

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2026年5月25日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 杉原 規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	積木 利浩
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DIAM DC バランス30インデックスファンド DIAM DC バランス50インデックスファンド DIAM DC バランス70インデックスファンド
【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

DIAM DC バランス50インデックスファンド

DIAM DC バランス70インデックスファンド

(以上を総称して、または個別に「DIAM DC バランスインデックスファンド」、「ファンド」、「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また各々、「DIAM DC バランス30インデックスファンド」を「DC バランス30インデックスファンド」、「DIAM DC バランス50インデックスファンド」を「DC バランス50インデックスファンド」、「DIAM DC バランス70インデックスファンド」を「DC バランス70インデックスファンド」という場合もあります。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権(以下「受益権」といいます。)

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

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <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）

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2026年5月26日から2026年11月25日まで

ニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券
取引所、ロンドン証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合
があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

(8) 【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 委託会社への照会

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うも
のとしします。

各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定
する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を
行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

(10)【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積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は、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。

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

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

なお、海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

各ファンドの信託金の限度額は1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 ライフサイクルにあわせた分散投資

- 主としてマザーファンド*を通じて実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券の4つのアセット(資産)に投資します。

*国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

- 個々のアセット(資産)において、数多くの銘柄に分散して投資することにより、より一層の分散投資効果を追求します。
- 基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックス*に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。
- 運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

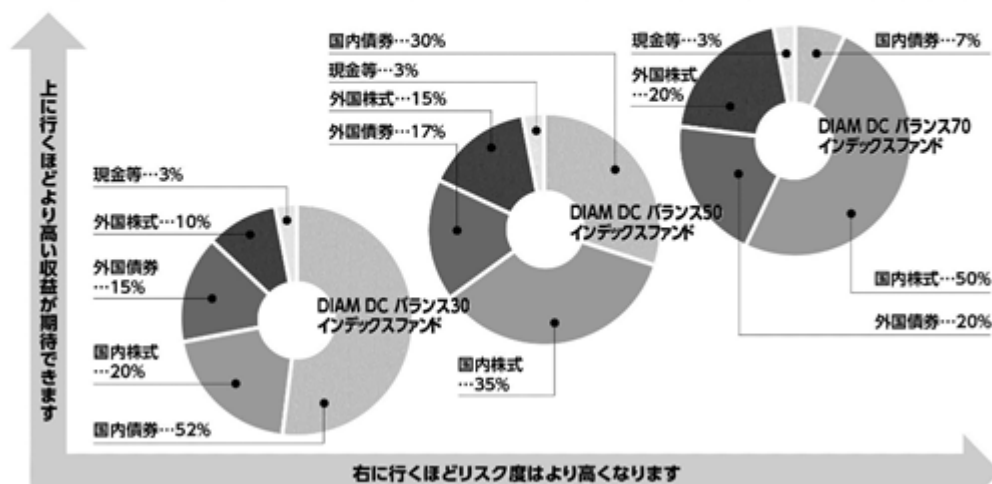
(※)当社が独自に指数化した合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

2 ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

ご投資家の皆様のライフサイクルやリスク許容度に応じて、3種類の組み合わせ(資産配分)からご選択いただけます。

3ファンドの基本アロケーション

(注)運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。



各ファンドは、同一のマザーファンドに投資を行うため、値動きの大きい株式・外国証券への投資割合が高いほど、リスク・リターンともより高くなります。

●DIAM DC バランス30インデックスファンド

比較的リスクの低い資産(国内債券)を中心に組入れ、安定運用を行います。

●DIAM DC バランス50インデックスファンド

各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスク・ミドルリターンをめざします。

●DIAM DC バランス70インデックスファンド

株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年2月25日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

DIAM DC バランス30インデックスファンド

DIAM DC バランス50インデックスファンド

DIAM DC バランス70インデックスファンド

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)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

DIAM DC バランス30インデックスファンド

DIAM DC バランス50インデックスファンド

DIAM DC バランス70インデックスファンド

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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	その他 (MSCIコクサ イ・インデック ス、NOMURA -BPI総合、 FTSE世界国債イン デックス)
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

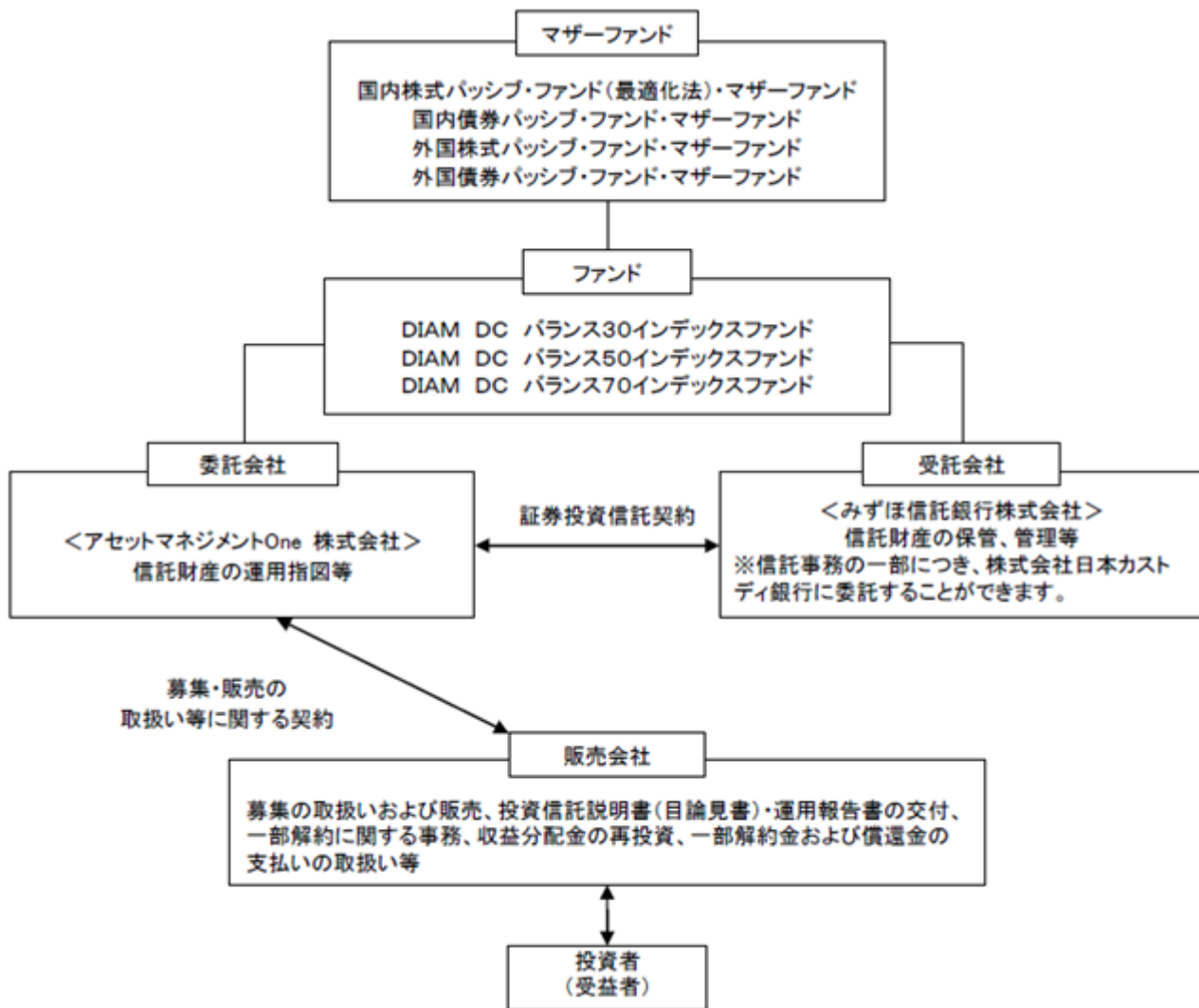
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式、債券） 資産配分固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

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/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2006年12月27日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

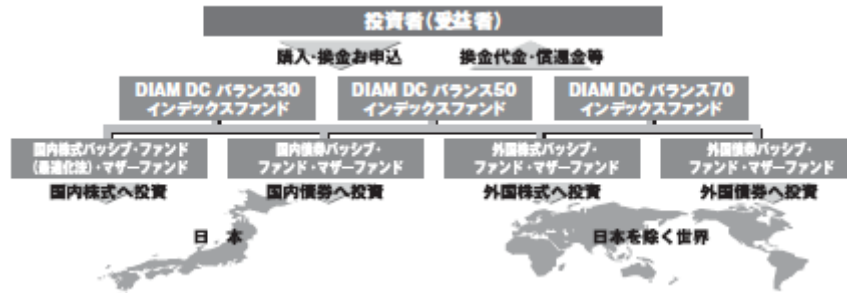
- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

「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の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2月27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ルリュ・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4月1日現在）

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

株式会社第一ライフグループ	東京都千代田区有楽町一丁目13 番1号	12,000株	30.0% ²
---------------	------------------------	---------	--------------------

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として、安定的な運用を行います。

<投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

(1)主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券および外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。

(2)「DIAMDC バランス30インデックスファンド」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が40%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が35%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

「DIAMDC バランス50インデックスファンド」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が60%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が45%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

「DIAMDC バランス70インデックスファンド」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が80%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が50%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式については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)、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

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限りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、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。

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。

(3)各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。なお、運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

(4)実質組入れ外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成インデックスに連動させるため、以下の対応を行います。

基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針 (2)投資対象 (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要をご参照ください。

(2)【投資対象】

1.投資の対象とする資産(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項で定めるものをいいます、以下同じ。)

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。)

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.有価証券の指図範囲(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(4)までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券ならびに(5)以降の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

(1)国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(2)外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3)国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

- (4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 - (5) 株券または新株引受権証書
 - (6) 国債証券
 - (7) 地方債証券
 - (8) 特別の法律により法人の発行する債券
 - (9) 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。）
 - (10) 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。）
 - (11) 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。）
 - (12) 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。）
 - (13) 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。）
 - (14) コマーシャル・ペーパー
 - (15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - (16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、(5)～(15)までの証券または証書の性質を有するもの
 - (17) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
 - (18) 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。）
 - (19) 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。）
 - (20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - (21) 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。）
 - (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - (23) 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。）
 - (24) 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。）
 - (25) 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
 - (26) 外国の者に対する権利で(25)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)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、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第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を指図することができます。

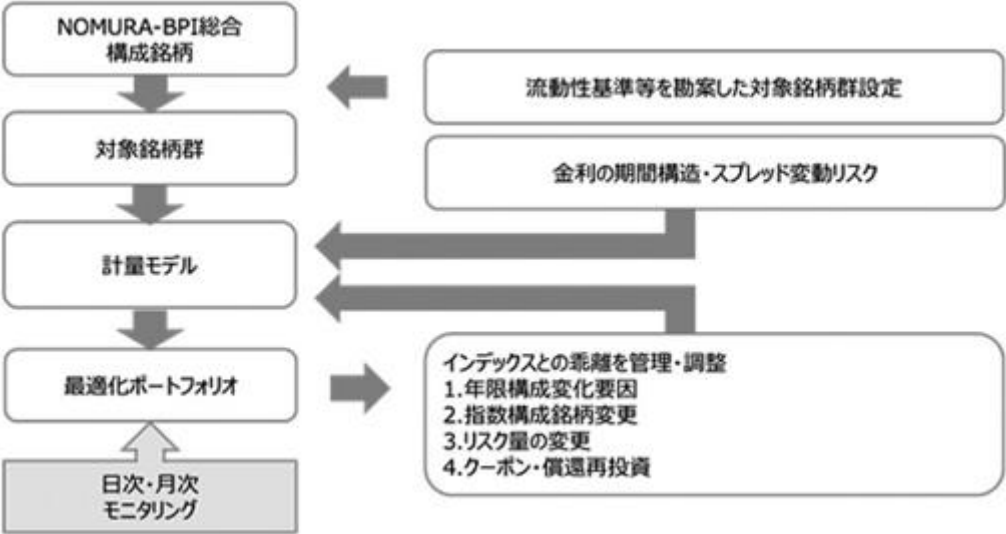
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5) の権利の性質を有するもの
4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3. の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。(約款第17条第3項)

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none">1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

<p>運用プロセス</p>	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
<p>主な投資制限</p>	<p>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4. 一般社団法人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。</p>

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p>

主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
運用プロセス	<p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2. 最適化法によるポートフォリオの構築 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因、 が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資 

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

ファンド名	外国株式パッシブ・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	<ol style="list-style-type: none"> 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。

運用プロセス

1. 流動性基準による対象銘柄群設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

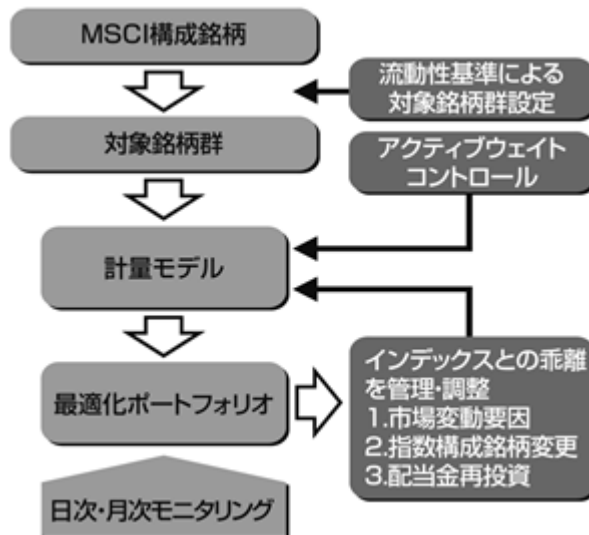
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス

1.流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

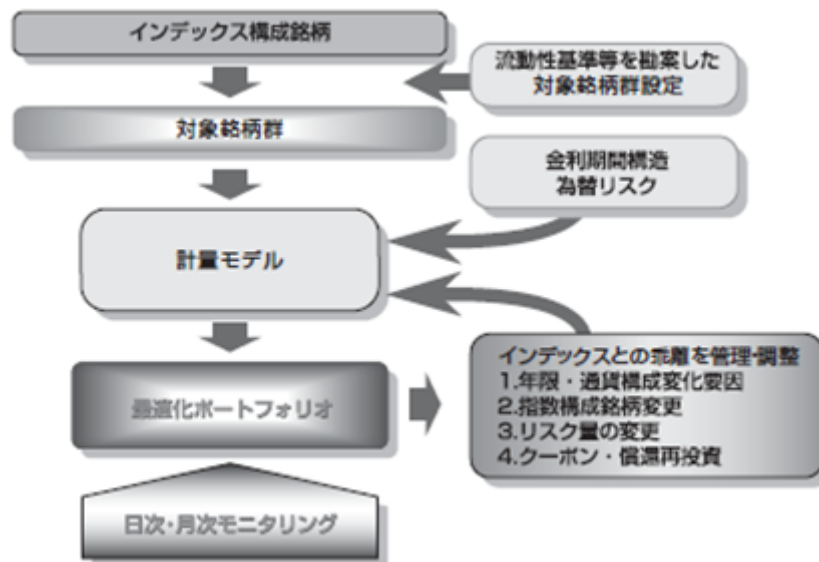
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン・償還再投資

