	KOREA TREASURY BOND 2.875 09/10/44	500,000,000.000	405,014,020.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.0 12/10/34	700,000,000.000	638,948,478.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/29	1,700,000,000.000	1,670,501,770.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 03/10/54	630,000,000.000	516,909,380.400	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 09/10/42	500,000,000.000	435,140,010.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.25 12/10/35	700,000,000.000	644,989,163.000	
	KOREA TREASURY BOND 3.375 03/10/31	1,000,000,000.000	970,281,420.000	

		KOREA TREASURY BOND 3.5 03/10/56	1,780,000,000.000	1,536,798,333.000	
		KOREA TREASURY BOND 4.25 12/10/32	500,000,000.000	501,109,150.000	
	韓国・ウォン 小計		20,590,000,000.000 (2,167,221,040)	17,501,871,892.500 (1,842,177,028)	
国債証券 合計			279,990,182,303.600 (279,990,182,304)	261,177,349,855 (261,177,349,855)	
合計				261,177,349,855 (261,177,349,855)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 283銘柄	44.41	44.79
イギリス・ポンド	国債証券 64銘柄	5.62	5.67
イスラエル・シュケル	国債証券 13銘柄	0.44	0.44
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.29	1.30
オフショア・人民元	国債証券 73銘柄	12.73	12.83
カナダ・ドル	国債証券 40銘柄	2.10	2.11
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.37	0.37
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.17	0.17
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.20	0.20
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.28	0.28
ノルウェー・クローネ	国債証券 11銘柄	0.16	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	0.73	0.73
マレーシア・リンギット	国債証券 27銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券 17銘柄	0.91	0.91
ユーロ	国債証券 402銘柄	28.56	28.80
韓国・ウォン	国債証券 21銘柄	0.70	0.71

(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6月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	280,539,911
コール・ローン	118,963,778
投資信託受益証券	13,510,840,653
投資証券	123,236,500,534
派生商品評価勘定	18,532,788
未収入金	7,721,292
未収配当金	183,156,485
差入委託証拠金	621,368,437
流動資産合計	137,977,623,878
資産合計	137,977,623,878
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	87,206
未払解約金	129,155,000
流動負債合計	129,242,206
負債合計	129,242,206
純資産の部	
元本等	
元本	51,792,211,949
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	86,056,169,723
元本等合計	137,848,381,672
純資産合計	137,848,381,672
負債純資産合計	137,977,623,878

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11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。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	49,470,812,960円
同期中追加設定元本額	11,351,912,175円
同期中一部解約元本額	9,030,513,186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＞	5,504,267,809円
たわらノーロード 先進国リート	17,581,647,061円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	218,934,130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）	27,251,654円
たわらノーロード バランス（標準型）	775,863,994円
たわらノーロード バランス（積極型）	2,212,143,613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）	46,076,904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）	725,899,836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）	901,189,809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）	1,508,171,652円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,300,223円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	58,059,593円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	30,135,380円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,109,162円
One DC 先進国リートインデックスファンド	4,896,555,724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
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	174,621,042円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	315,178,721円
D I A M 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	3,724,718,167円
投資のソムリエ＜DC年金＞	803,895,041円
D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	258,129,858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	689,761,675円
ワールドアセットバランス（基本コース）	142,909,832円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	303,469,294円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	121,843,652円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	65,346,069円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	4,825,096円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	325,184,740円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	222,616,391円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	148,383,048円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	130,650,660円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	78,960,163円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	42,972,780円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	19,060,230円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	56,348,876円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	724,810円
Oneパッシブ資産分散ファンド	332,850,354円
D I A M外国リートインデックスファンド＜DC年金＞	491,748,511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）	17,244,400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）	2,658,589円
D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	19,715,803円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	53,437,111円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	430,707,118円
計	51,792,211,949円
2. 受益権の総数	51,792,211,949口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引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、不動産投資信託証券の価格及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	△563,299,163
投資証券	13,514,651,138
合計	12,951,351,975

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2025年6月24日から2026年6月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	150,489,600	—	150,576,806	△87,206
アメリカ・ドル	89,879,400	—	89,920,868	△41,468
シンガポール・ドル	12,468,900	—	12,471,130	△2,230
ユーロ	48,141,300	—	48,184,808	△43,508
合計	150,489,600	—	150,576,806	△87,206

（注）時価の算定方法

為替予約取引

- 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。
 - 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。
 - 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。

不動産投信関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引				
買建	967,403,819	—	985,936,607	18,532,788
合計	967,403,819	—	985,936,607	18,532,788

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

- す。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6616円 (26,616円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2026年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	385,000.000	192,500.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	839,000.000	45,306.000	
		NTT DC REIT	441,000.000	423,360.000	
		PRIME US REIT	602,760.000	94,030.560	
	アメリカ・ドル	小計	2,340,460.000	755,196.560 (121,292,120)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	193,949.000	192,009.510	
		ABACUS STORAGE KING	183,660.000	258,960.600	
		ARENA REIT	190,560.000	609,792.000	
		BWP PROPERTY GROUP LTD	307,781.000	1,178,801.230	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	437,564.000	862,001.080	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	275,994.000	827,982.000	
		CENTURIA OFFICE REIT	185,985.000	168,316.420	
		CHARTER HALL GROUP	240,017.000	5,153,164.990	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	331,117.000	1,185,398.860	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	250,432.000	954,145.920	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	151,479.000	393,845.400	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	840,948.000	378,426.600	
		DEXUS	548,931.000	3,117,928.080	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	115,861.000	282,700.840	
		DIGICO INFRASTRUCTURE REIT	205,332.000	515,383.320	
		GOODMAN GROUP	1,032,482.000	32,719,354.580	

	GPT GROUP	972,694.000	4,814,835.300	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	122,425.000	265,662.250	
	HEALTHCO REIT	202,023.000	137,375.640	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	944,190.000	1,194,400.350	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	213,943.000	840,795.990	
	MIRVAC GROUP	2,008,043.000	3,433,753.530	
	REGION GROUP	597,834.000	1,386,974.880	
	RURAL FUNDS GROUP	176,030.000	352,060.000	
	SCENTRE GROUP	2,621,265.000	9,908,381.700	
	STOCKLAND	1,209,898.000	4,803,295.060	
	VICINITY CENTRES	1,986,362.000	5,085,086.720	
	WAYPOINT REIT LTD	343,320.000	841,134.000	
オーストラリア・ドル 小計		16,890,119.000	81,861,966.850 (9,199,647,835)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	303,895.000	483,193.050	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,127,060.000	5,317,650.000	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,359,916.000	1,223,924.400	
	CAPITALAND CHINA TRUST	565,280.000	370,258.400	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,927,809.000	6,821,794.970	
	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	672,402.180	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	462,200.000	263,454.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	722,000.000	1,631,720.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,476,964.000	1,440,039.900	
	KEPPEL DC REIT	1,024,800.000	2,336,544.000	
	KEPPEL REIT	1,661,200.000	1,420,326.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	1,323,600.000	747,834.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,071,720.000	2,079,136.800	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,677,920.000	2,013,504.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,165,800.000	1,480,566.000	
	OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,179,800.000	412,930.000	
	PARKWAY LIFE REIT	220,700.000	876,179.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	322,800.000	216,276.000	

		STARHILL GLOBAL REIT	735,100.000	400,629.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,101,190.000	1,563,689.800	
	シンガポール・ドル 小計		22,710,468.000	32,618,589.500 (4,068,190,482)	
	ユーロ	STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST	177,440.000	276,806.400	
	ユーロ 小計		177,440.000	276,806.400 (51,303,298)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	728,000.000	3,436,160.000	
	香港・ドル 小計		728,000.000	3,436,160.000 (70,406,918)	
投資信託受益証券 合計			42,846,487	13,510,840,653 (13,510,840,653)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	64,914.000	1,389,159.600	
		AGREE REALTY CORP	60,698.000	4,584,519.940	
		AH REALTY TRUST INC	37,788.000	258,847.800	
		ALEXANDER'S INC.	977.000	261,728.530	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,133.000	4,139,447.230	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,384.000	88,600.640	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,472.000	550,564.000	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	89,897.000	4,208,977.540	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	165,208.000	5,488,209.760	
		AMERICOLD REALTY TRUST	140,942.000	2,023,927.120	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	109,300.000	1,733,498.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	71,555.000	13,351,447.450	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22,683.000	57,614.820	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	82,790.000	265,755.900	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	155,302.000	4,947,921.720	
		BROADSTONE NET LEASE INC	93,538.000	1,971,781.040	
		BRT APARTMENTS CORP	3,973.000	59,475.810	
		BXP INC	74,744.000	4,894,237.120	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	52,392.000	6,041,321.520	
		CARETRUST REIT INC	113,194.000	4,270,809.620	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	7,096.000	355,296.720	
		CENTERSPACE	8,274.000	483,863.520	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,414.000	310,559.080	
		CHIRON REAL ESTATE INC	7,015.000	259,555.000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	11,691.000	208,801.260	

COPT DEFENCE PROPERTIES	55,843.000	1,909,272.170	
COUSINS PROPERTIES INC	85,706.000	2,489,759.300	
CTO REALTY GROWTH INC	16,134.000	338,491.320	
CUBESMART	115,650.000	4,820,292.000	
CURBLINE PROPERTIES CORP	49,751.000	1,474,122.130	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	105,020.000	1,222,432.800	
DIGITAL REALTY TRUST INC	163,025.000	29,471,659.500	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	112,001.000	993,448.870	
DOUGLAS EMMETT INC	86,893.000	1,079,211.060	
EAST GROUP	26,984.000	5,420,276.080	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	20,907.000	499,259.160	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	73,272.000	409,590.480	
EPR PROPERTIES	38,806.000	2,303,524.160	
EQUINIX INC	49,583.000	51,483,516.390	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	98,178.000	6,314,808.960	
EQUITY RESIDENTIAL	173,790.000	11,749,941.900	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	106,517.000	3,279,658.430	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	32,356.000	9,209,811.840	
EXTRA SPACE STORAGE INC	107,234.000	16,042,206.400	
FARMLAND PARTNERS INC	18,774.000	186,050.340	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,809.000	4,921,188.580	
FERMI INC	14,478.000	99,753.420	
FIRST INDUSTRIAL RT	67,179.000	4,192,641.390	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	56,292.000	1,416,306.720	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,375.000	29,680.000	
FRONTVIEW REIT INC	10,033.000	196,847.460	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	143,277.000	6,936,039.570	
GETTY REALTY CORP	26,553.000	891,649.740	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	26,376.000	336,557.760	
GLADSTONE LAND CORP	19,748.000	179,904.280	
GLOBAL NET LEASE INC	101,952.000	965,485.440	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	177,230.000	3,626,125.800	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	351,881.000	7,203,004.070	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	56,475.000	1,705,545.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	323,655.000	7,751,537.250	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	24,407.000	367,569.420	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	117,058.000	1,987,644.840	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	232,789.460	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	13,602.000	791,092.320	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,925.000	1,387,793.000	
INVITATION HOMES INC	283,236.000	8,414,941.560	
IRON MOUNTAIN INC	149,414.000	18,431,711.040	
JBG SMITH PROPERTIES	26,368.000	388,136.960	
KILROY REALTY CORP	53,993.000	2,074,411.060	
KIMCO REALTY	338,552.000	8,592,449.760	
KITE REALTY GROUP TRUST	110,125.000	3,176,005.000	
LAMAR ADVERTISING CO	43,978.000	6,629,243.720	
LINEAGE INC	29,448.000	1,305,429.840	
LTC PROPERTIES INC	24,621.000	919,348.140	
LXP INDUSTRIAL TRUST	29,315.000	1,546,366.250	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	253,468.000	1,262,270.640	
MID AMERICA	58,723.000	8,208,300.940	
MILLROSE PROPERTIES INC	76,034.000	2,189,779.200	
MODIV INC	3,617.000	66,661.310	
NATIONAL HEALTH INVS INC	24,295.000	1,766,975.350	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	35,110.000	1,594,696.200	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	5,924.000	69,903.200	
NETSTREIT CORP	50,152.000	1,022,599.280	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	18,302.000	92,791.140	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,217.000	291,797.520	
NNN REIT INC	96,264.000	4,457,023.200	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	149,630.000	6,862,031.800	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,397.000	182,336.050	
ORION PROPERTIES INC	20,368.000	57,030.400	
OUTFRONT MEDIA INC	74,160.000	2,250,756.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	102,879.000	1,432,075.680	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	55,793.000	961,313.390	
PHILLIPS EDISON & CO INC	61,982.000	2,576,591.740	
PIEDMONT REALTY TRUST INC	59,203.000	539,931.360	
POSTAL REALTY TRUST INC	13,621.000	317,777.930	
PROLOGIS INC	469,044.000	68,372,543.880	