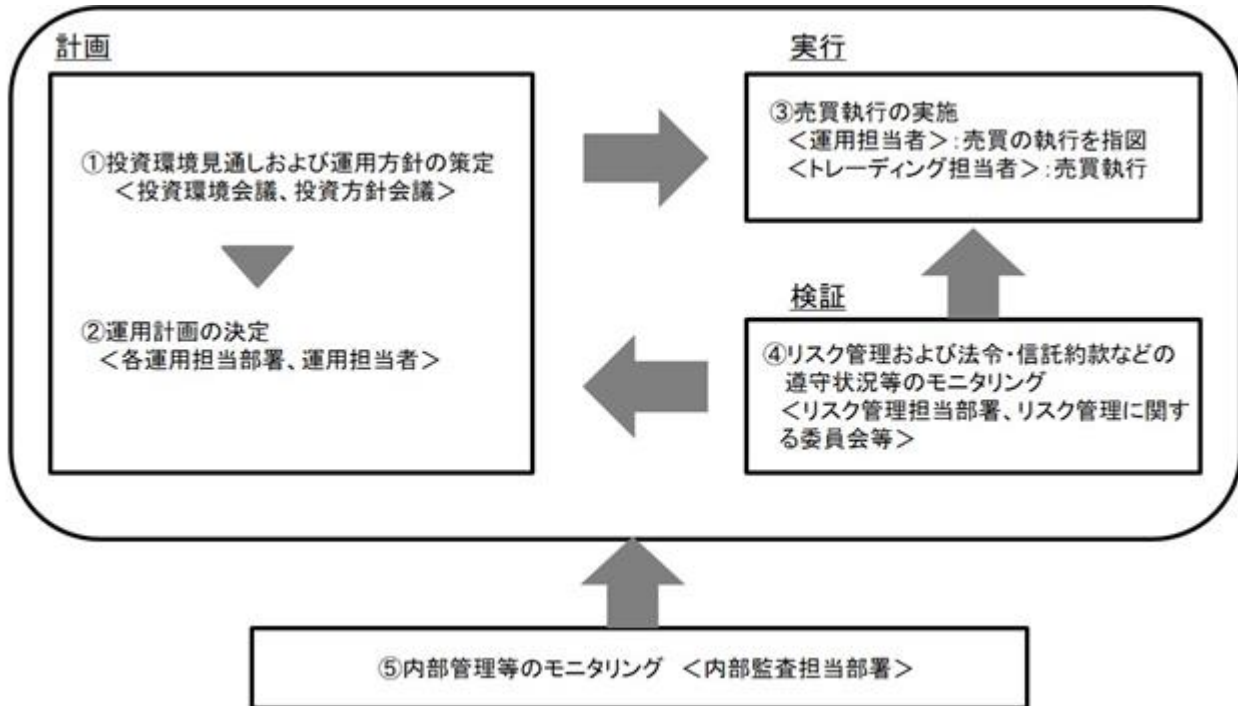


主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動に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。
--------	--

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



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。

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。

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。

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。

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

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2月27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】

収益分配方針

毎決算時(原則毎年2月25日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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ことがあります。

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

1) 信託財産に属する配当等収益(利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当す

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

- b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を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、別に定める契約に基づき、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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】

「DIAM DC バランス30インデックスファンド」

- (1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

- (2) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の35%以下とします。

「DIAM DC バランス50インデックスファンド」

- (1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

- (2) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。

「DIAM DC バランス70インデックスファンド」

- (1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%以下とします。

- (2) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

共通

- (3)投資信託証券への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）
各マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (4)新株引受権証券等への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）
新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の15%以下とします。
- (5)一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）
- (6)投資する株式等の範囲（約款第20条）
- (a)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。
- (b)上記(a)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。
- (7)同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限（約款第21条）
- (a)委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- (b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (8)同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第22条）
- (a)委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- (b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(9)信用取引の指図範囲(約款第23条)

(a)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。

(b)上記(a)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・目的・範囲(約款第24条)

(a)委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券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。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内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・オプションの売付けの指図は、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・オプションの売付けの指図は、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、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け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.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している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上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している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、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。

(b)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(c)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、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内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・オプションの売付けの指図は、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.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、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・オプションの売付けの指図は、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.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額(「金融商品運用額等」といいます。)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を差し引いた額。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け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・オプションの買付けの指図は、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。

(11)スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第25条)

(a)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格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。

- (b)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。
 - (c)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(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)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、上記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。
 - (d)上記(c)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。
 - (e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
 - (f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (12)金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第26条)
- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格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。
 - (b)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。
 - (c)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。)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。)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。
 - (d)上記(c)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。

(e) 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。）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、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(f) 上記(e)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。

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

(h) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(13) デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条の2）

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

(14) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

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

(b) 上記(a)1)～2)で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。

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

(15) 公社債の空売りの指図範囲（約款第28条）

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(b) 上記(a)の売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(16) 公社債の借入れ（約款第29条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d) 上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- (17) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第31条)
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- (18) 外国為替予約の指図(約款第32条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (b) 上記(a)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、信託財産にかかる為替の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が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (c) 上記(b)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。
- (d) 上記(b)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。
- (19) 資金の借入れ(約款第39条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、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。
- (b) 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。

(c)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。

(d)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

(1)株式投資リスク

各ファンドでは実質的に株式に投資します。株式には一般的に次に掲げるリスクがあります。

1)価格変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により、各ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

2)信用リスク

投資する株式の発行者の経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式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。

(2)債券投資リスク

各ファンドでは実質的に債券に投資します。債券では、一般に次に掲げるリスクがあります。

1)金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に、金利が上昇した場合には、債券の価格は下落し、各ファンドの基準価額が下がる要因となります。

2)信用リスク

投資する債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。

各ファンドが実質的に投資する債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、債券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。

(3)為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドでは実質的に外貨建資産を保有します。外貨建資産に投資する場合には、一般に為替リスクがあります。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、各ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また、外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。各ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としており、円と投資対象国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に影響します。

(4)資産配分リスク

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

各ファンドで行われる各資産（国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産）の資産配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

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

(5)カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する要因となる場合があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

各ファンドは、各マザーファンドへの投資を通じて合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流出入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成インデックスが乖離する場合があります。

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

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

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

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、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、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。

各ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

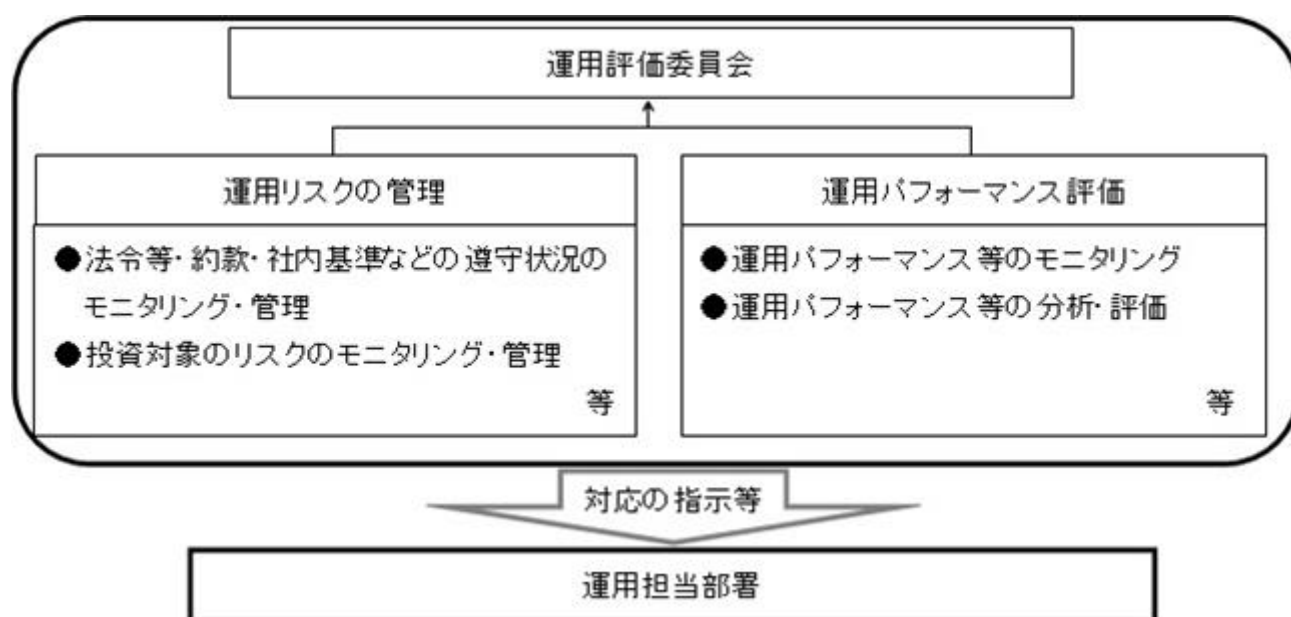
注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- 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2月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

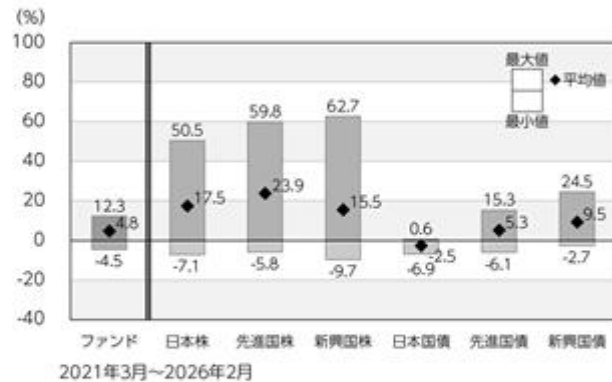
<参考情報>

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

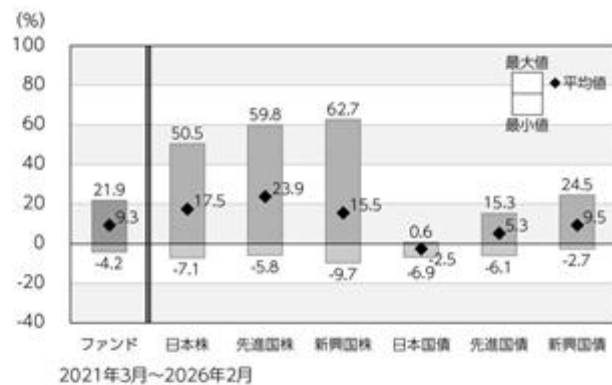
DIAM DC バランス30インデックスファンド



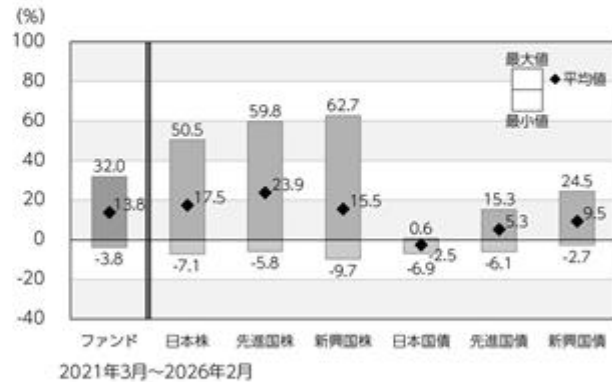
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



DIAM DC バランス50インデックスファンド



DIAM DC バランス70インデックスファンド



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

以下により計算される と の合計額とします。

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.264%～年率0.330%（税抜0.24%～税抜0.30%）の率を乗じて得た額

ファンド名	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬 税込（税抜）			
DIAMDC バランス30 インデックスファンド 年率0.264%（税抜0.24%）	0.090%	0.120%	0.030%
DIAMDC バランス50 インデックスファンド 年率0.297%（税抜0.27%）	0.105%	0.135%	0.030%
DIAMDC バランス70 インデックスファンド 年率0.330%（税抜0.30%）	0.120%	0.150%	0.030%
主な役務	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

^{*}2026年5月26日現在は、品貸料の49.5%（税抜45%）以内になります。委託会社と受託会社が受け取る品貸料の配分は1：1の割合となります。

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

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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。

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。

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、毎年8月25日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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。

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、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2026年2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 >

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。

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

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、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、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
DIAM DC バランス30インデックスファンド	0.27%	0.26%	0.01%
DIAM DC バランス50インデックスファンド	0.31%	0.30%	0.01%
DIAM DC バランス70インデックスファンド	0.34%	0.33%	0.01%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2025年2月26日~2026年2月25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】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

2026年2月27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	6,387,440,498	97.04
内 日本	6,387,440,498	97.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	194,854,313	2.96
純資産総額	6,582,294,811	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。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

2026年2月27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	13,515,426,867	97.08
内 日本	13,515,426,867	97.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	406,178,721	2.92
純資産総額	13,921,605,588	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。

DIAM DC バランス70インデックスファンド

2026年2月27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	12,762,296,613	97.06
内 日本	12,762,296,613	97.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	386,324,461	2.94
純資産総額	13,148,621,074	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	863,217,024,410	98.04
内 日本	863,217,024,410	98.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,241,708,800	1.96
純資産総額	880,458,733,210	100.00

その他資産の投資状況

2026年2月27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)	17,083,440,000	1.94
内 日本	17,083,440,000	1.94

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

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	2,401,554,685,379	96.62
内 アメリカ	1,732,369,833,078	69.70
内 イギリス	98,262,200,673	3.95
内 カナダ	93,853,727,100	3.78
内 スイス	71,749,550,938	2.89
内 フランス	63,793,338,760	2.57
内 ドイツ	62,695,241,808	2.52
内 オランダ	46,796,909,947	1.88
内 オーストラリア	42,630,414,019	1.72
内 アイルランド	41,509,907,768	1.67
内 スペイン	25,205,552,312	1.01
内 スウェーデン	22,888,472,517	0.92
内 イタリア	19,322,276,929	0.78
内 デンマーク	10,513,334,567	0.42
内 香港	9,558,489,635	0.38
内 シンガポール	9,552,258,077	0.38
内 フィンランド	7,715,403,390	0.31
内 イスラエル	6,503,456,916	0.26
内 ベルギー	6,049,513,177	0.24
内 ケイマン諸島	4,559,299,271	0.18
内 ジャージー	4,519,900,335	0.18
内 ノルウェー	4,254,757,664	0.17
内 ルクセンブルグ	3,994,542,949	0.16
内 バミューダ	2,742,004,684	0.11
内 リベリア	2,525,103,325	0.10
内 オランダ領キュラソー	2,327,797,967	0.09
内 オーストリア	1,785,596,088	0.07
内 ニュージーランド	1,445,289,876	0.06
内 ポルトガル	1,246,515,309	0.05
内 パナマ	1,063,588,726	0.04
内 マン島	120,407,574	0.00
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	2,876,043,805	0.12
内 オーストラリア	2,213,465,717	0.09
内 シンガポール	662,578,088	0.03
投資証券	36,948,270,530	1.49
内 アメリカ	35,063,486,171	1.41
内 フランス	895,779,522	0.04
内 イギリス	607,882,565	0.02
内 香港	381,122,272	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	44,225,638,561	1.78
純資産総額	2,485,604,638,275	100.00

その他資産の投資状況

2026年2月27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）		48,025,458,429	1.93
内 アメリカ		35,958,143,420	1.45
内 ドイツ		6,793,674,706	0.27
内 カナダ		2,486,913,429	0.10
内 イギリス		2,003,362,609	0.08
内 オーストラリア		783,364,265	0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	401,008,007,500	87.34
内 日本	401,008,007,500	87.34
地方債証券	23,201,253,677	5.05
内 日本	23,201,253,677	5.05
特殊債券	18,907,526,291	4.12
内 日本	18,907,526,291	4.12
社債券	15,101,884,000	3.29
内 日本	14,807,314,000	3.22
内 フランス	294,570,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	934,509,425	0.20
純資産総額	459,153,180,893	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	307,736,441,133	98.64
内 アメリカ	139,652,965,210	44.76
内 中国	36,723,843,404	11.77
内 フランス	22,396,193,394	7.18
内 イタリア	20,725,469,415	6.64
内 イギリス	18,034,010,888	5.78
内 ドイツ	17,653,798,501	5.66
内 スペイン	13,568,396,613	4.35
内 カナダ	6,518,685,139	2.09
内 ベルギー	4,710,805,150	1.51
内 オーストラリア	4,060,389,417	1.30
内 オランダ	3,734,722,006	1.20
内 オーストリア	3,436,114,247	1.10
内 メキシコ	2,870,125,751	0.92
内 ポーランド	2,239,527,853	0.72
内 ポルトガル	1,805,000,918	0.58
内 フィンランド	1,621,569,838	0.52
内 マレーシア	1,579,696,316	0.51
内 アイルランド	1,363,703,047	0.44
内 イスラエル	1,234,674,039	0.40

内 シンガポール	1,172,965,642	0.38
内 ニュージーランド	942,134,523	0.30
内 デンマーク	627,977,146	0.20
内 スウェーデン	538,618,186	0.17
内 ノルウェー	525,054,490	0.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,250,010,286	1.36
純資産総額	311,986,451,419	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】

【投資有価証券の主要銘柄】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

2026年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,930,276,093	1.1335 3,321,760,979	1.1359 3,328,500,614	- -	50.57
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	196,967,051	7.0359 1,385,840,477	7.2127 1,420,664,248	- -	21.58
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	360,518,765	2.7155 979,024,758	2.7211 981,007,611	- -	14.90
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	52,796,005	12.3936 654,337,847	12.4492 657,268,025	- -	9.99

(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2月27日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.04
合計	97.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

2026年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	748,299,550	7.0359 5,264,960,811	7.2127 5,397,260,164	- -	38.77

2	国内債券パッシブ・ファンド ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,208,301,507	1.1335 3,636,930,588	1.1359 3,644,309,681	- -	26.18
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	840,298,768	2.7155 2,281,915,334	2.7211 2,286,536,977	- -	16.42
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	175,699,647	12.3936 2,177,568,715	12.4492 2,187,320,045	- -	15.71

(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2月27日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.08
合計	97.08

(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。

DIAM DC バランス70インデックスファンド

2026年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	958,543,560	7.0358 6,744,216,633	7.2127 6,913,687,135	- -	52.58
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	201,484,635	12.3936 2,497,140,108	12.4492 2,508,322,518	- -	19.08
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	917,683,100	2.7155 2,492,060,226	2.7211 2,497,107,483	- -	18.99
4	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	742,300,799	1.1335 841,472,185	1.1359 843,179,477	- -	6.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年2月27日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.06
合計	97.06

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2026年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,242,900	3,729.00 30,737,774,100	3,825.00 31,529,092,500	- -	3.58
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,633,500	2,957.50 28,491,076,250	2,968.50 28,597,044,750	- -	3.25
3	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,984,900	5,818.00 23,184,148,200	5,226.00 20,825,087,400	- -	2.37
4	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,355,000	5,984.00 20,076,320,000	5,997.00 20,119,935,000	- -	2.29
5	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,348,900	3,455.00 18,480,449,500	3,643.00 19,486,042,700	- -	2.21
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,270,600	4,925.00 16,107,705,000	5,290.00 17,301,474,000	- -	1.97
7	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,165,500	7,559.00 16,369,014,500	7,151.00 15,485,490,500	- -	1.76
8	三菱重工業 日本	株式 機械	2,934,200	4,970.00 14,582,974,000	5,014.00 14,712,078,800	- -	1.67
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	328,200	40,600.00 13,324,920,000	44,010.00 14,444,082,000	- -	1.64
10	三井物産 日本	株式 卸売業	2,358,800	5,364.00 12,652,603,200	5,872.00 13,850,873,600	- -	1.57
11	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	488,600	27,355.00 13,365,653,000	26,850.00 13,118,910,000	- -	1.49
12	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	5,514,000	2,067.50 11,400,195,000	2,270.00 12,516,780,000	- -	1.42
13	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	2,980,800	4,251.00 12,671,380,800	4,089.00 12,188,491,200	- -	1.38
14	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,715,500	5,753.00 9,869,271,500	5,991.00 10,277,560,500	- -	1.17
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,570,000	6,128.00 9,620,960,000	6,527.00 10,247,390,000	- -	1.16
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	155,100	55,320.00 8,580,132,000	66,060.00 10,245,906,000	- -	1.16
17	任天堂 日本	株式 その他製品	979,000	8,662.00 8,480,098,000	8,995.00 8,806,105,000	- -	1.00
18	信越化学工業 日本	株式 化学	1,381,100	5,273.00 7,282,540,300	6,168.00 8,518,624,800	- -	0.97
19	HOYA 日本	株式 精密機器	294,300	27,385.00 8,059,405,500	28,265.00 8,318,389,500	- -	0.94

20	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,178,900	7,153.00 8,432,671,700	6,866.00 8,094,327,400	- -	0.92
21	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,383,800	5,504.00 7,616,435,200	5,819.00 8,052,332,200	- -	0.91
22	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	110,600	67,850.00 7,504,210,000	69,030.00 7,634,718,000	- -	0.87
23	丸紅 日本	株式 卸売業	1,251,900	5,957.00 7,457,568,300	6,008.00 7,521,415,200	- -	0.85
24	住友商事 日本	株式 卸売業	983,400	6,333.00 6,227,872,200	6,663.00 6,552,394,200	- -	0.74
25	NTT 日本	株式 情報・通信業	42,699,800	152.50 6,511,719,500	153.30 6,545,879,340	- -	0.74
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,479,800	3,269.00 4,837,466,200	4,108.00 6,079,018,400	- -	0.69
27	KDDI 日本	株式 情報・通信業	2,185,600	2,541.00 5,553,609,600	2,671.00 5,837,737,600	- -	0.66
28	住友電気工業 日本	株式 非鉄金属	552,400	8,367.00 4,621,930,800	10,375.00 5,731,150,000	- -	0.65
29	ディスコ 日本	株式 機械	75,500	72,230.00 5,453,365,000	75,500.00 5,700,250,000	- -	0.65
30	小松製作所 日本	株式 機械	755,200	7,474.00 5,644,364,800	7,533.00 5,688,921,600	- -	0.65

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年2月27日現在

種類	投資比率(%)
株式	98.04
合計	98.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2026年2月27日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.79
銀行業		10.64
卸売業		8.37
機械		6.64
輸送用機器		6.61
情報・通信業		5.62
化学		4.56
小売業		4.03
医薬品		3.67
保険業		3.12
サービス業		2.88
食料品		2.65
建設業		2.59

非鉄金属	2.44
不動産業	2.11
その他製品	2.08
陸運業	1.99
精密機器	1.82
電気・ガス業	1.38
その他金融業	1.20
証券、商品先物取引業	0.95
ガラス・土石製品	0.75
鉄鋼	0.72
ゴム製品	0.59
石油・石炭製品	0.54
海運業	0.51
金属製品	0.42
鉱業	0.38
繊維製品	0.35
空運業	0.29
パルプ・紙	0.14
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	98.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27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	4,744,200	28,483.62 135,132,018,943	28,807.71 136,669,542,051	- -	5.50
2	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,897,276	39,853.08 115,465,377,425	42,528.33 123,216,337,353	- -	4.96
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,378,753	62,529.66 86,212,968,998	62,591.99 86,298,898,400	- -	3.47
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,874,064	30,973.46 58,046,264,894	32,396.01 60,712,205,829	- -	2.44
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	1,135,581	47,634.23 54,092,530,171	47,892.87 54,386,242,065	- -	2.19

6	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	954,184	47,680.97 45,496,424,594	47,857.04 45,664,423,286	- -	1.84
7	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	876,033	50,664.73 44,383,982,161	50,124.07 43,910,345,546	- -	1.77
8	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	423,713	99,682.56 42,236,798,113	102,368.72 43,374,960,889	- -	1.75
9	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	551,873	65,041.32 35,894,551,924	63,660.84 35,132,704,161	- -	1.41
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	537,023	47,140.31 25,315,433,650	47,698.11 25,614,984,972	- -	1.03
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	157,119	162,042.39 25,459,939,845	159,240.93 25,019,776,654	- -	1.01
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	269,092	77,523.26 20,860,890,559	78,321.01 21,075,557,949	- -	0.85
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	831,775	23,129.99 19,238,951,175	23,144.01 19,250,615,072	- -	0.77
14	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	470,081	37,931.94 17,831,086,402	37,935.06 17,832,551,268	- -	0.72
15	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	75,790	218,819.32 16,584,316,869	226,539.76 17,169,449,016	- -	0.69
16	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	856,295	20,861.40 17,863,513,283	19,385.88 16,600,032,285	- -	0.67
17	VISA INC アメリカ	株式 金融サービス	332,012	48,936.80 16,247,606,435	49,345.02 16,383,141,104	- -	0.66
18	MICRON TECH INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	219,335	64,140.74 14,068,310,216	64,748.40 14,201,591,103	- -	0.57

19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	166,622	80,765.67 13,457,337,733	80,206.31 13,364,136,401	- -	0.54
20	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	86,579	158,689.36 13,739,166,861	153,743.95 13,310,998,260	- -	0.54
21	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	345,197	36,070.01 12,451,260,967	35,008.94 12,084,984,133	- -	0.49
22	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	457,198	24,940.50 11,402,749,782	25,513.88 11,664,898,337	- -	0.47
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	194,589	60,929.50 11,856,210,572	58,442.77 11,372,320,735	- -	0.46
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,375,317	8,187.81 11,260,841,850	8,148.86 11,207,269,814	- -	0.45
25	GE AEROSPACE アメリカ	株式 航空宇 宙・防衛	207,105	49,144.03 10,177,974,768	53,106.28 10,998,576,202	- -	0.44
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	830,634	11,977.11 9,948,598,691	13,179.96 10,947,729,456	- -	0.44
27	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	376,023	28,628.52 10,764,985,510	28,693.96 10,789,592,530	- -	0.43
28	CATERPILLAR INC アメリカ	株式 機械	91,579	120,628.10 11,047,000,953	117,314.02 10,743,500,939	- -	0.43
29	ADVANCED MICRO DEVICES アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	317,135	32,302.52 10,244,262,597	31,735.38 10,064,399,990	- -	0.40
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	137,377	72,525.59 9,963,349,351	73,250.85 10,062,982,844	- -	0.40

（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2月27日現在

種類	投資比率（％）
株式	96.62
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.12
投資証券	1.49
合計	98.22

（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2月27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	11.50
銀行		7.02
ソフトウェア		6.36
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.84
コンピュータ・周辺機器		5.39
医薬品		4.49
石油・ガス・消耗燃料		3.79
資本市場		3.27
大規模小売り		2.88
航空宇宙・防衛		2.81
保険		2.81
金融サービス		2.66
機械		1.99
金属・鉱業		1.90
自動車		1.83
生活必需品流通・小売り		1.79
電力		1.75
ヘルスケア機器・用品		1.69
ホテル・レストラン・レジャー		1.60
電気設備		1.60
バイオテクノロジー		1.58
専門小売り		1.45
化学		1.24
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.22
飲料		1.13
娯楽		1.10
各種電気通信サービス		1.09
情報技術サービス		0.99
食品		0.88
陸上運輸		0.82
通信機器		0.81
家庭用品		0.78
総合公益事業		0.77
電子装置・機器・部品		0.75
繊維・アパレル・贅沢品		0.74
タバコ		0.71
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.70
コングロマリット		0.67
専門サービス		0.57
建設関連製品		0.57
商業サービス・用品		0.52
建設・土木		0.50
消費者金融		0.45
商社・流通業		0.43
パーソナルケア用品		0.42
航空貨物・物流サービス		0.40
建設資材		0.34
不動産管理・開発		0.27
エネルギー設備・サービス		0.22
無線通信サービス		0.20

家庭用耐久財	0.20
メディア	0.17
容器・包装	0.16
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.16
ガス	0.10
旅客航空輸送	0.09
運送インフラ	0.09
自動車用部品	0.09
水道	0.08
紙製品・林産品	0.04
海上運輸	0.04
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
販売	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	96.62

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27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	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,100,000,000	98.51 5,024,418,000	98.60 5,028,651,000	0.005 2027/6/20	1.10
2	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,430,000,000	91.05 4,944,263,500	91.55 4,971,273,600	0.5 2033/3/20	1.08
3	163回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,850,000,000	97.66 4,736,510,000	97.81 4,743,882,000	0.4 2028/9/20	1.03
4	378回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	94.08 4,516,080,000	94.85 4,553,136,000	1.4 2035/3/20	0.99
5	377回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,830,000,000	92.80 4,482,529,800	93.59 4,520,445,300	1.2 2034/12/20	0.98
6	374回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,900,000,000	91.07 4,462,822,000	91.77 4,496,975,000	0.8 2034/3/20	0.98
7	375回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,780,000,000	92.87 4,439,281,600	93.59 4,473,697,600	1.1 2034/6/20	0.97
8	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,500,000,000	98.64 4,438,935,000	98.72 4,442,535,000	0.1 2027/6/20	0.97
9	371回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,900,000,000	89.76 4,398,338,000	90.38 4,428,718,000	0.4 2033/6/20	0.96

10	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,780,000,000	90.90 4,345,067,800	91.49 4,373,508,800	0.2 2032/3/20	0.95
11	373回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,810,000,000	90.14 4,335,944,000	90.76 4,365,796,500	0.6 2033/12/20	0.95
12	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,370,000,000	98.29 4,295,360,400	98.37 4,298,987,500	0.1 2027/9/20	0.94
13	380回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,440,000,000	95.92 4,259,088,000	96.74 4,295,256,000	1.7 2035/9/20	0.94
14	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,400,000,000	97.27 4,280,232,000	97.41 4,286,304,000	0.1 2028/6/20	0.93
15	376回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,620,000,000	90.87 4,198,240,200	91.63 4,233,352,200	0.9 2034/9/20	0.92
16	379回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,300,000,000	94.54 4,065,263,000	95.33 4,099,233,000	1.5 2035/6/20	0.89
17	369回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,420,000,000	91.36 4,038,156,200	91.95 4,064,366,800	0.5 2032/12/20	0.89
18	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,400,000,000	90.41 3,978,040,000	91.02 4,004,968,000	0.2 2032/6/20	0.87
19	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,350,000,000	89.91 3,911,215,500	90.51 3,937,359,000	0.2 2032/9/20	0.86
20	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,210,000,000	92.29 3,885,619,500	92.79 3,906,753,700	0.1 2031/3/20	0.85
21	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,190,000,000	90.82 3,805,358,000	91.40 3,829,827,600	0.1 2031/12/20	0.83
22	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	92.76 3,617,796,000	93.24 3,636,633,000	0.1 2030/12/20	0.79
23	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,850,000,000	93.70 3,607,719,500	94.15 3,624,852,000	0.1 2030/6/20	0.79
24	372回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	92.03 3,589,248,000	92.67 3,614,208,000	0.8 2033/9/20	0.79
25	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,910,000,000	91.32 3,570,612,000	91.85 3,591,608,700	0.1 2031/9/20	0.78
26	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,690,000,000	96.49 3,560,481,000	96.68 3,567,824,100	0.1 2028/12/20	0.78

27	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	93.24 3,543,424,000	93.71 3,561,094,000	0.1 2030/9/20	0.78
28	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,750,000,000	94.21 3,532,950,000	94.60 3,547,537,500	0.1 2030/3/20	0.77
29	158回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,600,000,000	97.64 3,515,148,000	97.74 3,518,676,000	0.1 2028/3/20	0.77
30	181回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,340,000,000	98.50 3,290,100,400	98.93 3,304,462,400	1.3 2030/9/20	0.72