	PUBLIC STORAGE	79,756.000	25,830,575.720	
	REALTY INCOME CORP	464,413.000	28,844,691.430	
	REGENCY CENTERS CORP	83,355.000	6,676,735.500	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	116,701.000	4,035,520.580	
	RLJ LODGING TRUST	73,261.000	779,497.040	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	31,988.000	3,796,015.960	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	124,161.000	2,336,710.020	
	SAFEHOLD INC	21,139.000	332,939.250	
	SAUL CENTERS INC	5,700.000	215,574.000	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	269,444.000	447,277.040	
	SILA REALTY TRUST INC	26,637.000	806,834.730	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	164,160.000	34,936,531.200	
	SITE CENTERS CORP	22,861.000	114,990.830	
	SL GREEN	35,335.000	1,803,851.750	
	SMARTSTOP SELF STORAGE REIT INC	28,663.000	942,726.070	
	STAG INDUSTRIAL INC	96,896.000	3,681,079.040	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	47,737.000	292,150.440	
	SUN COMMUNITIES INC	58,401.000	7,395,902.640	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	98,231.000	1,122,780.330	
	TANGER INC	58,675.000	2,323,530.000	
	TERRENO REALTY CORP	52,868.000	3,499,861.600	
	THE MACERICH COMPANY	137,000.000	3,345,540.000	
	UDR INC	152,370.000	5,991,188.400	
	UMH PROPERTIES INC	38,835.000	595,728.900	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,726.000	230,586.020	
	URBAN EDGE PROPERTIES	62,563.000	1,486,496.880	
	VENTAS INC	239,874.000	20,233,371.900	
	VICI PROPERTIES INC	551,906.000	15,679,649.460	
	VORNADO REALTY TRUST	81,584.000	3,123,035.520	
	WELLTOWER INC	352,070.000	74,413,515.200	
	WHITESTONE REIT	22,751.000	433,406.550	
	WP CAREY INC	110,061.000	8,347,026.240	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	48,969.000	903,967.740	
アメリカ・ドル	小計	11,224,308.000	679,174,927.070 (109,082,285,037)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	76,762.000	81,367.720	
	BIG YELLOW GROUP PLC	97,988.000	834,367.820	
	BRITISH LAND CO PLC	518,838.000	2,137,612.560	
	CLS HOLDINGS PLC	80,477.000	37,502.280	
	CUSTODIAN REIT PLC	241,442.000	211,261.750	

	DERWENT LONDON PLC	55,853.000	1,038,307.270	
	GRAINGER PLC	383,622.000	631,058.190	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	210,427.000	662,003.340	
	HAMMERSON PLC	265,033.000	901,112.200	
	HELICAL PLC	50,025.000	92,046.000	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	378,748.000	2,456,180.780	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,192,307.000	2,179,537.190	
	NEWRIVER REIT PLC	166,709.000	129,866.310	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	220,042.000	157,550.070	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	1,326,701.000	1,213,931.410	
	REGIONAL REIT LTD	77,865.000	71,090.740	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	109,231.000	690,339.920	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	283,492.000	134,091.710	
	SEGro PLC	680,300.000	4,959,387.000	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	965,767.000	1,281,572.800	
	SIRIUS REAL ESTATE LTD	756,186.000	736,525.160	
	SOCIAL HOUSING REIT PLC	156,311.000	110,980.810	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	649,923.000	545,285.390	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	301,438.000	322,538.660	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,261,135.000	1,904,313.850	
	UNITE GROUP PLC	241,834.000	1,269,628.500	
	WORKSPACE GROUP PLC	72,484.000	241,806.620	
イギリス・ポンド 小計		11,051,980.000	25,031,266.050 (5,375,214,072)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	420,949.000	809,063.970	
	REIT 1 LTD	103,240.000	2,219,660.000	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	118,342.000	1,095,846.920	
イスラエル・シュケル 小計		642,531.000	4,124,570.890 (222,889,336)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	45,559.000	457,867.950	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,332.000	742,019.360	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	37,655.000	1,357,839.300	
	CHOICE PROPERTIES REIT	83,257.000	1,333,777.140	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	26,145.000	444,465.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,066.000	484,210.740	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	69,787.000	965,154.210	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	4,883.000	88,382.300	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	52,306.000	1,217,160.620	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,859.000	1,396,746.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	68,554.000	719,131.460	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	35,315.000	449,206.800	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,004.000	605,835.720	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,186.000	176,625.240	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,000.000	134,560.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,455.000	115,929.100	
	PRIMARIS REIT	27,393.000	543,203.190	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	72,551.000	1,638,927.090	
	SLATE GROCERY REIT	15,647.000	267,720.170	
	SMARTCENTRES REIT	35,752.000	1,052,896.400	
	VITAL INFRASTRUCTURE PROPERTY TRUST	57,513.000	305,969.160	
カナダ・ドル 小計		750,219.000	14,497,626.950 (1,669,981,648)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN NEW ZEALAND LTD & GOODMAN PROPERTY SERVICES NZ LTD	524,054.000	1,074,310.700	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	294,101.000	551,439.370	
ニュージーランド・ドル 小計		818,155.000	1,625,750.070 (151,389,847)	
ユーロ	AEDIFICA	41,654.000	2,919,945.400	
	ALTAREA	2,924.000	283,628.000	
	ASCENCIO	3,060.000	154,530.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	23,004.000	284,789.520	
	CARMILA SA	32,694.000	551,874.720	
	COFINIMMO SA	3,859.000	315,473.250	
	COLONIAL SFL SOCIMI SA	172,411.000	984,466.810	
	COVIVIO	27,925.000	1,506,553.750	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	22,112.000	610,291.200	
	GECINA SA	26,631.000	1,953,383.850	
	HAMBORNER REIT AG	33,033.000	153,107.950	
	ICADE	16,092.000	338,253.840	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	25,203.000	106,608.690	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	265,702.000	293,335.000	

		KLEPIERRE	111,547.000	4,084,851.140	
		MERCIALYS	47,297.000	564,726.180	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	218,319.000	3,222,388.440	
		MONTEA SCA	10,680.000	710,220.000	
		NSI NV	6,452.000	112,910.000	
		RETAIL ESTATES	6,811.000	478,813.300	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	15,635.000	370,549.500	
		UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	61,231.000	6,061,869.000	
		VASTNED NV	3,687.000	110,794.350	
		WAREHOUSES DE PAUW	96,839.000	2,113,026.980	
		WERELDHAVE NV	19,723.000	404,321.500	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	19,024.000	504,136.000	
	ユーロ 小計		1,313,549.000	29,194,848.370 (5,410,973,197)	
	韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	101,178.000	351,593,550.000	
		HANWHA REIT CO LTD	66,055.000	294,275,025.000	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	29,074.000	93,472,910.000	
		JR REIT XXVII	87,309.000	103,199,238.000	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	24,787.000	97,784,715.000	
		LOTTE REIT CO LTD	78,077.000	281,467,585.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	54,332.000	283,613,040.000	
		SK REITS CO LTD	94,152.000	502,771,680.000	
	韓国・ウォン 小計		534,964.000	2,008,177,743.000 (211,372,757)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	967,070.000	2,253,273.100	
		LINK REIT	1,315,820.000	49,395,882.800	
		PROSPERITY REIT	582,000.000	826,440.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	342,000.000	766,080.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,476,000.000	1,047,960.000	
	香港・ドル 小計		4,682,890.000	54,289,635.900 (1,112,394,640)	
投資証券 合計		31,018,596	123,236,500,534 (123,236,500,534)		
合計			136,747,341,187 (136,747,341,187)		

（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	—	79.86
	投資証券 129銘柄	—	79.13	
イギリス・ポンド	投資証券 28銘柄	—	3.90	3.93
イスラエル・シェケル	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	6.67	—	6.73
カナダ・ドル	投資証券 21銘柄	—	1.21	1.22
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 23銘柄	2.95	—	2.97
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	—	3.99
	投資証券 26銘柄	—	3.93	
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	—	0.15	0.15
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.05	—	0.86
	投資証券 5銘柄	—	0.81	

（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6月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	6,827,752,844
コール・ローン	284,971,946
株式	199,184,993,425
投資信託受益証券	1,023,384,913
投資証券	155,389,533
派生商品評価勘定	500,058,783
未収入金	3,162,170
未収配当金	380,345,092
差入委託証拠金	3,723,291,558
流動資産合計	212,083,350,264
資産合計	212,083,350,264
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	225,074,036
未払金	251
未払解約金	195,698,900
流動負債合計	420,773,187
負債合計	420,773,187
純資産の部	
元本等	
元本	70,278,318,434
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	141,384,258,643
元本等合計	211,662,577,077
純資産合計	211,662,577,077
負債純資産合計	212,083,350,264

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	67,681,631,674円
同期中追加設定元本額	11,565,901,255円
同期中一部解約元本額	8,969,214,495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	20,094,952円
D I A M新興国株式インデックスファンド＜DC年金＞	11,653,821,195円
たわらノーロード 新興国株式＜ラップ専用＞	6,250,294,022円
たわらノーロード 新興国株式	20,829,152,496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)	22,472,676円
たわらノーロード バランス(標準型)	128,334,743円
たわらノーロード バランス(積極型)	309,696,668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)	39,293,506円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	174,433,908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)	255,493,217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)	401,919,562円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	562,912円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,072,077円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,425,348円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,450,507円
たわらノーロード 全世界株式	12,956,079,293円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	46,523,027円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	21,597,204円
One DC 新興国株式インデックスファンド	3,731,514,921円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け)	797,952円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け)	431,914円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け)	282,303円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け)	328,247円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／1988～1992年生まれ向け)	226,546円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／1993～1997年生まれ向け)	218,069円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／1998～2002年生まれ向け)	245,214円
未来のわたし(ターゲット・イヤー／2003～2007年生まれ向け)	318,197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)	247,807,558円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	484,975,621円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,015,479,787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>	458,891,418円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	344,414,301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)	182,156,403円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	387,046,240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)	187,284,543円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	149,851,577円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	201,996,071円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	78,767,886円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	43,122,830円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	24,019,825円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	10,465,253円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	11,274,184円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	410,475円
ハイブリッドストラテジーマルチアセットファンド（一般投資家私募／適格機関投資家転売制限付）	10,071,508円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	8,947,797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）	1,428,426円
DIAM世界アセットバランスファンド２VA（適格機関投資家限定）	45,432,366円
DIAM世界アセットバランスファンド３VA（適格機関投資家限定）	20,515,456円
計	70,278,318,434円
２． 受益権の総数	70,278,318,434口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
１． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月11日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	10,933,609,565
投資信託受益証券	△54,083,886
投資証券	△11,553,708
合計	10,867,971,971

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2026年4月21日から2026年6月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	266,580,064	—	266,590,854	10,790
	266,580,064	—	266,590,854	10,790
合計	266,580,064	—	266,590,854	10,790

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	11,184,507,784	—	11,459,481,741	274,973,957
合計	11,184,507,784	—	11,459,481,741	274,973,957

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0118円 (30,118円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2026年6月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	16,378	30.680	502,477.040	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	6,969	351.660	2,450,718.540	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,784	167.760	1,641,363.840	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR	299,601	2.460	737,018.460	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	89,000	2.510	223,390.000	
	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	13.710	434,607.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	39,877	9.300	370,856.100	
	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	44.540	872,894.920	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	56,267	9.210	518,219.070	
	STONECO LTD	22,909	10.600	242,835.400	
	AURA MINERALS INC	3,419	53.300	182,232.700	
	XP INC	39,416	14.940	588,875.040	
	KANZHUN LTD ADR	39,728	13.240	525,998.720	
	FULL TRUCK ALLIANCE CO LTD ADR	77,609	8.340	647,259.060	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	6,582	34.860	229,448.520	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISLANDS	379,269	11.620	4,407,105.780	
	JBS NV	32,951	12.030	396,400.530	
	PDD HOLDINGS INC ADR	59,118	81.820	4,837,034.760	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
アメリカ・ドル 小計		3,577,745		20,779,410.660 (3,337,381,146)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	162,134	19.180	3,109,730.120	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	283,598	7.320	2,075,937.360	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	349,273	18.200	6,356,768.600	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	325,776	13.200	4,300,243.200	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	444,013	16.720	7,423,897.360	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	676,959	11.060	7,487,166.540	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	400,130	7.320	2,928,951.600	
	AIR ARABIA PJSC	227,560	4.770	1,085,461.200	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	192,502	26.620	5,124,403.240	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	95,686	13.560	1,297,502.160	

	DUBAI ELECTRICITY & WATER AUTHORITY PJSC	601,201	2.660	1,599,194.660	
	SALIK CO PJSC	196,959	5.710	1,124,635.890	
	ADNOC DRILLING CO PJSC	319,228	5.690	1,816,407.320	
	ADNOC GAS PLC	614,564	3.320	2,040,352.480	
	ADNOC LOGISTICS & SERVICES	193,108	5.660	1,092,991.280	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	293,434	3.700	1,085,705.800	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		5,376,125		49,949,348.810 (2,188,280,971)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	634,419	1,258.800	798,606,637.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	145,922	288.000	42,025,536.000	
	ASIAN PAINTS LTD	39,512	2,715.100	107,279,031.200	
	BANK OF BARODA	93,834	269.300	25,269,496.200	
	EICHER MOTORS LTD	14,110	7,219.500	101,867,145.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	28,312	3,071.200	86,951,814.400	
	HDFC BANK LTD	1,190,704	746.850	889,277,282.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	94,269	2,952.500	278,329,222.500	
	SHREE CEMENT LTD	901	23,850.000	21,488,850.000	
	ICICI BANK LTD	552,753	1,293.300	714,875,454.900	
	INDUSIND BANK LTD	54,519	883.950	48,192,070.050	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	96,592	374.400	36,164,044.800	
	STATE BANK OF INDIA LTD	196,000	1,003.250	196,637,000.000	
	TATA STEEL LTD	760,178	199.310	151,511,077.180	
	TATA MOTORS PASSENGER VEHICLES LIMITED	199,142	381.000	75,873,102.000	
	JSW STEEL LTD	61,601	1,269.800	78,220,949.800	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	12,260	1,978.600	24,257,636.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	57,048	1,108.000	63,209,184.000	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,731	10,035.000	27,405,585.000	
	TATA POWER CO LTD	156,763	394.750	61,882,194.250	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,311	5,171.000	58,489,181.000	
	NESTLE INDIA LTD	59,445	1,438.300	85,499,743.500	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	132,897	377.300	50,142,038.100	
	GAIL INDIA LTD	220,558	168.010	37,055,949.580	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	582,100	388.100	225,913,010.000	
	VEDANTA LTD	138,518	773.600	107,157,524.800	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	6,516	3,488.500	22,731,066.000	
	AXIS BANK LTD	242,900	1,314.500	319,292,050.000	
	TITAN COMPANY LTD	35,890	4,042.100	145,070,969.000	

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	273,278	251.900	68,838,728.200	
NATIONAL ALUMINIUM CO LTD	88,926	376.150	33,449,514.900	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	13,131	2,056.300	27,001,275.300	
BHARAT ELECTRONICS LTD	371,017	408.350	151,504,791.950	
GE VERNOVA T&D INDIA LTD	12,975	4,866.000	63,136,350.000	
LUPIN LTD	25,380	2,247.200	57,033,936.000	
NMDC LTD	300,771	88.450	26,603,194.950	
MPHASIS LTD	14,024	2,297.800	32,224,347.200	
BAJAJ FINANCE LTD	263,000	884.100	232,518,300.000	
INFOSYS LTD	318,820	1,145.300	365,144,546.000	
WIPRO LTD	259,689	178.930	46,466,152.770	
MRF LTD	235	122,595.000	28,809,825.000	
INDIAN OIL CORP LTD	264,919	136.880	36,262,112.720	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	75,000	2,169.500	162,712,500.000	
TRENT LTD	28,449	2,754.700	78,368,460.300	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	11,157	8,488.500	94,706,194.500	
CUMMINS INDIA LTD	13,288	5,609.500	74,539,036.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	94,147	1,132.100	106,583,818.700	
DABUR INDIA LTD	48,488	427.900	20,748,015.200	
HERO MOTOCORP LTD	11,949	4,856.700	58,032,708.300	
SRF LTD	14,918	2,734.100	40,787,303.800	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,207	2,083.200	17,096,822.400	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	56,361	1,271.700	71,674,283.700	
BHARTI AIRTEL LTD	286,835	1,775.200	509,189,492.000	
PUNJAB NATIONAL BANK LTD	230,823	107.170	24,737,300.910	
ORACLE FINANCIAL SERVICES SOFTWARE LTD	2,314	9,470.000	21,913,580.000	
UNITED SPIRITS LTD	32,011	1,259.900	40,330,658.900	
UNION BANK OF INDIA LTD	143,317	166.450	23,855,114.650	
CANARA BANK	186,895	133.460	24,943,006.700	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	97,281	1,786.400	173,782,778.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	11,584	6,638.500	76,900,384.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,744	13,073.000	166,602,312.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	26,476	1,453.600	38,485,513.600	
HAVELLS INDIA LTD	22,642	1,155.500	26,162,831.000	
TVS MOTOR COMPANY LTD	24,496	3,334.900	81,691,710.400	
JINDAL STEEL LTD	34,229	1,121.100	38,374,131.900	
JINDAL STAINLESS LTD	34,447	661.900	22,800,469.300	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	415,057	142.210	59,025,255.970	

SHRIRAM FINANCE LTD	139,082	897.350	124,805,232.700	
PETRONET LNG LTD	75,518	268.300	20,261,479.400	
CIPLA LTD/INDIA	56,006	1,377.000	77,120,262.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	67,981	3,917.500	266,315,567.500	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,779	10,866.000	117,124,614.000	
ASHOK LEYLAND LTD	279,560	141.540	39,568,922.400	
BOSCH LTD	776	37,790.000	29,325,040.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	84,694	2,153.900	182,422,406.600	
ADANI ENTERPRISES LTD	19,238	2,931.100	56,388,501.800	
NTPC LTD	440,950	351.650	155,060,067.500	
YES BANK LTD	1,634,971	22.600	36,950,344.600	
AMBUJA CEMENTS LTD	61,793	409.800	25,322,771.400	
BHARAT FORGE LTD	25,017	1,949.200	48,763,136.400	
SUZLON ENERGY LTD	984,881	54.080	53,262,364.480	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	131,427	1,039.300	136,592,081.100	
ITC LTD	296,216	283.650	84,021,668.400	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,722	1,506.500	44,776,193.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	51,485	611.000	31,457,335.000	
SUNDARAM FINANCE LTD	6,335	4,203.200	26,627,272.000	
PHOENIX MILLS LTD	19,759	1,765.700	34,888,466.300	
COROMANDEL INTERNATIONAL LTD	12,117	1,880.700	22,788,441.900	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	11,421	4,463.700	50,979,917.700	
SIEMENS INDIA LTD	8,270	3,582.700	29,628,929.000	
INFO EDGE INDIA LTD	36,145	971.250	35,105,831.250	
GMR AIRPORTS LTD	269,965	100.920	27,244,867.800	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD	72,036	908.100	65,415,891.600	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	39,996	1,027.600	41,099,889.600	
TECH MAHINDRA LTD	52,603	1,478.900	77,794,576.700	
VOLTAS LTD	22,355	1,290.000	28,837,950.000	
INDIAN HOTELS CO LTD	83,404	665.850	55,534,553.400	
TORRENT POWER LTD	17,117	1,399.100	23,948,394.700	
VODAFONE IDEA LTD	2,817,069	13.880	39,100,917.720	
MARICO LTD	49,015	819.900	40,187,398.500	
POWER FINANCE CORP LTD	155,773	431.300	67,184,894.900	
INDIAN BANK	29,247	833.450	24,375,912.150	
PAGE INDUSTRIES LTD	602	37,955.000	22,848,910.000	
FORTIS HEALTHCARE LTD	49,466	989.000	48,921,874.000	
ABB LTD/INDIA	5,092	6,801.000	34,630,692.000	
DLF LTD	73,505	563.200	41,398,016.000	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	433,978	287.200	124,638,481.600	
NHPC LTD	307,784	72.670	22,366,663.280	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	11,595	4,928.000	57,140,160.000	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	52,598	1,821.200	95,791,477.600	
REC LTD	118,641	348.800	41,381,980.800	
BAJAJ FINSERV LTD	37,351	1,664.200	62,159,534.200	
BAJAJ AUTO LTD	6,478	10,144.000	65,712,832.000	
ADANI POWER LTD	285,675	220.580	63,014,191.500	
OIL INDIA LTD	50,564	427.350	21,608,525.400	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,629	2,898.800	33,710,145.200	
OBEROI REALTY LTD	13,246	1,591.600	21,082,333.600	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS LTD	17,525	1,328.000	23,273,200.000	
JSW ENERGY LTD	44,430	560.650	24,909,679.500	
COAL INDIA LTD	180,782	451.000	81,532,682.000	
L&T FINANCE LTD	90,118	260.350	23,462,221.300	
MULTI COMMODITY EXCHANGE OF INDIA LTD	13,671	2,743.800	37,510,489.800	
INDUS TOWERS LTD	130,423	413.150	53,884,262.450	
PI INDUSTRIES LTD	7,263	2,807.700	20,392,325.100	
VARUN BEVERAGES LTD	135,186	526.250	71,141,632.500	
BSE LTD	20,544	3,929.500	80,727,648.000	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,696	3,062.300	35,816,660.800	
LTM LTD	8,144	3,944.100	32,120,750.400	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	103,093	549.550	56,654,758.150	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	54,729	959.200	52,496,056.800	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	17,621	4,219.200	74,346,523.200	
FEDERAL BANK LTD	195,961	311.100	60,963,467.100	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	18,566	2,447.800	45,445,854.800	
GODREJ PROPERTIES LTD	17,149	1,641.500	28,150,083.500	
POLYCAB INDIA LTD	5,022	9,523.500	47,827,017.000	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	44,300	1,472.600	65,236,180.000	
HITACHI ENERGY INDIA LTD	1,259	33,265.000	41,880,635.000	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	26,315	580.700	15,281,120.500	
ETERNAL LTD	229,375	239.800	55,004,125.000	
LODHA DEVELOPERS LTD	27,877	862.000	24,029,974.000	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	76,520	1,010.100	77,292,852.000	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	3,949	11,487.000	45,362,163.000	
APL APOLLO TUBES LTD	18,244	1,762.400	32,153,225.600	

	ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	38,768	1,066.300	41,338,318.400	
	FSN E-COMMERCE VENTURES LTD	120,259	262.400	31,555,961.600	
	PB FINTECH LTD	36,762	1,509.600	55,495,915.200	
	MANKIND PHARMA LTD	11,821	2,376.200	28,089,060.200	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	305,795	230.170	70,384,835.150	
	ASTRAL POLYTECHNIK LTD	12,169	1,501.500	18,271,753.500	
	SWIGGY LTD	134,600	242.300	32,613,580.000	
	WAAREE ENERGIES LTD	9,279	3,017.200	27,996,598.800	
	TATA MOTORS LTD	206,895	364.900	75,495,985.500	
	VISHAL MEGA MART LTD	189,767	118.840	22,551,910.280	
	SIEMENS ENERGY INDIA LTD	9,101	3,424.800	31,169,104.800	
	ZYDUS LIFESCIENCES LTD	17,682	1,098.300	19,420,140.600	
	ADITYA BIRLA CAPITAL LTD	79,827	342.700	27,356,712.900	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	15,670	4,043.400	63,360,078.000	
	IDFC BANK LTD	509,314	72.990	37,174,828.860	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	24,532	1,732.200	42,494,330.400	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	37,542	465.800	17,487,063.600	
	ALKEM LABORATORIES LTD	4,865	5,299.500	25,782,067.500	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	19,624	4,524.900	88,796,637.600	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,547	17,697.000	45,074,259.000	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	44,189	1,728.700	76,389,524.300	
インド・ルピー 小計		22,832,682		13,165,593,766.850 (22,381,509,404)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	2,181,173	1,760.000	3,838,864,480.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	135,001	22,000.000	2,970,022,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,598,100	4,700.000	7,511,070,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,496,500	2,810.000	12,635,165,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	659,600	3,240.000	2,137,104,000.000	
	BANK MANDIRI	3,684,700	4,260.000	15,696,822,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	6,757,300	2,880.000	19,461,024,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	1,498,400	3,450.000	5,169,480,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,110,300	5,650.000	28,873,195,000.000	
	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		118,578,674		105,534,242,480.000 (949,808,182)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	11,532	55.360	638,411.520	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	12,640	130.600	1,650,784.000	
	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	4,100	202.600	830,660.000	
	TIANSUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	17.110	205,320.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,880	67.600	870,688.000	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	26,000	26.650	692,900.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	12,100	37.050	448,305.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	18,640	25.920	483,148.800	
	KINGNET NETWORK CO LTD	17,300	14.520	251,196.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	13.650	260,715.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	5,300	96.390	510,867.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	38.760	46,512.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	19.580	317,196.000	
	HGTECH CO LTD	7,300	149.000	1,087,700.000	
	CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD	2,100	66.160	138,936.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	11,800	45.360	535,248.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	8,100	16.150	130,815.000	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	11,800	212.270	2,504,786.000	
	SHANJIN INTERNATIONAL GOLD CO LTD	23,900	20.250	483,975.000	
	SHANDONG HIMILE MECHANICAL SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	8,120	50.780	412,333.600	
	GEM CO LTD	29,100	7.020	204,282.000	
	SHENZHEN EVERWIN PRECISION TECHNOLOGY CO LTD	10,100	30.200	305,020.000	
	ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	43,500	14.560	633,360.000	

INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	28.020	473,538.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	12,760	143.550	1,831,698.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	15,593	12.270	191,326.110	
ZHEJIANG NHU CO LTD	24,512	30.230	740,997.760	
YUNNAN TIN CO LTD	9,000	33.970	305,730.000	
LEO GROUP CO LTD	39,500	5.370	212,115.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	21.450	109,395.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	44.050	409,665.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	28.780	299,312.000	
MUYUAN FOODS GROUP CO LTD	33,900	34.430	1,167,177.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	8,950	12.590	112,680.500	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	7.170	129,060.000	
TIANQI LITHIUM CORP	11,700	59.480	695,916.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	16.140	180,768.000	
HAISCO PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	2,800	49.150	137,620.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	37.060	444,720.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	51,550	11.150	574,782.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	10,140	24.480	248,227.200	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	14,739	73.000	1,075,947.000	
BLUEFOCUS INTELLIGENT COMMUNICATIONS GROUP CO LTD	21,200	14.750	312,700.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	7,770	59.390	461,460.300	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	67,129	8.250	553,814.250	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	132.000	1,425,600.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	7,900	31.280	247,112.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	58,700	9.270	544,149.000	

GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,800	14.060	222,148.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	20,100	28.620	575,262.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	144.800	724,000.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	70,900	6.350	450,215.000	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLDING GROUP CO LTD	34,500	7.030	242,535.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15,900	18.170	288,903.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,500	85.410	640,575.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	10,000	70.100	701,000.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	13,675	10.130	138,527.750	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD	9,100	38.190	347,529.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,920	198.400	777,728.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	10,800	11.480	123,984.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	44,454	65.510	2,912,181.540	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	29.030	867,997.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	5.390	384,307.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	6.870	136,713.000	
WANXIANG QIANCHAO CO LTD	18,900	13.400	253,260.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	16.240	310,184.000	
IFLYTEK CO LTD	11,500	42.290	486,335.000	
GOERTEK INC	18,100	22.760	411,956.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.860	146,118.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	35,200	32.700	1,151,040.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	30,200	42.110	1,271,722.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	238,509	4.670	1,113,837.030	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.460	211,118.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	40,488	7.470	302,445.360	

HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	26,400	24.320	642,048.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	50.140	527,472.800	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	91,418	17.780	1,625,412.040	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY CO LTD	7,800	43.240	337,272.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	24,200	79.140	1,915,188.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	58,900	5.010	295,089.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	222,300	6.030	1,340,469.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	8.180	375,462.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	12,100	38.200	462,220.000	
MIDEA GROUP CO LTD	20,700	83.900	1,736,730.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	10.040	424,692.000	
PING AN BANK CO LTD	142,300	11.320	1,610,836.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	40,080	12.830	514,226.400	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	118,600	4.380	519,468.000	
ZTE CORP	22,700	38.420	872,134.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.380	210,330.000	
WEICHAI POWER CO LTD	44,200	28.190	1,245,998.000	
GF SECURITIES CO LTD	31,600	19.060	602,296.000	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	21.250	448,375.000	
BYD CO LTD	47,000	90.310	4,244,570.000	
CCOOP GROUP CO LTD	127,500	1.470	187,425.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	13.900	473,990.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	46.900	453,054.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	14.990	164,890.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	42,800	11.720	501,616.000	
INNER MONGOLIA XINGYE SILVER&TIN MINING CO LTD	12,200	35.410	432,002.000	

SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,500	62.800	722,200.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	4,280	619.200	2,650,176.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	61.440	786,432.000	
CHINA TUNGSTEN AND HIGHTECH MATERIALS CO LTD	13,400	72.900	976,860.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	10.330	353,286.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	47,800	3.770	180,206.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,700	87.210	148,257.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	49.260	325,116.000	
CNPC CAPITAL CO LTD	38,200	7.170	273,894.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	13,200	24.200	319,440.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	26.250	443,625.000	
SF HOLDING CO LTD	33,000	34.830	1,149,390.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	148.950	372,375.000	
VICTORY GIANT TECHNOLOGY HUIZHOU CO LTD	5,300	330.260	1,750,378.000	
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD	5,460	772.500	4,217,850.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	80,290	9.200	738,668.000	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	9.340	363,326.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	33,000	6.780	223,740.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	58.470	134,481.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	21,800	24.950	543,910.000	
YANGTZE OPTICAL FIBRE & CABLE JOINT STOCK LTD CO	3,700	452.690	1,674,953.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,461	27.510	177,742.110	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	47,800	16.380	782,964.000	
BAIYIN NONFERROUS GROUP CO LTD	43,000	5.540	238,220.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	9.110	204,975.000	

SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	23.740	362,699.720	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	3,500	187.530	656,355.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	4,410	34.830	153,600.300	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	5,800	61.020	353,916.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	47.150	429,819.400	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	6,840	1,147.000	7,845,480.000	
CHINA MERCHANTS EXPRESSWAY NETWORK & TECHNOLOGY HOLDINGS CO LTD	27,500	9.810	269,775.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,342	383.060	1,663,246.520	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	89.570	268,710.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	3,100	54.080	167,648.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.500	95,250.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	3,300	39.850	131,505.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	19.800	421,740.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	69,700	71.130	4,957,761.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,200	143.500	1,033,200.000	
SHENZHEN MEGMEET ELECTRICAL CO LTD	3,200	145.610	465,952.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	2,500	100.690	251,725.000	
SG MICRO CORP	4,413	105.750	466,674.750	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	27,340	388.500	10,621,590.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,916	480.840	1,882,969.440	
WUXI APPTec CO LTD	13,972	97.040	1,355,842.880	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	30,200	5.800	175,160.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	73,300	7.040	516,032.000	
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD	82,500	2.960	244,200.000	

MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	94.510	241,945.600	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	45,100	22.460	1,012,946.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,425	22.280	165,429.000	
BANK OF SUZHOU CO LTD	40,700	8.290	337,403.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	2,156	152.990	329,846.440	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	91.010	100,111.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	2,520	53.900	135,828.000	
ANJI MICROELECTRONICS TECHNOLOGY SHANGHAI CO LTD	1,040	216.400	225,056.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	6,258	289.110	1,809,250.380	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	8,000	231.000	1,848,000.000	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD	5,200	125.380	651,976.000	
OMNIVISION INTEGRATED CIRCUITS GROUP INC	7,330	90.180	661,019.400	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	26,100	9.720	253,692.000	
TIANFENG SECURITIES CO LTD	43,200	3.120	134,784.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	3.110	355,473.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	111.060	1,188,342.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.010	198,648.000	
JL MAG RARE-EARTH CO LTD	9,400	29.410	276,454.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	3,480	37.590	130,813.200	
HUNAN YUNENG NEW ENERGY BATTERY MATERIAL CO LTD	7,900	68.050	537,595.000	
CITIC PACIFIC SPECIAL STEEL GROUP CO LTD	21,200	13.600	288,320.000	
BEIJING COMPASS TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	2,900	80.350	233,015.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	301,300	5.020	1,512,526.000	
ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD	3,200	163.590	523,488.000	

SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD	5,020	411.080	2,063,621.600	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	1,700	202.660	344,522.000	
CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD	5,520	23.930	132,093.600	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	170,800	5.080	867,664.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.650	223,650.000	
ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,200	43.910	140,512.000	
GUOLIAN MINSHENG SECURITIES CO LTD	26,200	8.900	233,180.000	
HENAN SHIJIA PHOTONS TECHNOLOGY CO LTD	4,000	151.630	606,520.000	
QUANTUMCTEK CO LTD	600	498.230	298,938.000	
ACM RESEARCH SHANGHAI INC	2,200	264.990	582,978.000	
VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD	3,000	228.520	685,560.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	40,600	13.390	543,634.000	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD	7,900	87.600	692,040.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	5,100	121.310	618,681.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	4,700	226.740	1,065,678.000	
SHENZHEN ENVICOOL TECHNOLOGY CO LTD	8,580	68.900	591,162.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,572	9.150	105,883.800	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	5.200	185,120.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	6,577	31.000	203,887.000	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	2,900	42.330	122,757.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	14,400	32.480	467,712.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	54.550	250,930.000	
DELTON TECHNOLOGY GUANGZHOU INC	3,800	181.400	689,320.000	
SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD	4,000	110.600	442,400.000	

SUZHOU EVERBRIGHT PHOTONICS CO LTD	1,600	342.000	547,200.000	
PIOTECH INC	1,876	618.000	1,159,368.000	
DOSILICON CO LTD	2,600	127.570	331,682.000	
RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD	9,100	76.900	699,790.000	
ROBOTECHNIK INTELLIGENT TECHNOLOGY CO LTD	900	616.020	554,418.000	
JINKO SOLAR CO LTD	40,200	5.320	213,864.000	
CAMBRICON TECHNOLOGIES CORP LTD	3,725	1,231.000	4,585,475.000	
SHANGHAI ALLIST PHARMACEUTICALS CO LTD	3,400	81.230	276,182.000	
APT MEDICAL INC	1,450	194.410	281,894.500	
SHANNON SEMICONDUCTOR TECHNOLOGY CO LTD	2,800	178.190	498,932.000	
EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD	2,400	96.870	232,488.000	
SHENZHEN LONGSYS ELECTRONICS CO LTD	2,300	507.000	1,166,100.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	4,900	57.150	280,035.000	
ANKER INNOVATIONS TECHNOLOGY CO LTD	3,400	104.430	355,062.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,540	93.230	143,574.200	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	7,880	53.400	420,792.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	214.250	524,269.750	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	19,000	32.650	620,350.000	
XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD	8,600	20.130	173,118.000	
LOONGSON TECHNOLOGY CORP LTD	1,600	134.550	215,280.000	
HWATSING TECHNOLOGY CO LTD	4,183	182.220	762,226.260	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.650	491,840.000	
SUZHOU CENTEC COMMUNICATIONS CO LTD	2,200	267.220	587,884.000	
WINTIME ENERGY GROUP CO LTD	149,700	1.650	247,005.000	
ANHUI JIANGHUAI AUTOMOBILE GROUP CORP LTD	11,700	32.320	378,144.000	
PETROCHINA CO LTD	117,300	10.240	1,201,152.000	

INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	356,000	7.690	2,737,640.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	527,900	6.710	3,542,209.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	6.220	1,219,120.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	223,900	4.780	1,070,242.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,800	34.630	477,894.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	43,600	47.510	2,071,436.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	133,000	38.900	5,173,700.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	64,700	53.220	3,443,334.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	136,000	18.890	2,569,040.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	179,900	9.590	1,725,241.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	237,900	3.600	856,440.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	11.090	471,325.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	7,600	1,275.880	9,696,688.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	340,100	6.940	2,360,294.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD	47,600	7.690	366,044.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	79,400	25.660	2,037,404.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	38,900	32.510	1,264,639.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	141,400	27.690	3,915,366.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	206,900	5.090	1,053,121.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	230,300	3.180	732,354.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	287,400	4.740	1,362,276.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	6.940	490,658.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	41,900	25.580	1,071,802.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	138,300	5.200	719,160.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	168,900	4.380	739,782.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	117,500	5.740	674,450.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	18.780	435,696.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	41,300	17.200	710,360.000	

HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	8.160	481,440.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	96,300	5.190	499,797.000	
CRRC CORP LTD	162,500	5.650	918,125.000	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS	41,052	47.010	1,929,854.520	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	25,100	47.110	1,182,461.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	40,300	19.370	780,611.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	117,500	4.490	527,575.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,000	58.030	812,420.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	38,000	20.420	775,960.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	45,600	18.850	859,560.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.920	498,396.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	127,300	10.490	1,335,377.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,400	22.110	274,164.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	38,100	15.570	593,217.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	19,800	67.900	1,344,420.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	7.210	567,427.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GENERATION CO LTD	81,400	7.760	631,664.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	139,000	27.700	3,850,300.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	55,100	6.530	359,803.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,200	13.630	520,666.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	55,212	22.680	1,252,208.160	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,800	58.050	568,890.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	5.800	179,220.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.320	516,200.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	61.030	268,532.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	76,300	10.100	770,630.000	

UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD	10,600	36.720	389,232.000	
AIR CHINA LTD	91,800	6.160	565,488.000	
TBEA CO LTD	24,180	22.660	547,918.800	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.310	317,985.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	56,200	2.660	149,492.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	104,200	4.860	506,412.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	41,300	35.060	1,447,978.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,600	23.820	276,312.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	40.490	603,301.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	25,600	16.600	424,960.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	33,000	10.790	356,070.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	15.140	358,818.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	16.250	185,250.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	18,300	37.980	695,034.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	11.650	667,545.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	72,870	14.410	1,050,056.700	
CMOC GROUP LIMITED	111,200	16.790	1,867,048.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	31,700	20.480	649,216.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	226,900	5.860	1,329,634.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	24.570	221,130.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	26.610	535,393.200	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,800	26.420	206,076.000	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD	27,700	21.090	584,193.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	67,500	3.230	218,025.000	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD	268,300	1.460	391,718.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	46,800	23.490	1,099,332.000	
YUTONG BUS CO LTD	16,300	30.050	489,815.000	
SHENERGY CO LTD	42,900	9.440	404,976.000	

CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	79,500	3.830	304,485.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	30.120	452,372.280	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.070	294,060.000	
CHINA XD ELECTRIC CO LTD	25,700	13.640	350,548.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	16,400	17.950	294,380.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	21.790	223,652.560	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	10.350	168,187.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	13,100	63.750	835,125.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	45,100	5.110	230,461.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	53.050	541,110.000	
SICHUAN CHANGHONG ELECTRIC CO LTD	31,900	6.980	222,662.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	7.490	125,832.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	31,800	11.070	352,026.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.100	200,940.000	
WESTERN MINING CO LTD	15,100	29.700	448,470.000	
ZHANGZHOU PIENTZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	4,300	117.500	505,250.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	21,100	33.300	702,630.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,880	118.790	936,065.200	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	11,500	55.700	640,550.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	14.620	830,416.000	
KINGFA SCI & TECH CO LTD	18,500	15.860	293,410.000	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD	9,200	31.380	288,696.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	5,550	34.530	191,641.500	

ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	40.390	819,917.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	104,900	4.560	478,344.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	19,000	17.270	328,130.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	26,500	50.200	1,330,300.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	15,900	16.580	263,622.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	47,460	8.310	394,392.600	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	28.700	364,490.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	15,400	146.900	2,262,260.000	
WOLONG ELECTRIC GROUP CO LTD	10,700	36.010	385,307.000	
TONGWEI CO LTD	32,600	13.970	455,422.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	12,784	19.010	243,023.840	
JCET GROUP CO LTD	10,900	74.050	807,145.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	33.530	228,004.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	26.760	280,712.400	
CHONGQING QIANLI TECHNOLOGY CO LTD	33,000	9.370	309,210.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	39.370	797,085.020	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	8,424	119.300	1,004,983.200	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	13,800	106.880	1,474,944.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	12.690	249,993.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	35.450	173,705.000	
NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD	9,004	14.400	129,657.600	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	10,700	45.840	490,488.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CORP	8,985	103.700	931,744.500	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD	4,550	131.880	600,054.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	63.830	453,193.000	
GEOVIS TECHNOLOGY CO LTD	5,000	44.880	224,400.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	14.610	162,171.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	151,800	4.110	623,898.000	