(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2月27日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	87.34
地方債証券	5.05
特殊債券	4.12
社債券	3.29
合計	99.80

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28 中国	国債証券	1,794,579,800	100.25 1,799,121,163	100.26 1,799,358,048	1.45 2028/2/25	0.58
2	US T N/B 4.5 05/15/27 アメリカ	国債証券	1,506,994,320	101.17 1,524,683,840	101.15 1,524,330,645	4.5 2027/5/15	0.49
3	US T N/B 4.25 08/15/35 アメリカ	国債証券	1,480,195,000	101.95 1,509,105,057	102.09 1,511,186,582	4.25 2035/8/15	0.48
4	US T N/B 3.75 04/15/28 アメリカ	国債証券	1,402,290,000	100.64 1,411,273,420	100.62 1,411,054,312	3.75 2028/4/15	0.45
5	US T N/B 4.125 07/31/31 アメリカ	国債証券	1,324,385,000	102.38 1,356,020,213	102.43 1,356,589,287	4.125 2031/7/31	0.43
6	US T N/B 4.625 02/15/35 アメリカ	国債証券	1,277,642,000	104.98 1,341,299,515	105.10 1,342,871,614	4.625 2035/2/15	0.43
7	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証券	1,355,547,000	97.23 1,318,031,175	97.33 1,319,381,422	3.375 2033/5/15	0.42
8	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 中国	国債証券	1,294,823,400	100.30 1,298,810,420	100.31 1,298,932,133	1.46 2028/5/25	0.42

9	US T N/B 4.25 05/15/35 アメリカ	国債証券	1,246,480,000	102.04 1,271,993,885	102.17 1,273,551,985	4.25 2035/5/15	0.41
10	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,285,432,500	98.21 1,262,535,732	98.28 1,263,389,334	3.5 2033/2/15	0.40
11	US T N/B 4.125 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,246,480,000	101.10 1,260,308,137	101.09 1,260,089,031	4.125 2027/11/15	0.40
12	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証券	1,230,899,000	100.27 1,234,312,823	100.37 1,235,538,909	3.875 2033/8/15	0.40
13	US T N/B 3.5 11/15/28 アメリカ	国債証券	1,215,318,000	100.14 1,217,121,993	100.14 1,217,027,040	3.5 2028/11/15	0.39
14	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証券	1,168,575,000	100.83 1,178,297,903	100.93 1,179,507,566	4 2034/2/15	0.38
15	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,258,944,800	90.26 1,136,443,564	90.32 1,137,107,470	1.875 2032/2/15	0.36
16	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証券	1,090,670,000	103.32 1,126,883,646	103.43 1,128,119,179	4.375 2034/5/15	0.36
17	US T N/B 3.75 08/15/27 アメリカ	国債証券	1,121,832,000	100.39 1,126,301,804	100.37 1,126,082,688	3.75 2027/8/15	0.36
18	US T N/B 3.875 08/15/34 アメリカ	国債証券	1,090,670,000	99.65 1,086,899,517	99.77 1,088,177,642	3.875 2034/8/15	0.35
19	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27 中国	国債証券	1,077,656,528	100.42 1,082,260,492	100.44 1,082,436,904	1.62 2027/8/15	0.35
20	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27 中国	国債証券	1,067,661,400	100.18 1,069,590,237	100.19 1,069,740,350	1.42 2027/11/15	0.34
21	US T N/B 3.625 10/31/30 アメリカ	国債証券	1,043,927,000	100.23 1,046,394,090	100.26 1,046,659,154	3.625 2030/10/31	0.34
22	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30 中国	国債証券	1,044,945,200	99.85 1,043,405,964	99.84 1,043,307,143	1.43 2030/1/25	0.33
23	US T N/B 3.875 08/31/32 アメリカ	国債証券	1,012,765,000	100.71 1,020,024,468	100.77 1,020,637,667	3.875 2032/8/31	0.33
24	FRANCE OAT 0.75 02/25/28 フランス	国債証券	1,044,097,600	97.27 1,015,641,098	97.29 1,015,906,701	0.75 2028/2/25	0.33
25	US T N/B 5.375 02/15/31 アメリカ	国債証券	913,046,600	108.07 986,803,644	108.07 986,803,644	5.375 2031/2/15	0.32
26	US T N/B 1.75 01/31/29 アメリカ	国債証券	997,184,000	95.30 950,343,614	95.30 950,382,574	1.75 2029/1/31	0.30
27	US T N/B 4.0 04/30/32 アメリカ	国債証券	934,860,000	101.55 949,412,414	101.61 949,923,660	4 2032/4/30	0.30
28	US T N/B 3.875 07/15/28 アメリカ	国債証券	934,860,000	101.00 944,299,898	100.98 944,099,043	3.875 2028/7/15	0.30
29	US T N/B 3.875 03/15/28 アメリカ	国債証券	934,860,000	100.87 943,076,540	100.86 942,912,210	3.875 2028/3/15	0.30
30	US T N/B 2.875 05/15/52 アメリカ	国債証券	1,297,741,490	71.85 932,447,529	72.28 938,074,458	2.875 2052/5/15	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2026年2月27日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.64
合計	98.64

（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。

【投資不動産物件】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

該当事項はありません。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

該当事項はありません。

DIAM DC バランス70インデックスファンド

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

該当事項はありません。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

該当事項はありません。

DIAM DC バランス70インデックスファンド

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2026年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0803月	買建	432	16,430,925,360	17,083,440,000	1.94

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27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 Mar26	買建	667	35,666,969,587	35,958,143,420	1.45
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar26	買建	599	6,650,024,890	6,793,674,706	0.27
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar26	買建	55	2,414,420,166	2,486,913,429	0.10
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar26	買建	88	1,941,033,849	2,003,362,609	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Mar26	買建	31	760,574,430	783,364,265	0.03

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

直近日（2026年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第10計算期間末 (2017年2月27日)	4,191	4,191	1.2846	1.2846
第11計算期間末 (2018年2月26日)	4,448	4,448	1.3537	1.3537
第12計算期間末 (2019年2月25日)	4,498	4,498	1.3547	1.3547
第13計算期間末 (2020年2月25日)	4,666	4,666	1.4053	1.4053
第14計算期間末 (2021年2月25日)	4,946	4,946	1.4732	1.4732
第15計算期間末 (2022年2月25日)	5,360	5,360	1.4905	1.4905
第16計算期間末 (2023年2月27日)	5,659	5,659	1.5060	1.5060
第17計算期間末 (2024年2月26日)	6,501	6,501	1.6947	1.6947
第18計算期間末 (2025年2月25日)	6,049	6,049	1.7020	1.7020

第19計算期間末 (2026年2月25日)	6,538	6,538	1.8645	1.8645
2025年2月末日	6,044	-	1.6932	-
3月末日	6,012	-	1.6816	-
4月末日	5,969	-	1.6765	-
5月末日	6,047	-	1.6950	-
6月末日	6,154	-	1.7205	-
7月末日	6,269	-	1.7364	-
8月末日	6,236	-	1.7503	-
9月末日	6,275	-	1.7710	-
10月末日	6,431	-	1.8147	-
11月末日	6,431	-	1.8176	-
12月末日	6,364	-	1.8145	-
2026年1月末日	6,383	-	1.8168	-
2月末日	6,582	-	1.8778	-

DIAM DC バランス50インデックスファンド

直近日(2026年2月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第10計算期間末 (2017年2月27日)	7,834	7,834	1.2776	1.2776
第11計算期間末 (2018年2月26日)	8,547	8,547	1.3878	1.3878
第12計算期間末 (2019年2月25日)	8,531	8,531	1.3729	1.3729
第13計算期間末 (2020年2月25日)	8,938	8,938	1.4358	1.4358
第14計算期間末 (2021年2月25日)	9,692	9,692	1.5834	1.5834
第15計算期間末 (2022年2月25日)	9,872	9,872	1.6169	1.6169
第16計算期間末 (2023年2月27日)	10,210	10,210	1.6767	1.6767
第17計算期間末 (2024年2月26日)	12,205	12,205	2.0202	2.0202
第18計算期間末 (2025年2月25日)	11,895	11,895	2.0795	2.0795
第19計算期間末 (2026年2月25日)	13,779	13,779	2.4769	2.4769
2025年2月末日	11,833	-	2.0615	-
3月末日	11,800	-	2.0493	-
4月末日	11,629	-	2.0367	-
5月末日	11,899	-	2.0876	-
6月末日	12,125	-	2.1286	-
7月末日	12,345	-	2.1700	-
8月末日	12,441	-	2.2046	-
9月末日	12,592	-	2.2469	-

10月末日	13,040	-	2.3327	-
11月末日	13,150	-	2.3512	-
12月末日	13,168	-	2.3610	-
2026年1月末日	13,331	-	2.3882	-
2月末日	13,921	-	2.5045	-

DIAM DC バランス70インデックスファンド

直近日（2026年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第10計算期間末 (2017年2月27日)	4,943	4,943	1.2455	1.2455
第11計算期間末 (2018年2月26日)	5,654	5,654	1.3935	1.3935
第12計算期間末 (2019年2月25日)	5,626	5,626	1.3629	1.3629
第13計算期間末 (2020年2月25日)	5,913	5,913	1.4374	1.4374
第14計算期間末 (2021年2月25日)	6,631	6,631	1.6441	1.6441
第15計算期間末 (2022年2月25日)	6,985	6,985	1.6913	1.6913
第16計算期間末 (2023年2月27日)	7,559	7,559	1.8019	1.8019
第17計算期間末 (2024年2月26日)	9,944	9,944	2.3171	2.3171
第18計算期間末 (2025年2月25日)	10,268	10,268	2.4427	2.4427
第19計算期間末 (2026年2月25日)	12,956	12,956	3.1387	3.1387
2025年2月末日	10,178	-	2.4130	-
3月末日	10,123	-	2.4013	-
4月末日	9,989	-	2.3784	-
5月末日	10,361	-	2.4724	-
6月末日	10,594	-	2.5326	-
7月末日	10,885	-	2.6077	-
8月末日	11,098	-	2.6687	-
9月末日	11,324	-	2.7376	-
10月末日	11,884	-	2.8754	-
11月末日	12,036	-	2.9141	-
12月末日	12,074	-	2.9406	-
2026年1月末日	12,404	-	2.9998	-
2月末日	13,148	-	3.1841	-

【分配の推移】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

	1口当たりの分配金（円）
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

DIAM DC バランス50インデックスファンド

	1口当たりの分配金(円)
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

DIAM DC バランス70インデックスファンド

	1口当たりの分配金(円)
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

【収益率の推移】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

	収益率(%)
第10計算期間	5.3
第11計算期間	5.4
第12計算期間	0.1
第13計算期間	3.7
第14計算期間	4.8
第15計算期間	1.2
第16計算期間	1.0
第17計算期間	12.5
第18計算期間	0.4
第19計算期間	9.5

(注) 収益率は期間騰落率です。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

	収益率（％）
第10計算期間	9.4
第11計算期間	8.6
第12計算期間	1.1
第13計算期間	4.6
第14計算期間	10.3
第15計算期間	2.1
第16計算期間	3.7
第17計算期間	20.5
第18計算期間	2.9
第19計算期間	19.1

（注）収益率は期間騰落率です。

DIAM DC バランス70インデックスファンド

	収益率（％）
第10計算期間	13.4
第11計算期間	11.9
第12計算期間	2.2
第13計算期間	5.5
第14計算期間	14.4
第15計算期間	2.9
第16計算期間	6.5
第17計算期間	28.6
第18計算期間	5.4
第19計算期間	28.5

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第10計算期間	275,951,706	188,670,759
第11計算期間	334,079,343	310,386,979
第12計算期間	291,814,490	257,295,183
第13計算期間	267,614,189	267,934,960
第14計算期間	453,091,880	416,139,596
第15計算期間	652,179,628	412,991,541
第16計算期間	563,656,024	402,292,173
第17計算期間	536,540,036	458,021,975
第18計算期間	623,737,198	905,918,010
第19計算期間	439,206,024	486,825,387

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第10計算期間	463,520,203	415,914,505
第11計算期間	505,249,804	478,772,270
第12計算期間	401,039,943	345,753,574
第13計算期間	413,568,332	402,317,373

第14計算期間	460,563,926	564,773,432
第15計算期間	557,802,022	573,213,847
第16計算期間	503,376,782	519,506,568
第17計算期間	505,531,553	553,620,050
第18計算期間	689,346,823	1,010,445,759
第19計算期間	434,296,162	591,376,178

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

DIAM DC バランス70インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第10計算期間	358,141,987	280,091,973
第11計算期間	477,082,367	388,424,861
第12計算期間	367,041,734	296,923,234
第13計算期間	326,295,645	340,098,661
第14計算期間	445,535,191	525,978,103
第15計算期間	588,124,012	492,033,801
第16計算期間	537,178,278	471,764,353
第17計算期間	614,558,721	517,872,227
第18計算期間	753,722,286	841,948,221
第19計算期間	455,684,302	531,438,907

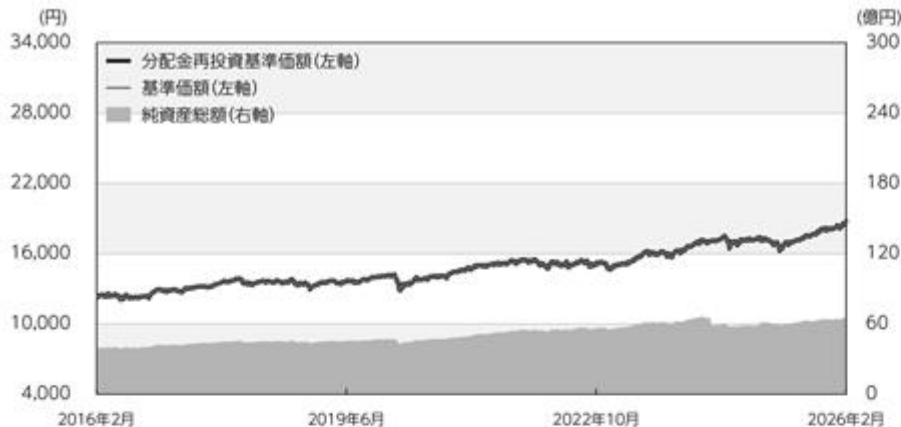
(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2026年2月27日

DIAM DC バランス30インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (2016年2月29日～2026年2月27日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2006年12月27日)

分配の推移(税引前)

2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
2025年 2月	0円
2026年 2月	0円
設定来累計	0円

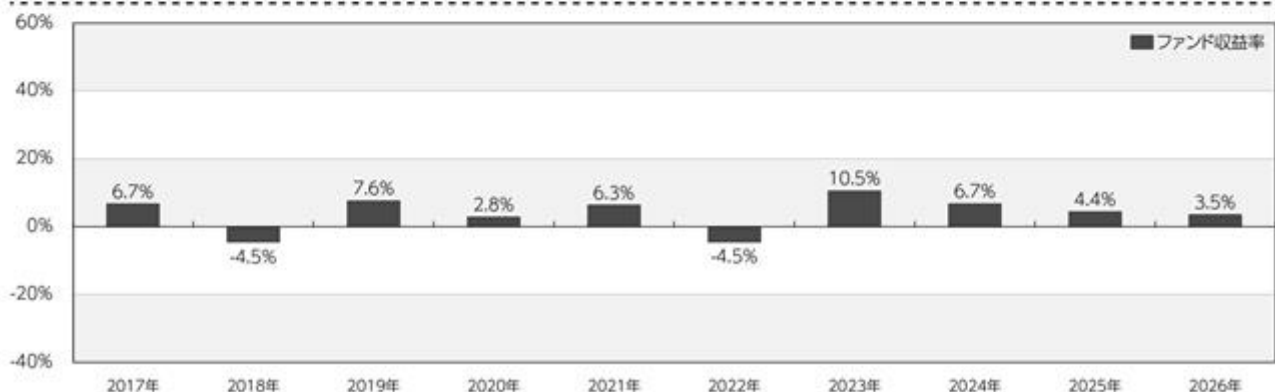
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	50.57
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	21.58
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.90
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.99

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2026年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

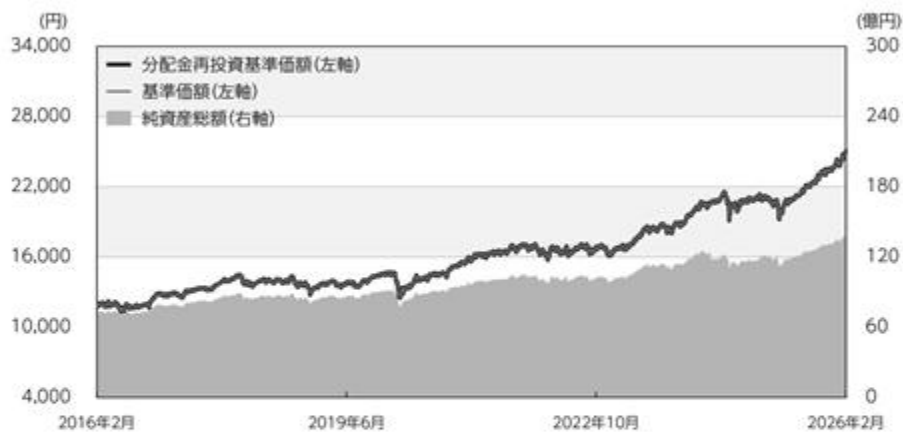
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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2月27日

DIAM DC バランス50インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (2016年2月29日～2026年2月27日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2006年12月27日)

分配の推移(税引前)

2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
2025年 2月	0円
2026年 2月	0円
設定来累計	0円

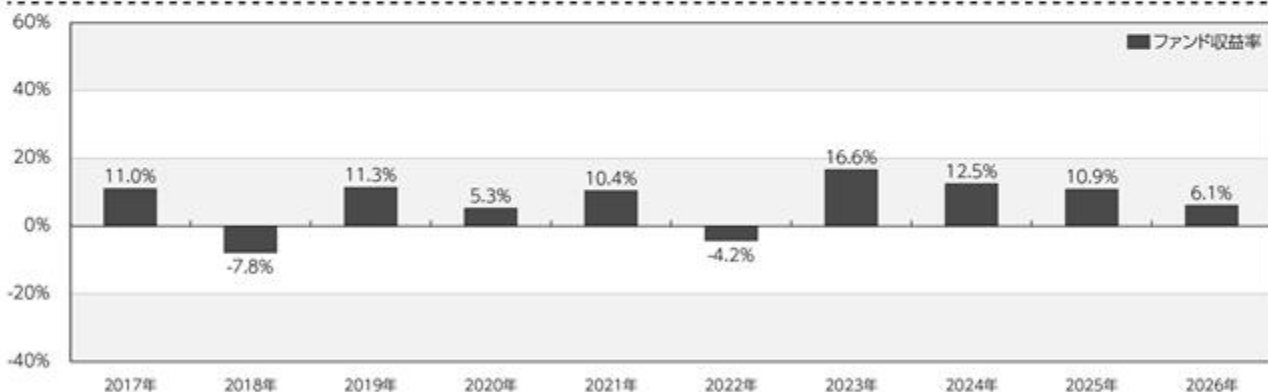
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	38.77
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.18
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.42
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.71

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2026年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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2月27日

DIAM DC バランス70インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 (2016年2月29日～2026年2月27日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2006年12月27日)

分配の推移(税引前)

2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
2025年 2月	0円
2026年 2月	0円
設定来累計	0円

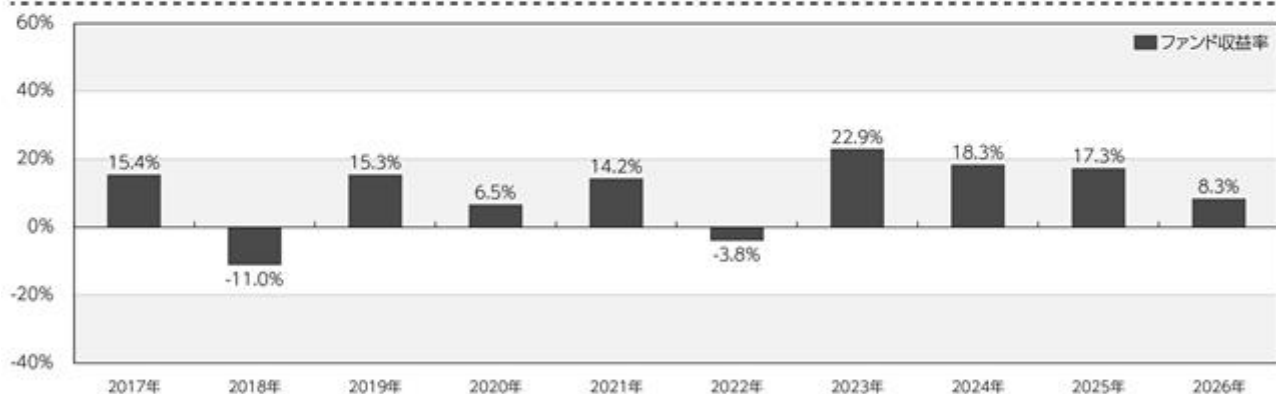
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	52.58
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.08
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	18.99
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.41

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2026年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はい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。

主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.58
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	3.25
3	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.37
4	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.29
5	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.21

■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	5.50
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.96
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.47
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.44
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	2.19

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	153回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2027/6/20	1.10
2	370回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2033/3/20	1.08
3	163回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.4	2028/9/20	1.03
4	378回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.4	2035/3/20	0.99
5	377回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	1.2	2034/12/20	0.98

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	国債証券	中国	1.45	2028/2/25	0.58
2	US T N/B 4.5 05/15/27	国債証券	アメリカ	4.5	2027/5/15	0.49
3	US T N/B 4.25 08/15/35	国債証券	アメリカ	4.25	2035/8/15	0.48
4	US T N/B 3.75 04/15/28	国債証券	アメリカ	3.75	2028/4/15	0.45
5	US T N/B 4.125 07/31/31	国債証券	アメリカ	4.125	2031/7/31	0.43

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積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は、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。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時30分までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。ただし、ニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、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、ファンドの純資産総額（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 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <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）

・ お申込単位

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本 1口 = 1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

・ お申込手数料

ありません。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求
をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約
します。解約の請求の受付は、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、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとしま
す。

・ 解約代金

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

・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。

・解約価額の照会方法等

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 <ul style="list-style-type: none"> ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	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、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <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2006年12月27日から無期限です。

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

（4）【計算期間】

a. 計算期間は毎年2月26日から翌年2月25日までとすることを原則とします。

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

（5）【その他】

イ. 償還規定

- 委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 委託会社は上記a.b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- d. 上記a. b. につき、上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記c. ~ e. の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であつて、上記c. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 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。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および買取請求の手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

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

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

八．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。

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2月25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】

収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

いては原則として取得申込者とします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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。

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】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

DIAM DC バランス50インデックスファンド

DIAM DC バランス70インデックスファンド

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第19期計算期間(2025年2月26日から2026年2月25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】

【DIAM DC バランス30インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	194,228,542	205,906,876
親投資信託受益証券	5,867,551,336	6,343,119,787
未収入金	770,000	-
流動資産合計	6,062,549,878	6,549,026,663
資産合計	6,062,549,878	6,549,026,663
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,515,458	2,359,539
未払受託者報酬	974,740	1,057,860
未払委託者報酬	6,823,533	7,405,325
その他未払費用	115,584	125,443
流動負債合計	13,429,315	10,948,167
負債合計	13,429,315	10,948,167
純資産の部		
元本等		
元本	3,554,203,702	3,506,584,339
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,494,916,861	3,031,494,157
（分配準備積立金）	1,240,193,844	1,579,467,968
元本等合計	6,049,120,563	6,538,078,496
純資産合計	6,049,120,563	6,538,078,496
負債純資産合計	6,062,549,878	6,549,026,663

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自	2024年2月27日 2025年2月25日	自	2025年2月26日 2026年2月25日
営業収益				
受取利息		321,207		1,011,276
有価証券売買等損益		37,207,125		590,900,451
営業収益合計		37,528,332		591,911,727
営業費用				
支払利息		838		-
受託者報酬		1,982,874		2,050,674
委託者報酬		13,880,772		14,355,313
その他費用		235,121		243,168
営業費用合計		16,099,605		16,649,155
営業利益又は営業損失（ ）		21,428,727		575,262,572
経常利益又は経常損失（ ）		21,428,727		575,262,572
当期純利益又は当期純損失（ ）		21,428,727		575,262,572
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（ ）		9,659,206		26,198,281
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,665,095,719		2,494,916,861
剰余金増加額又は欠損金減少額		448,005,681		329,839,334
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		448,005,681		329,839,334
剰余金減少額又は欠損金増加額		629,954,060		342,326,329
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		629,954,060		342,326,329
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,494,916,861		3,031,494,157

(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2月26日	至 2026年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第18期	第19期
	2025年2月25日現在	2026年2月25日現在
1. 期首元本額	3,836,384,514円	3,554,203,702円
期中追加設定元本額	623,737,198円	439,206,024円
期中一部解約元本額	905,918,010円	486,825,387円
2. 受益権の総数	3,554,203,702口	3,506,584,339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 2024年2月27日 至 2025年2月25日	自 2025年2月26日 至 2026年2月25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(69,944,902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(1,382,515,169円)及び分配準備積立金(1,170,248,942円)より分配対象収益は2,622,709,013円(1万口当たり7,379.17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(93,240,350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(405,110,586円)、信託約款に規定される収益調整金(1,506,911,947円)及び分配準備積立金(1,081,117,032円)より分配対象収益は3,086,379,915円(1万口当たり8,801.67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 2024年2月27日 至 2025年2月25日	自 2025年2月26日 至 2026年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25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	11,968,776	525,192,053
合計	11,968,776	525,192,053

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7020円 (17,020円)	1.8645円 (18,645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2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	197,273,441	1,387,996,203	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,930,276,093	3,321,760,979	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	52,796,005	654,337,847	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	360,518,765	979,024,758	
親投資信託受益証券 合計		3,540,864,304	6,343,119,787	
合計			6,343,119,787	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【DIAM DC バランス50インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	388,254,963	428,518,998
親投資信託受益証券	11,537,373,654	13,373,208,269
未収入金	-	8,569,000
流動資産合計	11,925,628,617	13,810,296,267
資産合計	11,925,628,617	13,810,296,267
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,548,980	10,830,330
未払受託者報酬	1,935,819	2,167,836
未払委託者報酬	15,486,884	17,343,028
その他未払費用	229,616	257,162
流動負債合計	30,201,299	30,598,356
負債合計	30,201,299	30,598,356
純資産の部		
元本等		
元本	5,720,444,596	5,563,364,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,174,982,722	8,216,333,331
(分配準備積立金)	4,311,599,795	6,040,104,294
元本等合計	11,895,427,318	13,779,697,911
純資産合計	11,895,427,318	13,779,697,911
負債純資産合計	11,925,628,617	13,810,296,267

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自	2024年2月27日 2025年2月25日	自	2025年2月26日 2026年2月25日
営業収益				
受取利息		632,659		2,013,840
有価証券売買等損益		370,608,105		2,265,092,615
営業収益合計		371,240,764		2,267,106,455
営業費用				
支払利息		1,555		-
受託者報酬		3,904,505		4,117,698
委託者報酬		31,236,617		32,942,234
その他費用		463,142		488,459
営業費用合計		35,605,819		37,548,391
営業利益又は営業損失（ ）		335,634,945		2,229,558,064
経常利益又は経常損失（ ）		335,634,945		2,229,558,064
当期純利益又は当期純損失（ ）		335,634,945		2,229,558,064
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（ ）		40,745,436		72,382,291
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,163,523,894		6,174,982,722
剰余金増加額又は欠損金減少額		749,052,220		523,582,217
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		749,052,220		523,582,217
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,032,482,901		639,407,381
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,032,482,901		639,407,381
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,174,982,722		8,216,333,331

(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2月26日	至 2026年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第18期	第19期
	2025年2月25日現在	2026年2月25日現在
1. 期首元本額	6,041,543,532円	5,720,444,596円
期中追加設定元本額	689,346,823円	434,296,162円
期中一部解約元本額	1,010,445,759円	591,376,178円
2. 受益権の総数	5,720,444,596口	5,563,364,580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 2024年2月27日 至 2025年2月25日	自 2025年2月26日 至 2026年2月25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(184,937,732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(109,951,777円)、信託約款に規定される収益調整金(2,291,768,251円)及び分配準備積立金(4,016,710,286円)より分配対象収益は6,603,368,046円(1万口当たり11,543.45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(223,954,084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(1,933,221,689円)、信託約款に規定される収益調整金(2,540,023,647円)及び分配準備積立金(3,882,928,521円)より分配対象収益は8,580,127,941円(1万口当たり15,422.55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 2024年2月27日 至 2025年2月25日	自 2025年2月26日 至 2026年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25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	304,852,286	2,164,861,698
合計	304,852,286	2,164,861,698

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0795円 (20,795円)	2.4769円 (24,769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2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	749,981,329	5,276,793,632	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	3,208,301,507	3,636,930,588	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	175,699,647	2,177,568,715	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	840,298,768	2,281,915,334	
親投資信託受益証券 合計		4,974,281,251	13,373,208,269	
合計			13,373,208,269	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【DIAM DC バランス70インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	332,463,066	407,903,140
親投資信託受益証券	9,957,085,716	12,571,894,152
未収入金	3,927,000	-
流動資産合計	10,293,475,782	12,979,797,292
資産合計	10,293,475,782	12,979,797,292
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,355,345	3,002,837
未払受託者報酬	1,637,494	1,981,153
未払委託者報酬	14,737,798	17,830,758
その他未払費用	194,229	235,010
流動負債合計	24,924,866	23,049,758
負債合計	24,924,866	23,049,758
純資産の部		
元本等		
元本	4,203,777,909	4,128,023,304
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,064,773,007	8,828,724,230
(分配準備積立金)	3,824,353,192	6,125,592,004
元本等合計	10,268,550,916	12,956,747,534
純資産合計	10,268,550,916	12,956,747,534
負債純資産合計	10,293,475,782	12,979,797,292

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自 2024年2月27日 至 2025年2月25日	第19期 自 2025年2月26日 至 2026年2月25日
営業収益		
受取利息	541,409	1,825,658
有価証券売買等損益	536,201,242	2,914,031,436
営業収益合計	536,742,651	2,915,857,094
営業費用		
支払利息	1,298	-
受託者報酬	3,270,600	3,672,847
委託者報酬	29,436,131	33,056,464
その他費用	387,952	435,678
営業費用合計	33,095,981	37,164,989
営業利益又は営業損失（ ）	503,646,670	2,878,692,105
経常利益又は経常損失（ ）	503,646,670	2,878,692,105
当期純利益又は当期純損失（ ）	503,646,670	2,878,692,105
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（ ）	61,053,447	118,360,715
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,652,848,638	6,064,773,007
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,082,108,678	773,290,849
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,082,108,678	773,290,849
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,112,777,532	769,671,016
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,112,777,532	769,671,016
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,064,773,007	8,828,724,230