SICHUAN BIOKIN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	219.980	571,948.000	
BIWIN STORAGE TECHNOLOGY CO LTD	2,800	317.000	887,600.000	
YUANJIE SEMICONDUCTOR TECHNOLOGY CO LTD	580	1,450.000	841,000.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	74.590	865,244.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	52,200	8.930	466,146.000	
SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	7,760	103.390	802,306.400	
CSI SOLAR CO LTD	32,400	11.280	365,472.000	
SICHUAN HUAFENG TECHNOLOGY CO LTD	4,600	139.910	643,586.000	
SHENGYI ELECTRONICS CO LTD	4,600	116.400	535,440.000	
SHENZHEN TECHWINSEMI TECHNOLOGY CO LTD	1,400	627.950	879,130.000	
HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	15,400	284.800	4,385,920.000	
CICT MOBILE COMMUNICATION TECHNOLOGY CO LTD	20,800	15.700	326,560.000	
GUOBO ELECTRONICS CO LTD	2,400	93.760	225,024.000	
SHARETRONIC DATA TECHNOLOGY CO LTD	3,500	222.220	777,770.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	44,968	14.080	633,149.440	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	120.700	217,260.000	
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD	73,300	5.970	437,601.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	61,351	26.630	1,633,777.130	
HUAQIN CO LTD	3,800	103.170	392,046.000	
HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR LTD	3,000	221.810	665,430.000	
SHANDONG HONGQIAO ALUMINUM INDUSTRY HOLDING CO LTD	18,900	17.140	323,946.000	
NEXCHIP SEMICONDUCTOR CORP	17,000	38.410	652,970.000	
SKYVERSE TECHNOLOGY CO LTD	2,000	203.180	406,360.000	
UNITED NOVA TECHNOLOGY CO LTD	76,800	7.180	551,424.000	
CHENGTON MINING GROUP CO LTD	19,900	11.290	224,671.000	

	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	25,519	35.100	895,716.900	
	DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	12.700	167,640.000	
	NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	10,150	63.210	641,581.500	
	GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD	126,110	17.050	2,150,175.500	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	9.070	952,350.000	
	JIANGSU ETERN CO LTD	14,500	52.300	758,350.000	
	SERES GROUP CO LTD	9,000	68.880	619,920.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	108,700	11.730	1,275,051.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	33,900	16.610	563,079.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	21,200	17.060	361,672.000	
	SHENZHEN KINWONG ELECTRONIC CO LTD	4,300	75.340	323,962.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	50,400	12.070	608,328.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	42,300	6.310	266,913.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	18,400	17.970	330,648.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,616	15.850	89,013.600	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	13,572	15.720	213,351.840	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	44,800	8.870	397,376.000	
	FOUNDER TECHNOLOGY GROUP CORP	25,600	11.890	304,384.000	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING GROUP LTD	14,900	28.170	419,733.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	6,600	45.150	297,990.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	97,300	13.790	1,341,767.000	
オフショア・人民元 小計		15,499,102		309,900,793.200 (7,337,335,140)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	451,509	17.250	7,788,530.250	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	305,334	4.140	1,264,082.760	
	OORED00 QSC	91,110	13.910	1,267,340.100	
	QATAR FUEL QSC	57,879	13.900	804,518.100	
	NEBRAS ENERGY	59,319	14.300	848,261.700	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	101,753	11.170	1,136,581.010	
	INDUSTRIES QATAR QSC	162,839	11.710	1,906,844.690	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	182,517	21.400	3,905,863.800	

	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	284,685	4.120	1,172,902.200	
	AL RAYAN BANK	580,363	2.080	1,207,155.040	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	555,481	1.161	644,913.440	
	DUKHAN BANK	178,162	3.389	603,791.010	
カタール・リアル 小計		3,010,951		22,550,784.100 (995,617,118)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	1,168,365	0.773	903,146.140	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	213,954	0.611	130,725.890	
	GULF BANK KSCP	233,639	0.345	80,605.450	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	934,120	0.820	765,978.400	
	MABANEE CO KPSC	72,047	0.973	70,101.730	
	BOUBAYAN BANK KSCP	154,751	0.649	100,433.390	
	WARBA BANK KSCP	204,410	0.273	55,803.930	
クウェート・ディナール 小計		2,981,286		2,106,794.930 (1,097,892,974)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	49,088	29,200.000	1,433,369,600.000	
	GRUPO CIBEST SA	24,801	78,000.000	1,934,478,000.000	
	GRUPO CIBEST SA	45,569	67,480.000	3,074,996,120.000	
コロンビア・ペソ 小計		119,458		6,442,843,720.000 (291,126,336)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	27,314	30.540	834,169.560	
	JARIR MARKETING CO	60,555	16.160	978,568.800	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	7,248	157.500	1,141,560.000	
	MAKKAH CONSTRUCTION & DEVELOPMENT CO	10,427	89.000	928,003.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	39,442	62.250	2,455,264.500	
	SAUDI BRITISH BANK	104,013	33.400	3,474,034.200	
	AL RAJHI BANK	308,309	66.800	20,595,041.200	
	ARAB NATIONAL BANK	87,214	20.860	1,819,284.040	
	BANK ALBILAD	71,718	24.750	1,775,020.500	
	BANK AL-JAZIRA	84,904	11.610	985,735.440	
	BANQUE SAUDI FRANSI	121,586	19.150	2,328,371.900	
	RIYAD BANK	215,176	20.210	4,348,706.960	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	56,260	13.200	742,632.000	
	SAUDI TELECOM CO	209,410	44.000	9,214,040.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	25,555	126.000	3,219,930.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	93,719	55.200	5,173,288.800	
	SAUDI ENERGY CO	84,386	16.730	1,411,777.780	
	ALMARAI CO JSC	47,828	45.500	2,176,174.000	

	JABAL OMAR DEVELOPMENT CO	60,707	14.650	889,357.550	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	54,640	17.600	961,664.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	8,423	191.300	1,611,319.900	
	ALINMA BANK	145,573	24.630	3,585,462.990	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	121,503	58.550	7,114,000.650	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	10,690	64.750	692,177.500	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	605,831	27.060	16,393,786.860	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,562	214.600	1,837,405.200	
	ACWA POWER CO	24,817	196.700	4,881,503.900	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,198	213.000	468,174.000	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	4,735	138.600	656,271.000	
	ELM CO	2,347	696.000	1,633,512.000	
	ADES HOLDING CO	35,063	19.410	680,572.830	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	4,712	171.000	805,752.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	310,804	40.140	12,475,672.560	
サウジアラビア・リアル 小計		3,055,669		118,288,235.620 (5,072,199,543)	
タイ・パーツ	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	381,700	34.500	13,168,650.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	55,200	198.000	10,929,600.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,204,900	2.280	5,027,172.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	375,700	18.900	7,100,730.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	103,900	354.000	36,780,600.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	324,400	352.000	114,188,800.000	
	PTT PCL	977,300	36.250	35,427,125.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	77,550	233.000	18,069,150.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	420,900	56.500	23,780,850.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	196,200	64.000	12,556,800.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,112,200	18.000	20,019,600.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	55,900	176.000	9,838,400.000	

	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	327,810	22.000	7,211,820.000	
	CP ALL PCL NVDR	575,800	45.250	26,054,950.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	127,745	143.000	18,267,535.000	
	GULF DEVELOPMENT PCL NVDR	403,874	63.000	25,444,062.000	
	SCB X PCL NVDR	79,600	137.500	10,945,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,034,228	13.800	14,272,346.400	
タイ・パーツ 小計		8,834,907		409,083,190.400 (1,996,325,969)	
チェコ・コル ナ	KOMERCNI BANKA AS	7,009	983.500	6,893,351.500	
	CEZ	13,559	1,254.000	17,002,986.000	
	MONETA MONEY BANK AS	23,959	192.500	4,612,107.500	
チェコ・コルナ 小計		44,527		28,508,445.000 (218,460,214)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,231,001	71.700	446,762,771.700	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	8,508	59,007.000	502,031,556.000	
	BANCO DE CHILE	4,466,656	176.800	789,704,780.800	
	EMPRESAS COPEC SA	36,661	6,187.500	226,839,937.500	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	37,177,986	21.700	806,762,296.200	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	15,257	68,000.000	1,037,476,000.000	
	FALABELLA SA	62,043	5,854.000	363,199,722.000	
	CENCOSUD SA	145,870	2,090.000	304,868,300.000	
	ENEL CHILE SA	2,582,189	77.500	200,119,647.500	
	PLAZA SA	75,590	3,742.400	282,888,016.000	
チリ・ペソ 小計		50,801,761		4,960,653,027.700 (871,427,996)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	328,217	66.100	21,695,143.700	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	121,617	376.750	45,819,204.750	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	348,668	38.640	13,472,531.520	
	KOC HOLDING AS	75,955	185.000	14,051,675.000	
	TURK HAVA YOLLARI	53,238	295.500	15,731,829.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	124,785	104.600	13,052,511.000	
	TURKIYE IS BANKASI	852,515	13.730	11,705,030.950	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	95,120	234.800	22,334,176.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	333,172	34.800	11,594,385.600	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	127,546	91.150	11,625,817.900	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	90,212	380.500	34,325,666.000	
トルコ・リラ 小計		2,551,045		215,407,971.420	

				(750,007,475)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	13,519	11,820.000	159,794,580.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	41,431	3,800.000	157,437,800.000	
	OTP BANK NYRT	22,704	40,150.000	911,565,600.000	
ハンガリー・フォリント 小計		77,654		1,228,797,980.000 (638,582,963)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	582,600	13.200	7,690,320.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	211,828	90.650	19,202,208.200	
	AYALA CORP	28,113	385.000	10,823,505.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	102,520	892.000	91,447,840.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	152,915	64.000	9,786,560.000	
	BDO UNIBANK INC	235,537	120.600	28,405,762.200	
	PLDT INC	8,765	1,085.000	9,510,025.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	945,875	17.800	16,836,575.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,623	590.000	13,937,570.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	25,700	574.000	14,751,800.000	
フィリピン・ペソ 小計		2,317,476		222,392,165.400 (581,399,838)	
ブラジル・レ アル	COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	196,000	14.280	2,798,880.000	
	VALE SA	372,389	77.700	28,934,625.300	
	RAIA DROGASIL SA	131,951	17.760	2,343,449.760	
	AXIA ENERGIA SA	135,595	50.530	6,851,615.350	
	BANCO DO BRASIL SA	163,700	19.000	3,110,300.000	
	ITAUSA SA	593,614	12.590	7,473,600.260	
	GERDAU SA	126,337	23.430	2,960,075.910	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	383,810	46.810	17,966,146.100	
	VIBRA ENERGIA SA	103,682	29.320	3,039,956.240	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	453,712	41.650	18,897,104.800	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOBILIDADE SA	112,420	13.800	1,551,396.000	
	WEG SA	152,544	42.390	6,466,340.160	
	BANCO BRADESCO SA PREF	539,302	17.260	9,308,352.520	
	BANCO BRADESCO SA	152,592	15.060	2,298,035.520	
	SUZANO SA	68,975	41.450	2,859,013.750	
	CPFL ENERGIA SA	23,800	43.280	1,030,064.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	583,423	39.360	22,963,529.280	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	23,300	41.960	977,668.000	
	PORTO SEGURO SA	20,100	48.480	974,448.000	
	ENGIE BRASIL SA	32,881	33.240	1,092,964.440	
	LOCALIZA RENT A CAR	90,589	39.120	3,543,841.680	

	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	70,304	24.990	1,756,896.960	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	118,100	38.410	4,536,221.000	
	EMBRAER SA	70,000	69.650	4,875,500.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	185,140	10.730	1,986,552.200	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	249,606	27.520	6,869,157.120	
	MBRF GLOBAL FOODS COMPANY SA	66,640	15.900	1,059,576.000	
	ENEVA SA	101,600	23.870	2,425,192.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	537,548	15.120	8,127,725.760	
	PRIOR SA	85,700	62.880	5,388,816.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	81,600	33.260	2,714,016.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	66,300	36.630	2,428,569.000	
	AMBEV SA	476,395	16.280	7,755,710.600	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A	52,100	18.350	956,035.000	
	TIM SA	88,100	22.440	1,976,964.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	77,200	32.500	2,509,000.000	
	AXIA ENERGIA SA-C	37,309	48.850	1,822,544.650	
	RUMO SA	136,200	13.300	1,811,460.000	
ブラジル・リアル 小計		6,960,558		206,441,343.360 (6,391,238,193)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	68,864	19.295	1,328,730.880	
	MBANK	1,453	1,290.500	1,875,096.500	
	BUDIMEX SA	1,403	654.600	918,403.800	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,890	326.150	4,856,373.500	
	BANK PEKAO SA	18,555	235.500	4,369,702.500	
	ORLEN SA	61,308	144.100	8,834,482.800	
	ASSECO POLAND SA	4,956	186.700	925,285.200	
	LPP SA	108	21,880.000	2,363,040.000	
	ERSTE BANK POLSKA SA	4,377	609.000	2,665,593.000	
	CD PROJEKT RED SA	6,738	221.400	1,491,793.200	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	89,068	98.220	8,748,258.960	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	80,249	9.710	779,217.790	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	59,477	64.260	3,821,992.020	
	DINO POLSKA SA	48,070	29.600	1,422,872.000	
	ALLEGRO.EU SA	85,638	34.630	2,965,643.940	
	ZABKA GROUP SA	36,260	25.040	907,950.400	
ポーランド・ズロチ 小計		581,414		48,274,436.490 (2,104,837,843)	

マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	272,300	6.530	1,778,119.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	823,100	7.400	6,090,940.000	
	CELCOMDIGI BHD	372,600	2.730	1,017,198.000	
	RHB BANK BHD	215,180	8.440	1,816,119.200	
	GAMUDA BHD	555,900	4.260	2,368,134.000	
	HONG LEONG BANK BHD	62,908	20.900	1,314,777.200	
	IOI CORP BHD	231,913	4.280	992,587.640	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	47,600	20.480	974,848.000	
	MALAYAN BANKING BHD	598,075	10.680	6,387,441.000	
	MISC BHD	123,180	8.210	1,011,307.800	
	PETRONAS GAS BHD	78,500	17.220	1,351,770.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	131,600	7.240	952,784.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	266,050	14.220	3,783,231.000	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,523,650	4.800	7,313,520.000	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	313,320	3.970	1,243,880.400	
	MAXIS BHD	228,800	3.260	745,888.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	265,400	5.580	1,480,932.000	
	SUNWAY BHD	293,800	5.120	1,504,256.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	173,900	8.670	1,507,713.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	369,300	8.900	3,286,770.000	
	SD GUTHRIE BHD	205,700	6.030	1,240,371.000	
マレーシア・リンギット 小計		7,152,776		48,162,587.240 (1,897,456,633)	
メキシコ・ペ ソ	SIGMA FOODS SAB DE CV	367,756	15.380	5,656,087.280	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	123,400	56.670	6,993,078.000	
	GRUMA SAB DE CV	18,575	290.020	5,387,121.500	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	19,800	268.690	5,320,062.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	56,800	135.850	7,716,280.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	257,100	175.130	45,025,923.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	19,295	782.080	15,090,233.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	155,900	35.690	5,564,071.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,965	479.720	8,618,169.800	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	304,862	198.420	60,490,718.040	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	147,700	41.660	6,153,182.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	55,380	209.470	11,600,448.600	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	527,600	50.210	26,490,796.000	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	38,025	386.050	14,679,551.250	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	26,900	208.850	5,618,065.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,559,678	22.120	34,500,077.360	
メキシコ・ペソ 小計		3,696,736		264,903,864.430 (2,444,956,707)	
ユーロ	GEK TERNA SA	5,566	43.300	241,007.800	
	NATIONAL BANK OF GREECE	85,804	14.350	1,231,287.400	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,480	18.800	272,224.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	ALLWYN AG	17,320	13.425	232,521.000	
	JUMBO SA	11,425	22.760	260,033.000	
	PUBLIC POWER CORP	27,615	22.400	618,576.000	
	ALPHA BANK SA	173,066	3.800	657,650.800	
	PIRAEUS BANK SA	113,139	8.750	989,966.250	
ユーロ 小計		264,312	3.900	1,030,816.800	
ユーロ 小計		715,857		5,534,083.050 (1,025,686,952)	
韓国・ウォン	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,399	238,000.000	808,962,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,937	616,000.000	1,809,192,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,735	142,500.000	674,737,500.000	
	KT&G CORP	9,745	185,100.000	1,803,799,500.000	
	KAKAO CORP	31,822	38,150.000	1,214,009,300.000	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,033	110,200.000	1,546,436,600.000	
	SK TELECOM CO LTD	10,446	105,700.000	1,104,142,200.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	19,533	51,200.000	1,000,089,600.000	
	LG UPLUS CORP	8,998	14,730.000	132,540,540.000	
	DOOSAN ENERBILITY	47,032	91,100.000	4,284,615,200.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,213	58,300.000	303,917,900.000	
	LG CHEM LTD	4,872	323,000.000	1,573,656,000.000	
	LS INDUSTRIAL SYSTEMS CO LTD	7,650	236,000.000	1,805,400,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	44,231	98,200.000	4,343,484,200.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	22,754	18,380.000	418,218,520.000	
	S-OIL CORP	4,930	110,800.000	546,244,000.000	
	POSCO FUTURE M CO LTD	3,432	187,600.000	643,843,200.000	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,157	385,500.000	1,602,523,500.000	
	HYUNDAI MOBIS	6,013	570,000.000	3,427,410,000.000	
	SK HYNIX INC	57,558	2,048,000.000	117,878,784,000.000	

HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,612	130,300.000	991,843,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,175	240,000.000	522,000,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,997	602,000.000	8,426,194,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	26,462	20,900.000	553,055,800.000	
KIA CORPORATION	24,711	159,700.000	3,946,346,700.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,494	36,400.000	891,581,600.000	
KOREAN AIR CO LTD	17,064	25,450.000	434,278,800.000	
HLB INC	12,328	48,500.000	597,908,000.000	
LG ELECTRONICS INC	10,432	224,000.000	2,336,768,000.000	
LG CORP	9,665	108,700.000	1,050,585,500.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,334	30,500.000	406,687,000.000	
NAVER CORP	14,359	227,000.000	3,259,493,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,100	229,000.000	938,900,000.000	
DOOSAN CORP	720	1,584,000.000	1,140,480,000.000	
POSCO HOLDINGS INC	7,489	363,000.000	2,718,507,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	6,364	496,500.000	3,159,726,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,853	1,805,000.000	10,564,665,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	487,420	302,500.000	147,444,550,000.000	
SAMYANG FOODS CO LTD	432	1,136,000.000	490,752,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	71,710	26,000.000	1,864,460,000.000	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,519	1,031,000.000	3,628,089,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	83,583	191,500.000	16,006,144,500.000	
YUHAN CORP	5,429	76,900.000	417,490,100.000	
LG DISPLAY CO LTD	31,713	12,910.000	409,414,830.000	
CELLTRION INC	15,610	167,300.000	2,611,553,000.000	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	4,352	270,000.000	1,175,040,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	28,293	117,900.000	3,335,744,700.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	3,831	195,200.000	747,811,200.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,431	368,000.000	3,102,608,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,716	111,800.000	303,648,800.000	
SK INNOVATION CO LTD	7,298	103,700.000	756,802,600.000	
ECOPRO CO LTD	10,051	105,900.000	1,064,400,900.000	
SK INC	3,768	579,000.000	2,181,672,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	36,582	154,000.000	5,633,628,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,220	137,600.000	993,472,000.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	8,283	108,200.000	896,220,600.000	

	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,041	70,600.000	497,094,600.000	
	HYUNDAI ELECTRIC & ENERGY SYSTEM CO LTD	2,470	986,000.000	2,435,420,000.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	4,410	242,500.000	1,069,425,000.000	
	HYOSUNG HEAVY INDUSTRIES CORP	544	3,437,000.000	1,869,728,000.000	
	HYUNDAI ROTEM CO LTD	7,456	189,400.000	1,412,166,400.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	67,700	29,800.000	2,017,460,000.000	
	ECOPRO BM CO LTD	5,815	164,500.000	956,567,500.000	
	HANWHA SYSTEMS CO LTD	7,371	91,600.000	675,183,600.000	
	KRAFTON INC	2,784	232,000.000	645,888,000.000	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	3,332	641,000.000	2,135,812,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	9,639	1,183,000.000	11,402,937,000.000	
	HYBE CO LTD	2,400	205,000.000	492,000,000.000	
	APR CORP/KOREA	2,455	410,500.000	1,007,777,500.000	
	LG ENERGY SOLUTION	4,666	385,500.000	1,798,743,000.000	
	KAKAObANK CORP	16,051	24,750.000	397,262,250.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	4,086	225,000.000	919,350,000.000	
	ALTEOGEN INC	4,112	315,000.000	1,295,280,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,652	407,500.000	3,525,690,000.000	
	SAMSUNG EPISHOLDINGS CO LTD	740	419,000.000	310,060,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,179	1,298,000.000	1,530,342,000.000	
	LIG DEFENSE&AEROSPACE CO LTD	1,300	790,000.000	1,027,000,000.000	
韓国・ウォン 小計		1,499,093		419,345,714,840.000 (44,138,652,561)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	106,000	32.500	3,445,000.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	124,000	18.150	2,250,600.000	
	BEIJING ENTERPRISES	47,000	29.660	1,394,020.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	396,000	7.110	2,815,560.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	556,000	3.480	1,934,880.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	306,700	14.010	4,296,867.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	77,500	25.400	1,968,500.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	829,600	7.260	6,022,896.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	421,120	15.580	6,561,049.600	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	315,888	35.980	11,365,650.240	
	CITIC LTD	422,000	12.870	5,431,140.000	

LENOVO GROUP LTD	824,000	23.000	18,952,000.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,266,000	10.150	22,999,900.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	145,990	20.720	3,024,912.800	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,427,200	4.110	9,975,792.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	282,000	7.400	2,086,800.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	78,600	51.700	4,063,620.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	370,000	6.980	2,582,600.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	122,000	13.990	1,706,780.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	390,000	9.740	3,798,600.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	259,600	6.900	1,791,240.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	661,000	19.320	12,770,520.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	89,800	17.400	1,562,520.000	
BYD CO LTD	372,500	86.600	32,258,500.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	160,000	7.490	1,198,400.000	
MMG LTD	400,000	8.110	3,244,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	12,500	129.900	1,623,750.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	711,788	15.230	10,840,531.240	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	205,200	19.670	4,036,284.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	222,000	10.350	2,297,700.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	755,000	28.200	21,291,000.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	619,000	29.720	18,396,680.000	
WEICHAI POWER CO LTD	205,440	34.600	7,108,224.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	146,000	13.030	1,902,380.000	
TINGYI HOLDING CORP	220,000	10.620	2,336,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	62,000	49.500	3,069,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	270,000	8.290	2,238,300.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	160,833	23.380	3,760,275.540	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,083,250	4.500	4,874,625.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	306,000	16.540	5,061,240.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	641,900	465.600	298,868,640.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	675,500	57.200	38,638,600.000	

LI NING CO LTD	241,500	17.730	4,281,795.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	416,000	3.250	1,352,000.000	
ZTE CORP	75,488	26.820	2,024,588.160	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	341,000	45.260	15,433,660.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	255,750	13.930	3,562,597.500	
BANK OF COMMUNICATIONS	862,205	7.490	6,457,915.450	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	82,000	44.440	3,644,080.000	
BAIDU INC	225,250	116.700	26,286,675.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,793,530	8.750	76,943,387.500	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	80,000	43.600	3,488,000.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	416,000	4.830	2,009,280.000	
BANK OF CHINA LTD	7,189,200	5.420	38,965,464.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	384,470	48.480	18,639,105.600	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,856,235	7.000	47,993,645.000	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	173,500	18.520	3,213,220.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	108,000	61.200	6,609,600.000	
CHINA COAL ENERGY CO	192,000	11.940	2,292,480.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	80,000	20.380	1,630,400.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	45,600	40.200	1,833,120.000	
CMOC GROUP LIMITED	357,000	16.270	5,808,390.000	
CHINA CITIC BANK-H	869,800	7.690	6,688,762.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	68,800	73.850	5,080,880.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	128,800	75.350	9,705,080.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	462,000	4.260	1,968,120.000	
KINGSOFT CORP LTD	99,200	24.440	2,424,448.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,537,000	0.780	1,978,860.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	93,000	42.160	3,920,880.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	436,000	3.530	1,539,080.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	81,500	25.720	2,096,180.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	547,000	4.100	2,242,700.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	286,800	32.280	9,257,904.000	

CRRCL CORP LTD - H	400,000	5.360	2,144,000.000	
SINOPHARM GROUP CO	136,000	17.080	2,322,880.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	346,000	26.580	9,196,680.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	232,000	6.590	1,528,880.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	234,000	6.170	1,443,780.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	207,400	11.270	2,337,398.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	220,000	8.200	1,804,000.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	96,000	48.580	4,663,680.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	3.510	2,204,827.560	
CHINA GOLD INTERNATIONAL RESOURCES CORP LTD	24,500	136.700	3,349,150.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,773,000	5.800	16,083,400.000	
FAR EAST HORIZON LTD	243,000	7.350	1,786,050.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	163,000	25.060	4,084,780.000	
CHINA NONFERROUS MINING CORP LTD	137,000	13.020	1,783,740.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	1,000,000	5.260	5,260,000.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	336,000	7.650	2,570,400.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD	205,352	14.250	2,926,266.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	875,000	5.070	4,436,250.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	106,000	11.640	1,233,840.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	99,750	21.080	2,102,730.000	
CHINA TOWER CORP LTD	440,500	9.700	4,272,850.000	
XIAOMI CORP	1,795,400	26.320	47,254,928.000	
BEONE MEDICINES LTD	86,700	163.000	14,132,100.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	45,112	120.400	5,431,484.800	
MEITUAN	529,310	79.000	41,815,490.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	122,800	14.280	1,753,584.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	157,000	12.680	1,990,760.000	

XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	486,000	2.510	1,219,860.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	149,500	74.350	11,115,325.000	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD	49,000	37.300	1,827,700.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	130,000	29.300	3,809,000.000	
CHINA FEIHE LTD	407,000	3.120	1,269,840.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,746,168	113.500	198,190,068.000	
JD.COM INC	241,735	112.200	27,122,667.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	186,000	8.600	1,599,600.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	270,800	46.020	12,462,216.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	252,600	21.260	5,370,276.000	
BILIBILI INC	24,420	142.600	3,482,292.000	
AKESO INC	65,000	87.950	5,716,750.000	
NETEASE INC	184,000	194.400	35,769,600.000	
REMEGEN CO LTD	19,000	70.000	1,330,000.000	
PONY AI INC	18,900	67.900	1,283,310.000	
GDS HOLDINGS LTD	110,100	34.380	3,785,238.000	
NONGFU SPRING CO LTD	198,600	42.620	8,464,332.000	
LI AUTO INC	122,500	54.700	6,700,750.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	110,650	37.980	4,202,487.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	63,200	43.040	2,720,128.000	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	41,800	175.500	7,335,900.000	
YUM CHINA HOLDINGS INC	36,250	339.200	12,296,000.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	134,300	35.940	4,826,742.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	52,800	173.100	9,139,680.000	
KE HOLDINGS INC	210,600	41.480	8,735,688.000	
JD LOGISTICS INC	189,500	12.890	2,442,655.000	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	42,400	26.980	1,143,952.000	
TRIP.COM GROUP LTD	62,850	377.400	23,719,590.000	
XPENG INC	127,700	59.550	7,604,535.000	
SENSETIME GROUP INC	2,742,000	1.480	4,058,160.000	
NIO INC	188,720	40.540	7,650,708.800	
SICHUAN KELUN-BIOTECH BIOPHARMACEUTICAL CO LTD	5,300	401.400	2,127,420.000	
MIDEA GROUP CO LTD	42,500	90.650	3,852,625.000	
WUXI XDC CAYMAN INC	37,500	46.400	1,740,000.000	
MINISO GROUP HOLDING LTD	49,000	26.000	1,274,000.000	
XTALPI HOLDINGS LTD	176,000	6.970	1,226,720.000	