(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2月26日	至 2026年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第18期	第19期
	2025年2月25日現在	2026年2月25日現在
1. 期首元本額	4,292,003,844円	4,203,777,909円
期中追加設定元本額	753,722,286円	455,684,302円
期中一部解約元本額	841,948,221円	531,438,907円
2. 受益権の総数	4,203,777,909口	4,128,023,304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 2024年2月27日 至 2025年2月25日	自 2025年2月26日 至 2026年2月25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(190,581,996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(252,011,227円)、信託約款に規定される収益調整金(2,671,213,333円)及び分配準備積立金(3,381,759,969円)より分配対象収益は6,495,566,525円(1万口当たり15,451.73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(233,503,825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(2,526,827,565円)、信託約款に規定される収益調整金(3,014,326,292円)及び分配準備積立金(3,365,260,614円)より分配対象収益は9,139,918,296円(1万口当たり22,141.14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 2024年2月27日 至 2025年2月25日	自 2025年2月26日 至 2026年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25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	475,922,552	2,821,225,203
合計	475,922,552	2,821,225,203

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第18期 2025年2月25日現在	第19期 2026年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4427円 (24,427円)	3.1387円 (31,387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2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	958,543,560	6,744,216,633	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	742,300,799	841,472,185	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	201,242,979	2,494,145,108	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	917,683,100	2,492,060,226	
親投資信託受益証券 合計		2,819,770,438	12,571,894,152	
合計			12,571,894,152	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

（参考）

「DIAM DC バランス30インデックスファンド」、「DIAM DC バランス50インデックスファンド」、「DIAM DC バランス70インデックスファンド」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2026年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,639,833,053
株式	843,049,975,010
派生商品評価勘定	758,074,280
未収入金	38,271,300
未収配当金	1,037,932,706
差入委託証拠金	872,079,154
流動資産合計	859,396,165,503
資産合計	859,396,165,503
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,970
前受金	630,056,000
未払解約金	452,965,000
流動負債合計	1,083,068,970
負債合計	1,083,068,970
純資産の部	
元本等	
元本	121,989,725,210
剰余金	
剰余金又は欠損金()	736,323,371,323
元本等合計	858,313,096,533
純資産合計	858,313,096,533
負債純資産合計	859,396,165,503

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2月26日 至 2026年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年2月25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	125,178,271,907円
同期中追加設定元本額	29,427,875,856円
同期中一部解約元本額	32,616,422,553円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,197,572,652円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,610,576,711円
One DC 国内株式インデックスファンド	38,754,923,557円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,805,113,630円
たわらノーロード TOPIX	4,381,702,231円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,307,293,393円
たわらノーロード バランス(堅実型)	39,858,808円
たわらノーロード バランス(標準型)	386,964,000円
たわらノーロード バランス(積極型)	827,527,192円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	2,863,944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)	144,299,443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)	472,166,319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)	438,778,170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)	644,199,924円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	431,706円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,926,380円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	34,670,790円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	13,251,788円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	22,950,567円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	21,644,184円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	124,454,151円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	69,630,788円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	31,003,279,248円
Oneグローバルバランス	112,232,166円

未来のわたし(ターゲット・イヤー/～1972年生まれ向け)	543,331円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1973～1977年生まれ向け)	400,101円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1978～1982年生まれ向け)	194,810円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1983～1987年生まれ向け)	378,902円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1988～1992年生まれ向け)	208,558円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1993～1997年生まれ向け)	224,972円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1998～2002年生まれ向け)	255,845円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/2003～2007年生まれ向け)	375,504円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	745,303,952円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,851,808,435円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,606,387,214円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	197,273,441円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	749,981,329円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	958,543,560円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,569,453円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	996,194,857円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,770,585円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	205,513,904円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	303,643,325円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	552,811,409円
投資のソムリエ	2,917,811,148円
クルーズコントロール	133,442,284円
投資のソムリエ<DC年金>	573,404,782円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	301,934,056円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,445,519,066円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	342,875,888円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	609,198,959円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	113,323,418円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	62,164,030円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,179,299円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	179,303,010円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	640,901,683円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	224,284,708円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	172,509,391円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	109,995,280円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	68,385,350円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	40,239,907円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	849,034,238円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	15,640,475円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	710,029円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	22,662,770円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	532,021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)	11,219,587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)	216,460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)	699,863円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	759,315円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	20,168,849円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	76,479,913円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	60,139,583円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	41,992,072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)	241,231円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	41,979,580円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)	60,486,999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)	104,840,143円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)	328,495,934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)	451,690円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2024-05(適格機関投資家限定)	288,466,985円
AMOne TOPIXインデックスファンド2025-01(適格機関投資家限定)	3,260,375,277円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	40,233,245円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	11,990,574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)	280,509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)	2,009,223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)	12,906,003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)	44,479,817円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,566,290円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,575,833円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,006,641円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	62,833円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	117,324,406円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	238,691,985円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	782,555,918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)	5,507,410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)	8,719,095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)	58,472,993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)	12,821,408円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	39,116円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	62,233,198円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	4,770,906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）	12,542,151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）	29,043,189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）	35,275,595円
D I A M世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	8,837,330円
D I A M国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	3,523,346円
動的パッケージファンド<DC年金>	19,630,198円
コア資産形成ファンド	6,852,150円
MHAMトピックスファンド	704,941,048円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	23,635,326円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,905,614,485円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,841,886,855円
計	121,989,725,210円
2. 受益権の総数	121,989,725,210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2月26日 至 2026年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年2月25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ぬ。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2026年2月25日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	13,079,277,630	
合計	13,079,277,630	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2026年2月10日から2026年2月25日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2026年2月25日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	14,386,099,000	-		15,144,255,000
合計	14,386,099,000	-		15,144,255,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2026年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	7.0359円 (70,359円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2026年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	9,100	5,310.00	48,321,000	
ニッセイ	199,200	1,504.50	299,696,400	
マルハニチロ	105,700	1,540.50	162,830,850	
ユキグニファクトリー	18,600	1,097.00	20,404,200	
カネコ種苗	6,100	1,529.00	9,326,900	
サカタのタネ	26,300	4,300.00	113,090,000	
ホクト	19,400	1,989.00	38,586,600	
ショーボンドホールディングス	127,000	1,442.00	183,134,000	
ミライト・ワン	74,100	3,893.00	288,471,300	
タマホーム	13,600	3,920.00	53,312,000	
robot home	42,200	204.00	8,608,800	
住石ホールディングス	19,400	850.00	16,490,000	
日鉄鉱業	41,800	4,190.00	175,142,000	
三井松島ホールディングス	26,500	1,469.00	38,928,500	
INPEX	730,100	3,620.00	2,642,962,000	
石油資源開発	134,100	2,273.00	304,809,300	
K&Oエナジーグループ	9,900	5,200.00	51,480,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	31,300	3,325.00	104,072,500	
第一カッター興業	5,500	1,581.00	8,695,500	
安藤・間	115,500	2,097.50	242,261,250	
東急建設	68,100	1,565.00	106,576,500	
コムシスホールディングス	77,100	5,630.00	434,073,000	
ビーアールホールディングス	32,000	528.00	16,896,000	
高松コンストラクショングループ	16,100	3,935.00	63,353,500	
東建コーポレーション	4,700	15,000.00	70,500,000	
ヤマウラ	12,300	1,663.00	20,454,900	
オリエンタル白石	80,300	415.00	33,324,500	
大成建設	113,500	19,055.00	2,162,742,500	
大林組	491,800	4,236.00	2,083,264,800	
清水建設	415,500	3,463.00	1,438,876,500	
長谷工コーポレーション	135,700	3,305.00	448,488,500	
松井建設	12,500	1,944.00	24,300,000	
鹿島建設	337,200	6,898.00	2,326,005,600	
不動テトラ	8,600	3,895.00	33,497,000	
鉄建建設	9,600	4,775.00	45,840,000	
西松建設	24,300	6,785.00	164,875,500	
大豊建設	21,200	853.00	18,083,600	
奥村組	24,700	7,140.00	176,358,000	
東鉄工業	16,800	5,210.00	87,528,000	
浅沼組	60,800	1,120.00	68,096,000	
戸田建設	187,100	1,578.50	295,337,350	
熊谷組	90,200	1,992.00	179,678,400	
矢作建設工業	28,400	2,465.00	70,006,000	
ピーエス・コンストラクション	13,800	3,475.00	47,955,000	

日本ハウスホールディングス	32,400	326.00	10,562,400	
大東建託	259,700	3,573.00	927,908,100	
新日本建設	21,400	2,131.00	45,603,400	
東亜道路工業	23,400	1,887.00	44,155,800	
東亜建設工業	56,200	4,085.00	229,577,000	
日本国土開発	46,600	682.00	31,781,200	
若築建設	4,500	4,835.00	21,757,500	
五洋建設	215,600	2,065.00	445,214,000	
世紀東急工業	24,000	1,696.00	40,704,000	
福田組	5,200	7,640.00	39,728,000	
住友林業	394,500	1,664.50	656,645,250	
大和ハウス工業	420,800	5,582.00	2,348,905,600	
ライト工業	29,000	4,130.00	119,770,000	
積水ハウス	461,300	3,792.00	1,749,249,600	
日特建設	14,800	1,418.00	20,986,400	
北陸電気工事	8,800	1,691.00	14,880,800	
ユアテック	32,200	3,110.00	100,142,000	
日本リーテック	11,900	3,080.00	36,652,000	
四電工	19,100	1,990.00	38,009,000	
中電工	20,200	4,930.00	99,586,000	
関電工	83,300	6,531.00	544,032,300	
きんでん	104,300	8,154.00	850,462,200	
東京エネシス	14,200	1,894.00	26,894,800	
トーエネック	29,500	2,286.00	67,437,000	
日本電設工業	28,600	4,895.00	139,997,000	
エクシオグループ	145,200	2,916.00	423,403,200	
新日本空調	19,700	3,980.00	78,406,000	
クラフティア	32,900	10,180.00	334,922,000	
三機工業	31,100	7,660.00	238,226,000	
日揮ホールディングス	165,700	2,304.00	381,772,800	
中外炉工業	4,100	4,915.00	20,151,500	
太平電業	30,200	2,876.00	86,855,200	
高砂熱学工業	81,400	5,003.00	407,244,200	
朝日工業社	15,800	4,680.00	73,944,000	
明星工業	25,800	1,946.00	50,206,800	
大気社	39,000	3,745.00	146,055,000	
ダイダン	87,900	3,520.00	309,408,000	
日比谷総合設備	11,100	6,100.00	67,710,000	
ニッポン	54,000	2,842.00	153,468,000	
日清製粉グループ本社	151,700	2,147.00	325,699,900	
日東富士製粉	2,500	7,190.00	17,975,000	
昭和産業	13,000	3,400.00	44,200,000	
中部飼料	19,400	1,921.00	37,267,400	
フィード・ワン	20,100	1,255.00	25,225,500	
日本甜菜製糖	6,700	4,340.00	29,078,000	
D M三井製糖	12,800	3,505.00	44,864,000	
ウェルネオシュガー	8,600	3,015.00	25,929,000	
L I F U L L	46,800	205.00	9,594,000	
M I X I	28,900	2,608.00	75,371,200	
ジェイエイシーリクルートメント	57,600	862.00	49,651,200	

日本M&Aセンターホールディングス	254,100	707.90	179,877,390	
メンバーズ	5,400	1,188.00	6,415,200	
UTグループ	312,400	208.00	64,979,200	
アイティメディア	8,500	1,830.00	15,555,000	
E・Jホールディングス	10,500	1,857.00	19,498,500	
オープンアップグループ	47,900	1,860.00	89,094,000	
コシダカホールディングス	43,700	1,180.00	51,566,000	
パソナグループ	16,300	2,022.00	32,958,600	
リンクアンドモチベーション	37,900	544.00	20,617,600	
エス・エム・エス	60,900	1,720.00	104,748,000	
パーソルホールディングス	1,453,200	242.00	351,674,400	
クックパッド	31,100	148.00	4,602,800	
森永製菓	59,800	2,860.00	171,028,000	
中村屋	3,900	3,275.00	12,772,500	
江崎グリコ	43,700	5,991.00	261,806,700	
meito	6,800	2,688.00	18,278,400	
井村屋グループ	8,400	2,539.00	21,327,600	
不二家	10,500	2,484.00	26,082,000	
山崎製パン	102,200	3,423.00	349,830,600	
モロゾフ	14,900	1,521.00	22,662,900	
亀田製菓	9,700	4,340.00	42,098,000	
寿スピリッツ	81,200	1,925.00	156,310,000	
カルビー	69,900	3,060.00	213,894,000	
森永乳業	56,900	4,687.00	266,690,300	
六甲バター	12,500	1,211.00	15,137,500	
ヤクルト本社	211,700	2,584.50	547,138,650	
明治ホールディングス	212,700	3,934.00	836,761,800	
雪印メグミルク	41,100	3,440.00	141,384,000	
プリマハム	20,500	2,865.00	58,732,500	
日本ハム	57,400	7,051.00	404,727,400	
丸大食品	15,400	2,373.00	36,544,200	
S Foods	16,800	3,250.00	54,600,000	
柿安本店	5,800	2,912.00	16,889,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,600	6,350.00	168,910,000	
学情	7,200	1,856.00	13,363,200	
スタジオアリス	7,700	2,018.00	15,538,600	
クロスキャット	8,900	996.00	8,864,400	
システナ	222,400	422.00	93,852,800	
NJS	3,600	4,665.00	16,794,000	
デジタルアーツ	8,200	5,350.00	43,870,000	
日鉄ソリューションズ	42,400	3,889.00	164,893,600	
ALSO K	266,300	1,212.00	322,755,600	
キューブシステム	7,900	1,078.00	8,516,200	
いちご	129,300	430.00	55,599,000	
日本駐車場開発	181,800	281.00	51,085,800	
コア	6,900	2,189.00	15,104,100	
カカクコム	103,400	1,600.00	165,440,000	
ルネサンス	12,500	1,125.00	14,062,500	
ディップ	27,800	2,045.00	56,851,000	
SBSホールディングス	13,800	4,200.00	57,960,000	

デジタルホールディングス	8,300	2,006.00	16,649,800	
新日本科学	16,900	1,618.00	27,344,200	
エムスリー	315,100	1,530.00	482,103,000	
ワールドホールディングス	7,300	2,856.00	20,848,800	
ディー・エヌ・エー	63,800	2,564.50	163,615,100	
博報堂DYホールディングス	203,300	1,153.00	234,404,900	
ぐるなび	29,700	148.00	4,395,600	
タカミヤ	21,600	430.00	9,288,000	
ファンコミュニケーションズ	23,100	471.00	10,880,100	
ライク	8,300	1,583.00	13,138,900	
エスプール	41,400	254.00	10,515,600	
WDBホールディングス	7,000	1,591.00	11,137,000	
手間いらず	2,300	2,853.00	6,561,900	
アドウェイズ	17,100	285.00	4,873,500	
バリューコマース	14,000	432.00	6,048,000	
インフォマート	150,500	359.00	54,029,500	
サッポロホールディングス	228,500	1,695.50	387,421,750	
アサヒグループホールディングス	1,146,500	1,704.50	1,954,209,250	
麒麟ホールディングス	635,900	2,665.50	1,694,991,450	
シマダヤ	7,000	1,936.00	13,552,000	
宝ホールディングス	125,800	1,615.50	203,229,900	
オエノンホールディングス	45,900	470.00	21,573,000	
養命酒製造	5,000	4,050.00	20,250,000	
飛島ホールディングス	15,700	2,492.00	39,124,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	99,300	4,057.00	402,860,100	
ライフドリンク カンパニー	27,200	1,176.00	31,987,200	
サントリー食品インターナショナル	107,500	4,837.00	519,977,500	
ダイドーグループホールディングス	17,300	2,574.00	44,530,200	
伊藤園	49,400	3,012.00	148,792,800	
キーコーヒー	17,000	2,007.00	34,119,000	
日清オイリオグループ	21,500	6,060.00	130,290,000	
不二製油	30,500	3,986.00	121,573,000	
J-オイルミルズ	17,500	2,050.00	35,875,000	
インターメスティック	7,100	1,937.00	13,752,700	
サンエー	27,700	3,155.00	87,393,500	
カワチ薬品	12,800	3,315.00	42,432,000	
エービーシー・マート	86,200	2,616.50	225,542,300	
ハードオフコーポレーション	6,500	2,080.00	13,520,000	
高千穂交易	13,000	2,145.00	27,885,000	
アスクル	31,200	1,289.00	40,216,800	
ゲオホールディングス	18,500	1,714.00	31,709,000	
アンドエスティHD	22,700	3,010.00	68,327,000	
リガク・ホールディングス	93,200	1,902.00	177,266,400	
伊藤忠食品	3,800	12,550.00	47,690,000	
くら寿司	19,100	3,705.00	70,765,500	
キャンドウ	5,800	3,555.00	20,619,000	
パルグループホールディングス	64,500	1,647.00	106,231,500	
エディオン	78,000	2,233.00	174,174,000	
あらた	25,200	3,065.00	77,238,000	

サーラコーポレーション	34,500	1,193.00	41,158,500
トーメンデバイス	2,400	13,950.00	33,480,000
ハローズ	7,500	4,875.00	36,562,500
J Pホールディングス	40,700	783.00	31,868,100
フジオフードグループ本社	26,600	1,076.00	28,621,600
あみやき亭	11,900	1,446.00	17,207,400
東京エレクトロン デバイス	16,300	3,660.00	59,658,000
円谷フィールズホールディングス	30,300	1,493.00	45,237,900
双日	158,200	6,872.00	1,087,150,400
アルフレッサ ホールディングス	155,300	2,591.50	402,459,950
大黒天物産	5,800	5,470.00	31,726,000
ハニーズホールディングス	14,600	1,531.00	22,352,600
キッコーマン	506,000	1,529.00	773,674,000
味の素	758,000	4,938.00	3,743,004,000
ブルドックソース	8,100	1,916.00	15,519,600
キューピー	82,000	4,543.00	372,526,000
ハウス食品グループ本社	57,100	3,043.00	173,755,300
カゴメ	79,300	2,867.50	227,392,750
アリアケジャパン	17,100	6,030.00	103,113,000
エバラ食品工業	3,900	2,701.00	10,533,900
キオクシアホールディングス	94,700	21,465.00	2,032,735,500
ニチレイ	134,000	2,085.00	279,390,000
横浜冷凍	41,300	1,451.00	59,926,300
東洋水産	70,700	12,310.00	870,317,000
イトアンドホールディングス	7,200	2,079.00	14,968,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,200	1,018.00	11,401,600
日清食品ホールディングス	172,500	3,283.00	566,317,500
フジッコ	17,400	1,650.00	28,710,000
ロック・フィールド	17,100	1,407.00	24,059,700
日本たばこ産業	927,800	6,077.00	5,638,240,600
ケンコーマヨネーズ	9,600	2,326.00	22,329,600
わらべや日洋ホールディングス	10,300	3,485.00	35,895,500
なとり	9,700	1,955.00	18,963,500
ファーマフーズ	20,100	624.00	12,542,400
北の達人コーポレーション	65,500	136.00	8,908,000
ユーグレナ	103,000	381.00	39,243,000
紀文食品	13,300	1,086.00	14,443,800
ピククルスホールディングス	9,000	1,293.00	11,637,000
スター・マイカ・ホールディングス	16,100	1,594.00	25,663,400
S R Eホールディングス	7,500	2,675.00	20,062,500
片倉工業	16,300	3,100.00	50,530,000
ゲンゼ	24,100	4,615.00	111,221,500
ヒューリック	445,200	2,057.50	915,999,000
ラサ商事	8,600	2,325.00	19,995,000
アルペン	15,700	2,192.00	34,414,400
ラクーンホールディングス	11,600	648.00	7,516,800
クオールホールディングス	20,300	1,939.00	39,361,700
アルコニックス	25,300	3,150.00	79,695,000
神戸物産	142,700	3,743.00	534,126,100
ソリトンシステムズ	8,000	1,914.00	15,312,000

ジンズホールディングス	11,200	5,210.00	58,352,000	
ビックカメラ	87,400	1,798.50	157,188,900	
DCMホールディングス	85,000	1,732.00	147,220,000	
ペッパーフードサービス	57,100	180.00	10,278,000	
MonotaRO	232,600	2,052.50	477,411,500	
あいホールディングス	32,800	2,853.00	93,578,400	
J.フロントリテイリング	188,200	2,680.00	504,376,000	
ドトール・日レスホールディングス	29,100	3,005.00	87,445,500	
マツキヨココカラ&カンパニー	285,500	2,619.50	747,867,250	
ブロンコビリー	9,600	4,050.00	38,880,000	
ZOZO	258,600	1,083.50	280,193,100	
トレジャー・ファクトリー	11,400	1,817.00	20,713,800	
物語コーポレーション	31,800	5,040.00	160,272,000	
三越伊勢丹ホールディングス	255,600	3,119.00	797,216,400	
東洋紡	67,000	1,593.00	106,731,000	
ユニチカ	53,600	1,428.00	76,540,800	
富士紡ホールディングス	7,200	10,990.00	79,128,000	
日清紡ホールディングス	117,800	1,768.00	208,270,400	
倉敷紡績	10,900	10,030.00	109,327,000	
ダイワボウホールディングス	61,600	3,072.00	189,235,200	
シキボウ	10,400	1,146.00	11,918,400	
日東紡績	19,600	27,680.00	542,528,000	
トヨタ紡織	76,200	3,193.00	243,306,600	
マクニカホールディングス	114,200	2,784.00	317,932,800	
ラクト・ジャパン	6,900	3,700.00	25,530,000	
クリエイトSDホールディングス	23,300	3,340.00	77,822,000	
グリムス	5,500	2,636.00	14,498,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,600	1,400.00	31,640,000	
八洲電機	12,300	3,425.00	42,127,500	
メディアスホールディングス	9,700	839.00	8,138,300	
レスター	14,000	3,160.00	44,240,000	
TOKAIホールディングス	89,100	1,201.00	107,009,100	
三洋貿易	20,200	1,849.00	37,349,800	
シュッピン	18,000	1,341.00	24,138,000	
ビューティガレージ	4,500	1,433.00	6,448,500	
オイシックス・ラ・大地	24,300	1,382.00	33,582,600	
ウイン・パートナーズ	11,900	1,483.00	17,647,700	
ネクステージ	37,500	3,730.00	139,875,000	
ジョイフル本田	48,100	2,173.00	104,521,300	
エターナルホスピタリティグループ	6,700	3,710.00	24,857,000	
ホットランドホールディングス	12,500	1,942.00	24,275,000	
すかいらーくホールディングス	224,300	3,554.00	797,162,200	
SFPホールディングス	9,300	2,263.00	21,045,900	
綿半ホールディングス	12,800	1,508.00	19,302,400	
日本毛織	38,800	2,046.00	79,384,800	
ヨシックスホールディングス	4,800	3,550.00	17,040,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	80,800	982.00	79,345,600	
野村不動産ホールディングス	425,700	1,141.50	485,936,550	

三重交通グループホールディングス	37,500	600.00	22,500,000
ディア・ライフ	23,400	1,105.00	25,857,000
地主	12,500	3,370.00	42,125,000
フィル・カンパニー	2,800	1,088.00	3,046,400
JPMC	8,300	1,377.00	11,429,100
フージャースホールディングス	26,600	1,298.00	34,526,800
オープンハウスグループ	47,400	11,330.00	537,042,000
東急不動産ホールディングス	417,300	1,561.50	651,613,950
飯田グループホールディングス	130,100	2,741.00	356,604,100
帝国繊維	16,000	3,000.00	48,000,000
日本コークス工業	157,500	122.00	19,215,000
あさひ	13,700	1,304.00	17,864,800
コスモス薬品	27,800	6,941.00	192,959,800
シップヘルスケアホールディングス	60,200	2,675.00	161,035,000
ソフトクリエイティブホールディングス	12,800	2,003.00	25,638,400
セブン&アイ・ホールディングス	1,812,300	2,214.50	4,013,338,350
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	246,900	769.00	189,866,100
明治電機工業	8,100	2,483.00	20,112,300
ツルハホールディングス	256,600	2,725.00	699,235,000
サンマルクホールディングス	14,700	3,060.00	44,982,000
トリドールホールディングス	46,300	4,227.00	195,710,100
帝人	137,700	1,689.50	232,644,150
東レ	1,046,700	1,324.00	1,385,830,800
クラレ	196,400	1,789.50	351,457,800
旭化成	1,029,600	1,819.50	1,873,357,200
TOKYO BASE	22,700	388.00	8,807,600
稲葉製作所	8,900	1,720.00	15,308,000
宮地エンジニアリンググループ	20,900	1,881.00	39,312,900
トーカロ	46,200	3,145.00	145,299,000
SUMCO	304,600	1,656.00	504,417,600
川田テクノロジーズ	12,100	5,330.00	64,493,000
RS Technologies	10,800	3,940.00	42,552,000
And Doホールディングス	9,300	1,116.00	10,378,800
ケイアイスター不動産	6,400	7,900.00	50,560,000
グッドコムアセット	15,900	1,489.00	23,675,100
ジェイ・エス・ビー	6,300	3,410.00	21,483,000
ロードスターキャピタル	8,700	3,595.00	31,276,500
アズーム	2,700	4,350.00	11,745,000
霞ヶ関キャピタル	15,100	7,630.00	115,213,000
JMホールディングス	23,700	1,753.00	41,546,100
コメダホールディングス	40,200	2,936.00	118,027,200
アレンザホールディングス	12,300	1,461.00	17,970,300
串カツ田中ホールディングス	4,900	2,051.00	10,049,900
パロックジャパンリミテッド	19,100	814.00	15,547,400
クスリのアオキホールディングス	38,800	4,006.00	155,432,800
力の源ホールディングス	12,300	1,540.00	18,942,000
FOOD & LIFE COMPANIES	94,300	9,687.00	913,484,100
アセンテック	6,700	1,240.00	8,308,000

セーレン	33,800	3,560.00	120,328,000
小松マテーレ	20,400	910.00	18,564,000
ワコールホールディングス	30,400	4,590.00	139,536,000
ホギメディカル	17,000	6,710.00	114,070,000
T S Iホールディングス	47,300	1,156.00	54,678,800
ワールド	25,700	3,370.00	86,609,000
T I S	164,300	2,949.00	484,520,700
グリーホールディングス	52,200	376.00	19,627,200
G M Oペパボ	1,900	2,018.00	3,834,200
コーエーテクモホールディングス	97,400	1,715.50	167,089,700
三菱総合研究所	7,400	4,850.00	35,890,000
ファインデックス	10,900	818.00	8,916,200
K L a b	42,200	307.00	12,955,400
ポールトゥウィンホールディングス	22,300	316.00	7,046,800
ネクソン	382,900	3,092.00	1,183,926,800
アイスタイル	59,300	458.00	27,159,400
エムアップホールディングス	38,100	657.00	25,031,700
エイチームホールディングス	12,100	1,015.00	12,281,500
セルシス	21,000	1,293.00	27,153,000
エニグモ	17,300	400.00	6,920,000
コロブラ	52,900	424.00	22,429,600
ブロードリーフ	56,900	680.00	38,692,000
デジタルハーツホールディングス	9,800	842.00	8,251,600
メディアドゥ	5,200	1,668.00	8,673,600
じげん	44,700	428.00	19,131,600
ブイキューブ	20,000	134.00	2,680,000
フィックスターズ	21,400	1,420.00	30,388,000
北里コーポレーション	12,100	1,473.00	17,823,300
オブティム	16,100	451.00	7,261,100
セレス	7,000	1,560.00	10,920,000
S H I F T	139,700	604.00	84,378,800
特種東海製紙	27,100	1,659.00	44,958,900
セック	4,800	3,905.00	18,744,000
テクマトリックス	31,000	1,830.00	56,730,000
プロシップ	12,400	1,389.00	17,223,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	36,100	2,596.00	93,715,600
G M Oペイメントゲートウェイ	31,100	7,432.00	231,135,200
システムリサーチ	11,600	1,771.00	20,543,600
インターネットイニシアティブ	85,100	2,158.50	183,688,350
さくらインターネット	21,800	2,985.00	65,073,000
G M Oグローバルサイン・ホールディングス	4,800	2,040.00	9,792,000
S R Aホールディングス	8,700	5,030.00	43,761,000
朝日ネット	16,700	690.00	11,523,000
e B A S E	19,200	423.00	8,121,600
アバントグループ	17,500	1,415.00	24,762,500
アドソル日進	12,500	1,702.00	21,275,000
フリービット	8,100	1,558.00	12,619,800
コムチュア	20,600	1,422.00	29,293,200

アステリア	12,200	1,211.00	14,774,200
アイル	8,700	2,325.00	20,227,500
王子ホールディングス	588,100	978.50	575,455,850
日本製紙	87,600	1,283.00	112,390,800
北越コーポレーション	87,300	990.00	86,427,000
大王製紙	78,600	1,135.00	89,211,000
マークライnz	9,200	1,660.00	15,272,000
g u m i	28,700	321.00	9,212,700
テラスカイ	5,200	1,822.00	9,474,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	16,200	1,035.00	16,767,000
ネオジャパン	4,100	1,730.00	7,093,000
P R T I M E S	3,200	2,351.00	7,523,200
ラクス	146,400	789.60	115,597,440
ダブルスタンダード	5,500	1,494.00	8,217,000
オーブンドア	9,200	351.00	3,229,200
アカツキ	7,500	3,025.00	22,687,500
U b i c o mホールディングス	5,000	968.00	4,840,000
カナミックネットワーク	19,500	536.00	10,452,000
レンゴー	157,100	1,537.50	241,541,250
トーモク	9,000	3,620.00	32,580,000
ザ・パック	31,100	1,323.00	41,145,300
チェンジホールディングス	30,000	931.00	27,930,000
オークネット	14,400	2,287.00	32,932,800
オロ	6,400	1,948.00	12,467,200
ユーザーローカル	6,600	1,548.00	10,216,800
P K S H A T e c h n o l o g y	18,500	2,840.00	52,540,000
マネーフォワード	35,400	2,886.00	102,164,400
レゾナック・ホールディングス	150,100	11,880.00	1,783,188,000
住友化学	1,249,700	553.40	691,583,980
住友精化	6,400	7,060.00	45,184,000
日産化学	78,800	7,058.00	556,170,400
ラサ工業	5,100	10,540.00	53,754,000
クレハ	23,200	4,850.00	112,520,000
多木化学	5,900	3,875.00	22,862,500
テイカ	11,200	1,781.00	19,947,200
石原産業	25,800	3,805.00	98,169,000
日本曹達	33,000	4,170.00	137,610,000
東ソー	226,100	2,669.50	603,573,950
トクヤマ	54,400	4,342.00	236,204,800
セントラル硝子	19,600	4,345.00	85,162,000
東亜合成	62,600	1,871.50	117,155,900
大阪ソーダ	54,300	2,404.00	130,537,200
関東電化工業	30,000	1,772.00	53,160,000
G M Oフィナンシャルゲート	2,600	4,990.00	12,974,000
S U N A S T E R I S K	13,700	408.00	5,589,600
デンカ	61,600	3,387.00	208,639,200
イビデン	196,000	9,652.00	1,891,792,000
信越化学工業	1,381,100	5,934.00	8,195,447,400
日本カーバイド工業	7,600	3,035.00	23,066,000