	UBTECH ROBOTICS CORP LTD	20,550	112.400	2,309,820.000	
	HUA HONG GRACE SEMICONDUCTOR LTD	74,000	137.300	10,160,200.000	
	J&T GLOBAL EXPRESS LTD	229,400	8.790	2,016,426.000	
	HORIZON ROBOTICS INC	514,200	4.740	2,437,308.000	
	LAOPU GOLD CO LTD	4,500	450.800	2,028,600.000	
	CGN POWER CO LTD	1,071,000	3.030	3,245,130.000	
	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND CABLE JOINT STOCK LTD CO	39,000	231.400	9,024,600.000	
	ZIJIN GOLD INTERNATIONAL CO LTD	37,400	103.300	3,863,420.000	
	CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	17,600	653.500	11,501,600.000	
	HESAI GROUP	11,480	144.200	1,655,416.000	
	GF SECURITIES CO LTD	111,400	16.250	1,810,250.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	59,200	54.200	3,208,640.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	136,000	16.620	2,260,320.000	
	3SBIO INC	173,000	16.480	2,851,040.000	
	BOC AVIATION LTD	25,000	73.450	1,836,250.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	11.090	1,375,160.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	174,400	19.110	3,332,784.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	357,000	29.700	10,602,900.000	
	HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	1,180,000	1.380	1,628,400.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	43,400	55.000	2,387,000.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	82,000	14.920	1,223,440.000	
香港・ドル 小計		77,938,440		1,622,506,721.790 (33,245,162,729)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	53,009	2,365.000	125,366,285.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	69,258	796.000	55,129,368.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	48,314	645.000	31,162,530.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	710,401	16.950	12,041,296.950	
	GOLD CIRCUIT ELECTRONICS LTD	34,954	1,420.000	49,634,680.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	131,262	152.500	20,017,455.000	
	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	55,350	344.500	19,068,075.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	139,989	884.000	123,750,276.000	

QUANTA COMPUTER INC	273,369	380.500	104,016,904.500	
EVA AIRWAYS CORP	270,721	37.250	10,084,357.250	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	678,662	22.350	15,168,095.700	
CHINA STEEL CORP	1,259,775	18.700	23,557,792.500	
ADVANTECH CO LTD	47,796	465.500	22,249,038.000	
CHROMA ATE INC	38,774	2,210.000	85,690,540.000	
DELTA ELECTRONICS INC	202,978	2,200.000	446,551,600.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	406,096	144.000	58,477,824.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	185,636	118.000	21,905,048.000	
ELITE MATERIAL CO LTD	29,983	4,940.000	148,116,020.000	
EVERGREEN MARINE CORP	106,547	223.000	23,759,981.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	57,522	478.500	27,524,277.000	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	14,657	791.000	11,593,687.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	397,769	44.400	17,660,943.600	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	370,722	46.200	17,127,356.400	
KING YUAN ELECTRONICS CO LTD	112,907	272.000	30,710,704.000	
MEDIATEK INC	150,484	4,155.000	625,261,020.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	890,051	122.500	109,031,247.500	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	971,000	35.350	34,324,850.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	33,668	487.000	16,396,316.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	171,373	106.500	18,251,224.500	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,131,543	62.300	70,495,128.900	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,012,658	99.900	101,164,534.200	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,607,982	28.200	45,345,092.400	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,434,706	33.650	48,277,856.900	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,264,630	263.000	332,597,690.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,218,878	43.400	52,899,305.200	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,349	4,130.000	42,741,370.000	
TS FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,154,778	28.900	62,273,084.200	
INVENTEC CO LTD	250,778	66.200	16,601,503.600	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	202,479	213.000	43,128,027.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,267,856	33.000	41,839,248.000	

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,758,000	68.200	119,895,600.000	
ASIA VITAL COMPONENTS CO LTD	33,578	2,360.000	79,244,080.000	
MPI CORP	9,017	5,770.000	52,028,090.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,131,807	30.550	34,576,703.850	
NAN YA PLASTICS CORP	502,923	94.800	47,677,100.400	
WISTRON CORP	299,126	158.000	47,261,908.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	503,007	74.400	37,423,720.800	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,940	227.500	12,953,850.000	
E INK HOLDINGS INC	83,129	191.000	15,877,639.000	
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM CO LTD	21,809	799.000	17,425,391.000	
TCC GROUP HOLDINGS	675,532	23.900	16,145,214.800	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,565,700	2,255.000	5,785,653,500.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,185,962	118.500	140,536,497.000	
WAN HAI LINES LTD	63,482	83.100	5,275,354.200	
YAGEO CORP	162,704	819.000	133,254,576.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	163,095	50.600	8,252,607.000	
KING SLIDE WORKS CO LTD	6,097	6,370.000	38,837,890.000	
GLOBAL UNICHIP CORP	9,196	4,025.000	37,013,900.000	
INNOLUX CORPORATION	784,074	44.300	34,734,478.200	
LOTES CO LTD	8,806	2,175.000	19,153,050.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,253	2,980.000	18,633,940.000	
JENTECH PRECISION INDUSTRIAL CO LTD	8,859	3,800.000	33,664,200.000	
PEGATRON CORP	219,164	94.800	20,776,747.200	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	7,967	4,040.000	32,186,680.000	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,474	1,285.000	18,599,090.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	155,328	119.500	18,561,696.000	
BIZLINK HOLDING INC	17,869	2,155.000	38,507,695.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	79,150	502.000	39,733,300.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,119,256	23.800	26,638,292.800	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	425,231	42.050	17,880,963.550	
ASPEED TECHNOLOGY INC	3,177	16,840.000	53,500,680.000	
WIWYNN CORP	10,950	5,065.000	55,461,750.000	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	347,702	539.000	187,411,378.000	
PHARMAESSENTIA CORP	28,915	986.000	28,510,190.000	

	CALIWAY BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	95,155	88.400	8,411,702.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	26,434	775.000	20,486,350.000	
	HON PRECISION INC	8,481	6,840.000	58,010,040.000	
台湾・ドル 小計		32,068,013		10,521,187,478.100 (53,304,544,239)	
南アフリカ・ ランド	BIDVEST GROUP LTD	32,012	230.960	7,393,491.520	
	CLICKS GROUP LTD	26,121	235.240	6,144,704.040	
	DISCOVERY LTD	57,591	275.360	15,858,257.760	
	GOLD FIELDS LTD	93,156	557.860	51,968,006.160	
	REMGRO LTD	47,647	183.920	8,763,236.240	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	58,146	240.860	14,005,045.560	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,155	4,370.260	40,009,730.300	
	MTN GROUP LTD	180,874	214.460	38,790,238.040	
	FIRSTRAND LTD	536,179	91.510	49,065,740.290	
	NASPERS LTD	78,857	886.000	69,867,302.000	
	NEDBANK GROUP LTD	47,000	254.920	11,981,240.000	
	VALTERRA PLATINUM LIMITED	26,909	1,123.630	30,235,759.670	
	SASOL LTD	59,212	225.500	13,352,306.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	47,584	290.000	13,799,360.000	
	STANDARD BANK GROUP LTD	139,430	311.280	43,401,770.400	
	ABSA GROUP LTD	91,225	232.000	21,164,200.000	
	SANLAM LTD	186,989	84.500	15,800,570.500	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	100,431	179.620	18,039,416.220	
	OUTSURANCE GROUP LTD	88,389	70.560	6,236,727.840	
	VODACOM GROUP PTY LTD	60,033	147.990	8,884,283.670	
	NEPI ROCKCASTLE NV	57,465	140.480	8,072,683.200	
	REINET INVESTMENTS SCA	14,066	464.170	6,529,015.220	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	348,081	20.960	7,295,777.760	
	SIBANYE STILLWATER LTD	291,568	38.560	11,242,862.080	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	37,574	246.470	9,260,863.780	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	52,679	1,311.800	69,104,312.200	
	BID CORP LTD	34,891	417.540	14,568,388.140	
南アフリカ・ランド 小計		2,803,264		610,835,288.590 (5,925,102,299)	
合計		373,075,213		199,184,993,425 (199,184,993,425)	

(2) 株式以外の有価証券

2026年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益 証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	121,900.000	5,997,480.000	

有価証券報告書（内国役員）

		ENERGISA SA	31,460.000	1,445,587.000	
		KLABIN SA	79,032.000	1,332,479.520	
	ブラジル・リアル 小計		232,392.000	8,775,546.520 (271,683,022)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,540,075.000	31,771,747.250	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	59,700.000	10,825,401.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	180,905.000	38,847,539.700	
	メキシコ・ペソ 小計		1,780,680.000	81,444,687.950 (751,701,891)	
	投資信託受益証券 合計			2,013,072	1,023,384,913 (1,023,384,913)
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	275,500.000	7,810,425.000	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA DE CV	112,105.000	9,025,573.550	
	メキシコ・ペソ 小計		387,605.000	16,835,998.550 (155,389,533)	
	投資証券 合計			387,605	155,389,533 (155,389,533)
合計				1,178,774,446 (1,178,774,446)	

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

（注）

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 37銘柄	1.58	—	—	1.67
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 16銘柄	1.03	—	—	1.09
インド・ルピー	株式 164銘柄	10.57	—	—	11.17
インドネシア・ルピア	株式 11銘柄	0.45	—	—	0.47
オフショア・人民元	株式 402銘柄	3.47	—	—	3.66
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.47	—	—	0.50
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.52	—	—	0.55
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.14	—	—	0.15
サウジアラビア・リアル	株式 33銘柄	2.40	—	—	2.53
タイ・バーツ	株式 18銘柄	0.94	—	—	1.00
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.10	—	—	0.11
チリ・ペソ	株式 10銘柄	0.41	—	—	0.43
トルコ・リラ	株式 11銘柄	0.35	—	—	0.37
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.30	—	—	0.32

フィリピン・ペソ	株式	10銘柄	0.27	—	—	0.29
ブラジル・レアル	株式	38銘柄	3.02	—	—	3.33
	投資信託受益証券	3銘柄	—	0.13	—	
ポーランド・ズロチ	株式	16銘柄	0.99	—	—	1.05
マレーシア・リンギット	株式	21銘柄	0.90	—	—	0.95
メキシコ・ペソ	株式	16銘柄	1.16	—	—	1.67
	投資信託受益証券	3銘柄	—	0.36	—	
	投資証券	2銘柄	—	—	0.07	
ユーロ	株式	10銘柄	0.48	—	—	0.51
韓国・ウォン	株式	77銘柄	20.85	—	—	22.03
香港・ドル	株式	159銘柄	15.71	—	—	16.59
台湾・ドル	株式	77銘柄	25.18	—	—	26.60
南アフリカ・ランド	株式	27銘柄	2.80	—	—	2.96

（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6月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	652,095,095
コール・ローン	174,453,070
国債証券	104,931,030,685
未収利息	1,259,481,154
前払費用	283,469,252
流動資産合計	107,300,529,256
資産合計	107,300,529,256
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	252,526
未払解約金	192,402,000
流動負債合計	192,654,526
負債合計	192,654,526
純資産の部	
元本等	
元本	37,701,326,347
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	69,406,548,383
元本等合計	107,107,874,730
純資産合計	107,107,874,730
負債純資産合計	107,300,529,256

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年6月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,986,526,568円
同期中追加設定元本額	15,488,582,220円
同期中一部解約元本額	20,773,782,441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）	5,776,864,718円
たわらノーロード バランス（堅実型）	200,251,896円
たわらノーロード バランス（標準型）	837,983,597円
たわらノーロード バランス（積極型）	496,406,608円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	691,344円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	4,838,845円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	46,261,147円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	9,338,858円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	6,792,637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
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	250,831,915円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	453,732,465円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国30）	998,165,019円
投資のソムリエ	5,999,947,898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＞	1,295,021,470円
D I A M 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	1,042,616,450円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,723,119,914円
ワールドアセットバランス（基本コース）	133,019,770円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	281,859,204円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	175,553,367円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	91,527,852円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	12,024,142円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	462,006,071円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	452,466,693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）	202,276,211円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	111,066,920円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	61,848,843円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	26,690,067円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,258,700円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	6,089,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070）	1,025,172円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	13,898,870,509円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	27,447,067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）	452,974,820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）	537,450,627円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	4,280,843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）	49,722,692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）	22,459,816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）	745,743,956円
計	37,701,326,347円
2. 受益権の総数	37,701,326,347口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2025年12月12日 至 2026年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年6月11日現在
----	--------------

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年6月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,628,513,607
合計	△1,628,513,607

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2026年4月21日から2026年6月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年6月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	229,000,000	—	229,252,526	△252,526
アメリカ・ドル	229,000,000	—	229,252,526	△252,526
合計	229,000,000	—	229,252,526	△252,526

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲

値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8410円 (28,410円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2026年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	2,200,000.000	1,932,692.490	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	3,100,000.000	2,699,307.730	
		ABU DHABI GOVT INT'L 4.875 04/30/29	2,500,000.000	2,521,707.900	
		ABU DHABI GOVT INT'L 5.0 04/30/34	1,000,000.000	1,012,752.820	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	6,000,000.000	5,508,600.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	9,000,000.000	8,539,650.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	4,400,000.000	3,205,400.000	
		BRAZIL 5.5 02/04/33	2,000,000.000	1,952,800.000	
		BRAZIL 5.5 11/06/30	1,400,000.000	1,406,160.000	
		BRAZIL 6.0 10/20/33	7,000,000.000	6,965,000.000	
		BRAZIL 6.125 01/22/32	6,000,000.000	6,103,500.000	
		BRAZIL 6.125 03/15/34	5,000,000.000	5,002,500.000	
		BRAZIL 6.25 03/18/31	7,000,000.000	7,213,850.000	
		BRAZIL 6.25 05/22/36	3,000,000.000	2,923,500.000	
		BRAZIL 6.625 03/15/35	3,000,000.000	3,048,300.000	
		BRAZIL 7.125 05/13/54	5,000,000.000	4,961,250.000	
		BRAZIL 7.25 01/12/56	4,500,000.000	4,463,550.000	
		CHINA GOVT INTL BOND 3.625 11/13/28	5,300,000.000	5,260,804.270	
		CHINA GOVT INTL BOND 3.75 11/13/30	3,000,000.000	2,968,221.570	
		COLOMBIA 5.375 01/21/29	3,000,000.000	2,983,650.000	
		COLOMBIA 7.375 04/25/30	6,000,000.000	6,306,000.000	
		COLOMBIA 7.5 02/02/34	7,000,000.000	7,392,000.000	
		COLOMBIA 8.0 04/20/33	7,000,000.000	7,588,000.000	
		COLOMBIA 8.0 11/14/35	5,000,000.000	5,452,500.000	

COLOMBIA 8.375 11/07/54	2,000,000.000	2,260,000.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41	2,000,000.000	1,769,000.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	4,000,000.000	4,003,800.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 10/28/35	5,000,000.000	4,886,250.000	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	7,800,000.000	7,794,150.000	
DOMINICAN REPUBLIC 6.15 05/17/38	3,000,000.000	2,933,400.000	
DOMINICAN REPUBLIC 6.95 03/15/37	4,000,000.000	4,169,800.000	
HUNGARY 2.125 09/22/31	7,500,000.000	6,484,049.250	
HUNGARY 3.125 09/21/51	4,000,000.000	2,510,569.640	
HUNGARY 5.25 06/16/29	5,000,000.000	5,067,769.750	
HUNGARY 5.375 09/26/30	6,000,000.000	6,100,053.060	
HUNGARY 5.5 03/26/36	4,000,000.000	3,993,175.080	
HUNGARY 6.125 05/22/28	6,000,000.000	6,145,722.720	
HUNGARY 6.25 09/22/32	7,000,000.000	7,354,900.000	
HUNGARY 6.75 09/23/55	9,000,000.000	9,674,380.530	
INDONESIA 1.85 03/12/31	4,700,000.000	4,100,690.580	
INDONESIA 3.4 09/18/29	3,700,000.000	3,586,361.530	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,000,000.000	3,518,503.880	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	2,000,000.000	2,102,386.560	
PANAMA 4.5 01/19/63	4,000,000.000	3,039,400.000	
PANAMA 6.4 02/14/35	6,600,000.000	6,956,400.000	
PERU 3.0 01/15/34	7,000,000.000	6,023,500.000	
PERU 5.5 03/30/36	1,000,000.000	1,003,650.000	
PERU 5.875 08/08/54	7,000,000.000	6,847,750.000	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	4,136,917.980	
PHILIPPINES 5.0 01/27/36	3,000,000.000	2,911,641.450	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	10,000,000.000	8,521,500.000	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	2,200,000.000	2,176,350.000	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	8,200,000.000	7,404,600.000	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	2,000,000.000	1,746,500.000	
REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29	6,000,000.000	6,050,100.000	
REPUBLIC OF CHILE 4.95 01/05/36	1,000,000.000	982,100.000	
REPUBLIC OF CHILE 5.65 01/13/37	6,000,000.000	6,186,300.000	
REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29	7,600,000.000	7,648,212.040	

REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33	5,000,000.000	4,979,440.700	
REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34	1,000,000.000	1,001,296.000	
REPUBLIC OF POLAND 5.375 02/12/35	5,000,000.000	5,060,570.800	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54	12,000,000.000	11,134,471.200	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53	9,000,000.000	8,367,786.450	
REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27	6,000,000.000	6,111,177.840	
REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32	8,500,000.000	8,906,285.210	
REPUBLIC OF POLAND 6.125 04/14/56	3,000,000.000	2,996,937.060	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.442 02/14/37	7,200,000.000	7,322,400.000	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34	5,000,000.000	5,207,500.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	7,000,000.000	4,708,333.350	
ROMANIA 5.75 03/24/35	5,000,000.000	4,826,197.050	
ROMANIA 5.75 07/04/36	1,700,000.000	1,613,760.390	
ROMANIA 5.875 01/30/29	9,000,000.000	9,109,011.600	
ROMANIA 6.375 01/30/34	4,900,000.000	4,940,922.300	
ROMANIA 6.625 02/17/28	4,000,000.000	4,099,802.320	
ROMANIA 6.625 05/16/36	7,000,000.000	7,117,513.550	
ROMANIA 7.125 01/17/33	7,000,000.000	7,413,743.190	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.125 01/12/29	700,000.000	690,818.660	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	7,000,000.000	6,947,833.690	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	4,000,000.000	3,966,445.280	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/16/30	12,000,000.000	11,988,054.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33	6,000,000.000	5,967,361.920	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/16/34	7,000,000.000	6,990,581.290	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53	9,000,000.000	7,712,359.380	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.375 01/13/31	9,000,000.000	9,196,763.850	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	9,000,000.000	9,271,987.290	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54	6,000,000.000	5,708,061.600	
SOUTH AFRICA 6.125 12/11/37	14,900,000.000	14,520,936.550	

SOUTH AFRICA 7.1 11/19/36	17,000,000.000	18,094,446.570	
SOUTH AFRICA 7.25 12/11/55	3,200,000.000	3,134,752.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	7,000,000.000	6,976,814.040	
SOUTH AFRICA 7.95 11/19/54	6,800,000.000	7,223,593.820	
TURKEY 6.3 03/14/33	3,000,000.000	2,904,207.360	
TURKEY 6.5 01/03/35	7,000,000.000	6,754,726.790	
TURKEY 6.5 09/20/33	6,000,000.000	5,863,676.280	
TURKEY 6.8 11/04/36	6,300,000.000	6,130,199.250	
TURKEY 6.95 09/16/35	7,100,000.000	7,024,658.350	
TURKEY 7.125 02/12/32	3,000,000.000	3,054,517.980	
TURKEY 7.125 07/17/32	4,000,000.000	4,071,861.440	
TURKEY 7.25 05/29/32	6,000,000.000	6,119,963.100	
TURKEY 7.625 05/15/34	6,000,000.000	6,237,948.960	
TURKEY 8.6 09/24/27	3,000,000.000	3,123,960.630	
TURKEY 9.125 07/13/30	5,800,000.000	6,363,039.460	
TURKEY 9.375 01/19/33	3,000,000.000	3,382,165.410	
TURKEY 9.375 03/14/29	9,500,000.000	10,308,057.170	
TURKEY 9.875 01/15/28	5,200,000.000	5,537,469.440	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	2,700,000.000	2,615,381.890	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	10,000,000.000	8,815,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	8,000,000.000	6,788,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	2,000,000.000	1,193,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	7,000,000.000	4,989,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	2,000,000.000	1,473,600.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/22/31	6,000,000.000	5,855,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	10,700,000.000	10,100,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.85 07/02/32	3,000,000.000	3,019,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/07/36	5,500,000.000	5,439,225.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.0 05/13/30	7,500,000.000	7,702,875.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.125 02/09/38	2,700,000.000	2,631,555.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53	2,000,000.000	1,863,500.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35	8,000,000.000	8,148,000.000	

		UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54	6,000,000.000	5,620,500.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.875 05/13/37	9,000,000.000	9,386,550.000	
		アメリカ・ドル 小計		668,600,000.000 (107,383,846,000)	653,328,128.290 (104,931,030,685)
	国債証券 合計		107,383,846,000 (107,383,846,000)	104,931,030,685 (104,931,030,685)	
合計				104,931,030,685 (104,931,030,685)	

（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 121銘柄	97.97	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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2026年6月30日現在

I 資産総額	3,789,074,297円
II 負債総額	42,013,926円
III 純資産総額（I－II）	3,747,060,371円
IV 発行済数量	3,548,339,461口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0560円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2026年6月30日現在

I 資産総額	9,984,186,071円
II 負債総額	85,358,960円
III 純資産総額（I－II）	9,898,827,111円
IV 発行済数量	10,064,542,878口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.9835円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	142,283,531,653円
II 負債総額	134,798,016円
III 純資産総額（I－II）	142,148,733,637円
IV 発行済数量	51,449,465,745口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.7629円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2026年6月30日現在

I 資産総額	117,624,233,493円
II 負債総額	4,255,953,231円
III 純資産総額（I－II）	113,368,280,262円
IV 発行済数量	38,983,370,830口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.9081円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2026年6月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2026年6月30日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は原則として月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用担当部署の部長等で構成されます。

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

3【委託会社等の経理状況】

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

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	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ェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

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

（損益計算書関係）

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

（百万円）

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

※2. 固定資産売却益

固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2025年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（百万円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生（予定）日
2026年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	22,000	550,000	2026年3月31日	2026年6月17日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第40期（2025年3月31日現在）

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

第41期（2026年3月31日現在）

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

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

（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第40期（2025年3月31日現在）

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

第41期（2026年3月31日現在）

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第40期（2025年3月31日現在）

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

第41期（2026年3月31日現在）

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券

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

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第40期（2025年3月31日現在）

（百万円）

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

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

第41期（2026年3月31日現在）

（百万円）

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

該当はありません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（百万円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（百万円）

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

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

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

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

（企業結合等関係）

（取得による企業結合）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a.発生したのれん金額 76,224百万円

b.発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c.のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a.資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b.負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a.無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b.主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c.全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	53,066百万円	46,634百万円
資産合計	53,066百万円	46,634百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	561百万円	－百万円
負債合計	561百万円	－百万円
純資産	52,505百万円	46,634百万円
(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	43,829百万円	40,018百万円
顧客関連資産	13,661百万円	10,603百万円

(2) 損益計算書項目

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△7,259百万円	△6,868百万円
経常利益	△7,259百万円	△6,868百万円
税引前当期純利益	△7,259百万円	△6,868百万円
当期純利益	△6,298百万円	△5,870百万円
1株当たり当期純利益	△157,468円47銭	△146,764円94銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	3,447百万円	3,057百万円

(共通支配下の取引等)

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当社は、2024年4月1日に株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という。親会社）及び第一生命ホールディングス株式会社（その他の関係会社）へ以下の現物配当を行いました。

1. 取引の概要

(1) 取引内容

Asset Management One USA Inc.(当社の子会社)株式の現物配当

(2) 効力発生日

2024年4月1日

(3) 取引の総額

575百万円

(4) その他取引の概要に関する事項

本現物配当は、MHFGの子会社である米州みずほLLCが、2024年10月1日に米国外国銀行規制上の中間持株会社へ移行することに伴う規制上の対応として実施したものです。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成31年1月16日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成31年1月16日）に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(資産除去債務関係)

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
委託者報酬	111,988百万円	115,972百万円
運用受託報酬	16,520百万円	18,429百万円
投資助言報酬	2,374百万円	1,997百万円
成功報酬（注）	1,754百万円	6,463百万円
その他営業収益	30百万円	24百万円
合計	132,668百万円	142,888百万円

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）及び第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（持分法損益等）

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は 出資金	事業 の 内容 又は 職業	議決権 等の 所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区	22,567億円	持株会社	(被所有) 直接51%	—	持株会社	現物配当	402	-	-
その他の関係会社	第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区	3,443億円	持株会社	(被所有) 直接49%	—	持株会社	現物配当	172	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 現物配当の詳細については、（株主資本等変動計算書関係）2. 配当に関する事項及び（企業結合等関係）（共通支配下の取引等）に記載しております。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

該当はありません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は 出資金	事業 の 内容 又は 職業	議決権 等の 所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社の	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	—	—	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手数料	9,048	未払 手数料	1,976
子会社	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	—	—	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手数料	20,086	未払 手数料	3,306

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は 出資金	事業 の 内容 又は 職 業	議決権 等の 所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼 任 等	事業上 の 関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行 業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,462	未払 手数料	2,204
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券 業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	21,894	未払 手数料	3,421

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
1株当たり純資産額	2,107,956円73銭	2,251,656円50銭
1株当たり当期純利益金額	358,173円51銭	429,699円67銭

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

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

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
当期純利益金額	14,326百万円	17,187百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,326百万円	17,187百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は2025年5月14日付で100%子会社であるAsset Management One Singapore Pte. Ltd. を清算しました。

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社は2025年12月26日付で清算終了しました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2026年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行（※1）	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社（※1）	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

（注）資本金の額は2026年3月末日現在

（※1）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

(3) 投資顧問会社

名称	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社
資本金の額	200百万円（2026年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、各ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2026年3月11日	有価証券報告書
2026年3月11日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2026年5月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 稲 葉 宏 和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2025年4月1日から2026年3月31日までの第41期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2026年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2026年8月7日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（基本コース）の2025年12月12日から2026年6月11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、ワールドアセットバランス（基本コース）の2026年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2026年8月7日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2025年12月12日から2026年6月11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、ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2026年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。