プラスアルファ・コンサルティング	19,800	2,086.00	41,302,800
電算システムホールディングス	6,800	2,965.00	20,162,000
堺化学工業	12,800	4,055.00	51,904,000
第一稀元素化学工業	15,700	2,924.00	45,906,800
エア・ウォーター	146,600	2,103.00	308,299,800
日本酸素ホールディングス	175,800	5,816.00	1,022,452,800
日本化学工業	6,200	3,530.00	21,886,000
日本パーカライジング	77,000	1,576.00	121,352,000
高压ガス工業	22,600	1,110.00	25,086,000
四国化成ホールディングス	17,600	5,580.00	98,208,000
オリオンビール	24,900	1,317.00	32,793,300
戸田工業	3,600	1,510.00	5,436,000
ステラ ケミファ	8,300	5,590.00	46,397,000
保土谷化学工業	9,800	2,393.00	23,451,400
日本触媒	95,600	2,492.00	238,235,200
大日精化工業	10,500	4,960.00	52,080,000
カネカ	38,200	5,140.00	196,348,000
協和キリン	182,900	2,818.00	515,412,200
ブルーゾーンホールディングス	19,400	9,685.00	187,889,000
A P P I E R G R O U P	59,400	722.00	42,886,800
三菱瓦斯化学	110,400	4,402.00	485,980,800
三井化学	279,500	2,274.50	635,722,750
東京応化工業	74,100	9,315.00	690,241,500
大阪有機化学工業	13,000	4,630.00	60,190,000
三菱ケミカルグループ	1,086,400	1,127.00	1,224,372,800
K H ネオケム	25,900	3,025.00	78,347,500
ビジョナル	18,600	6,482.00	120,565,200
ダイセル	170,400	1,634.00	278,433,600
住友ベークライト	54,400	5,958.00	324,115,200
積水化学工業	324,500	2,984.00	968,308,000
日本ゼオン	112,300	2,067.50	232,180,250
アイカ工業	39,200	3,924.00	153,820,800
U B E	79,900	2,817.50	225,118,250
積水樹脂	18,500	2,424.00	44,844,000
旭有機材	10,400	5,120.00	53,248,000
ニチバン	9,700	1,999.00	19,390,300
リケンテクノス	26,700	1,801.00	48,086,700
大倉工業	7,900	5,050.00	39,895,000
積水化成成品工業	24,700	526.00	12,992,200
群栄化学工業	3,800	5,180.00	19,684,000
ダイキョーニシカワ	33,100	915.00	30,286,500
森六	8,400	2,606.00	21,890,400
恵和	10,100	1,324.00	13,372,400
日本化薬	111,200	1,959.50	217,896,400
カーリット	13,900	2,739.00	38,072,100
C L ホールディングス	4,000	1,138.00	4,552,000
プレステージ・インターナショナル	59,000	681.00	40,179,000
ハイマックス	4,900	1,268.00	6,213,200
テクセンドフォトマスク	43,100	2,896.00	124,817,600
アミューズ	8,700	2,055.00	17,878,500

野村総合研究所	303,300	3,800.00	1,152,540,000	
ドリームインキュベータ	5,000	2,930.00	14,650,000	
クイック	39,400	901.00	35,499,400	
日本システム技術	14,400	2,001.00	28,814,400	
電通グループ	154,100	2,795.50	430,786,550	
インテージホールディングス	11,700	1,657.00	19,386,900	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,700	721.00	5,551,700	
東邦システムサイエンス	7,300	1,127.00	8,227,100	
ぴあ	7,300	2,942.00	21,476,600	
イオンファンタジー	6,800	2,765.00	18,802,000	
ソースネクスト	80,600	125.00	10,075,000	
シーティーエス	19,600	974.00	19,090,400	
メディカルシステムネットワーク	16,000	520.00	8,320,000	
日本精化	9,700	2,753.00	26,704,100	
扶桑化学工業	16,400	9,310.00	152,684,000	
トリケミカル研究所	18,900	3,655.00	69,079,500	
シンプレクス・ホールディングス	123,200	790.00	97,328,000	
HEROZ	6,100	796.00	4,855,600	
ラクスル	31,000	1,896.00	58,776,000	
メルカリ	66,900	3,452.00	230,938,800	
I P S	4,500	3,145.00	14,152,500	
システムサポートホールディングス	10,900	1,227.00	13,374,300	
A D E K A	60,100	4,659.00	280,005,900	
日油	178,300	3,034.00	540,962,200	
ハリマ化成グループ	12,200	1,050.00	12,810,000	
ボードルア	8,400	1,801.00	15,128,400	
イーソル	10,500	568.00	5,964,000	
ウイングアーク1st	16,200	2,589.00	41,941,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,200	955.00	5,921,000	
サーバーワークス	3,300	1,849.00	6,101,700	
S a n s a n	51,400	1,077.00	55,357,800	
ギフティ	12,100	946.00	11,446,600	
花王	368,200	6,649.00	2,448,161,800	
第一工業製薬	6,100	11,960.00	72,956,000	
石原ケミカル	6,600	3,050.00	20,130,000	
三洋化成工業	9,600	5,930.00	56,928,000	
メドレー	19,000	1,883.00	35,777,000	
ベース	6,500	3,220.00	20,930,000	
J M D C	22,800	4,060.00	92,568,000	
武田薬品工業	1,383,800	5,802.00	8,028,807,600	
アステラス製薬	1,364,100	2,532.00	3,453,901,200	
住友ファーマ	138,500	2,345.00	324,782,500	
塩野義製薬	567,400	3,664.00	2,078,953,600	
日本新薬	40,800	5,015.00	204,612,000	
中外製薬	486,800	10,350.00	5,038,380,000	
科研製薬	23,000	4,375.00	100,625,000	
エーザイ	202,900	5,169.00	1,048,790,100	
理研ビタミン	13,400	3,040.00	40,736,000	
ロート製薬	164,300	2,377.50	390,623,250	

小野薬品工業	346,900	2,645.50	917,723,950
久光製薬	34,900	6,030.00	210,447,000
持田製薬	19,000	3,900.00	74,100,000
参天製薬	261,600	1,753.50	458,715,600
扶桑薬品工業	6,000	2,423.00	14,538,000
ツムラ	53,400	4,079.00	217,818,600
テルモ	1,030,300	2,044.50	2,106,448,350
H・U・グループホールディングス	49,900	3,259.00	162,624,100
キッセイ薬品工業	24,300	4,900.00	119,070,000
生化学工業	26,300	733.00	19,277,900
栄研化学	22,000	3,255.00	71,610,000
JCRファーマ	67,700	680.00	46,036,000
東和薬品	20,900	4,380.00	91,542,000
富士製薬工業	11,500	2,340.00	26,910,000
ゼリア新薬工業	21,100	2,216.00	46,757,600
ネクセラファーマ	68,100	938.00	63,877,800
第一三共	1,427,900	2,995.50	4,277,274,450
杏林製薬	31,400	1,698.00	53,317,200
大幸薬品	32,400	297.00	9,622,800
ダイト	19,200	1,450.00	27,840,000
大塚ホールディングス	346,300	10,390.00	3,598,057,000
ペプチドリーム	75,400	1,398.00	105,409,200
大日本塗料	17,200	1,469.00	25,266,800
日本ペイントホールディングス	824,800	1,145.00	944,396,000
関西ペイント	123,800	2,710.00	335,498,000
中国塗料	31,900	4,555.00	145,304,500
藤倉化成	18,000	1,119.00	20,142,000
太陽ホールディングス	74,400	5,428.00	403,843,200
DIC	55,200	4,261.00	235,207,200
サカタインクス	34,500	2,634.00	90,873,000
artience	29,100	4,310.00	125,421,000
アルプス技研	13,300	2,636.00	35,058,800
サンックスホールディングス	20,100	209.00	4,200,900
日本空調サービス	17,200	1,659.00	28,534,800
オリエンタルランド	939,600	2,775.50	2,607,859,800
フォーカスシステムズ	10,500	1,640.00	17,220,000
ダスキン	36,200	4,272.00	154,646,400
パーク24	109,200	2,173.00	237,291,600
明光ネットワークジャパン	21,000	720.00	15,120,000
ファルコホールディングス	6,300	2,698.00	16,997,400
クレスコ	26,700	1,522.00	40,637,400
フジ・メディア・ホールディングス	122,200	3,393.00	414,624,600
ラウンドワン	150,700	1,013.50	152,734,450
リゾートトラスト	151,000	1,901.00	287,051,000
オービック	288,700	3,898.00	1,125,352,600
ジャストシステム	22,400	3,840.00	86,016,000
TDCソフト	29,100	1,051.00	30,584,100
LINEヤフー	2,394,400	367.00	878,744,800
ビー・エム・エル	21,300	4,295.00	91,483,500
トレンドマイクロ	89,800	5,028.00	451,514,400

IDホールディングス	10,100	1,960.00	19,796,000
リソー教育グループ	50,200	207.00	10,391,400
日本オラクル	29,700	9,115.00	270,715,500
早稲田アカデミー	7,700	2,029.00	15,623,300
アルファシステムズ	5,000	3,640.00	18,200,000
NSグループ	20,400	1,702.00	34,720,800
フューチャー	33,300	1,742.00	58,008,600
CAC Holdings	9,600	1,904.00	18,278,400
ユー・エス・エス	302,300	1,897.00	573,463,100
オービックビジネスコンサルタント	26,300	5,788.00	152,224,400
アイティフォー	16,200	1,706.00	27,637,200
東計電算	4,400	4,290.00	18,876,000
サイバーエージェント	323,300	1,322.50	427,564,250
楽天グループ	1,256,600	816.90	1,026,516,540
クリーク・アンド・リバー社	9,400	1,476.00	13,874,400
SBIグローバルアセットマネジメント	29,800	602.00	17,939,600
テー・オー・ダブリュー	28,400	380.00	10,792,000
大塚商会	176,300	3,000.00	528,900,000
サイボウズ	21,400	2,106.00	45,068,400
山田コンサルティンググループ	6,900	1,703.00	11,750,700
セントラルスポーツ	5,900	2,467.00	14,555,300
パラカ	4,300	2,010.00	8,643,000
電通総研	56,600	1,800.00	101,880,000
デジタルガレージ	22,100	1,960.00	43,316,000
イーエムシステムズ	20,500	703.00	14,411,500
ウェザーニューズ	11,000	4,240.00	46,640,000
C I J	37,600	508.00	19,100,800
ビジネスエンジニアリング	18,300	1,347.00	24,650,100
WOWOW	11,700	1,315.00	15,385,500
スカラ	14,500	363.00	5,263,500
フルキャストホールディングス	12,300	1,638.00	20,147,400
エン	26,000	1,168.00	30,368,000
セルソース	9,300	402.00	3,738,600
あすか製薬ホールディングス	15,100	2,450.00	36,995,000
サワイグループホールディングス	80,300	2,309.50	185,452,850
富士フイルムホールディングス	937,700	3,040.00	2,850,608,000
コニカミノルタ	349,800	597.40	208,970,520
資生堂	301,400	3,218.00	969,905,200
ライオン	178,500	1,809.00	322,906,500
高砂香料工業	58,400	1,370.00	80,008,000
マンダム	33,600	3,105.00	104,328,000
ミルボン	25,000	2,790.00	69,750,000
コーセーホールディングス	35,100	6,100.00	214,110,000
コタ	17,300	1,321.00	22,853,300
ポーラ・オルビスホールディングス	79,700	1,386.00	110,464,200
ノエビアホールディングス	13,900	4,680.00	65,052,000
新日本製薬	8,900	2,114.00	18,814,600
I - n e	4,100	1,071.00	4,391,100
アクシージア	9,900	380.00	3,762,000

エステー	14,700	1,566.00	23,020,200
コニシ	49,000	1,362.00	66,738,000
長谷川香料	29,700	2,878.00	85,476,600
小林製薬	40,800	5,726.00	233,620,800
荒川化学工業	13,200	1,501.00	19,813,200
メック	11,400	6,840.00	77,976,000
日本高純度化学	3,900	5,190.00	20,241,000
タカラバイオ	41,800	1,147.00	47,944,600
JCU	16,900	6,970.00	117,793,000
OATアグリオ	5,700	2,389.00	13,617,300
デクセリアルズ	133,000	2,434.50	323,788,500
アース製薬	14,200	5,020.00	71,284,000
北興化学工業	11,500	1,849.00	21,263,500
大成ラミックグループ	4,500	2,789.00	12,550,500
クミアイ化学工業	69,400	721.00	50,037,400
日本農薬	23,800	1,047.00	24,918,600
ニチレキグループ	16,600	2,400.00	39,840,000
ユシロ	8,100	3,165.00	25,636,500
JX金属	444,200	4,145.00	1,841,209,000
出光興産	672,500	1,390.50	935,111,250
ENEOSホールディングス	2,197,300	1,440.00	3,164,112,000
コスモエネルギーホールディングス	86,200	4,664.00	402,036,800
ANYCOLOR	24,800	3,760.00	93,248,000
日本ビジネスシステムズ	8,400	1,546.00	12,986,400
テスホールディングス	36,900	591.00	21,807,900
インフロニア・ホールディングス	159,300	2,551.50	406,453,950
横浜ゴム	86,900	7,909.00	687,292,100
TOYO TIRE	98,300	4,820.00	473,806,000
ブリヂストン	910,600	3,727.00	3,393,806,200
住友ゴム工業	167,800	2,778.50	466,232,300
藤倉コンポジット	12,800	2,671.00	34,188,800
オカモト	8,000	5,820.00	46,560,000
アキレス	8,400	1,814.00	15,237,600
フコク	8,200	2,018.00	16,547,600
ニッタ	15,400	4,575.00	70,455,000
三ツ星ベルト	19,800	4,265.00	84,447,000
バンドー化学	23,100	2,382.00	55,024,200
AGC	151,300	6,578.00	995,251,400
日本板硝子	84,000	603.00	50,652,000
有沢製作所	27,200	2,660.00	72,352,000
日本電気硝子	51,900	6,694.00	347,418,600
オハラ	5,900	1,169.00	6,897,100
住友大阪セメント	26,000	4,548.00	118,248,000
太平洋セメント	95,900	4,542.00	435,577,800
日本ヒューム	27,200	1,516.00	41,235,200
日本コンクリート工業	30,400	347.00	10,548,800
三谷セキサン	5,400	7,900.00	42,660,000
アジアパイルホールディングス	24,400	1,546.00	37,722,400
東海カーボン	156,500	1,051.00	164,481,500
日本カーボン	8,900	4,965.00	44,188,500

東洋炭素	13,400	6,080.00	81,472,000
ノリタケ	16,300	6,930.00	112,959,000
TOTO	96,400	6,278.00	605,199,200
日本碍子	172,800	4,484.00	774,835,200
日本特殊陶業	127,100	7,899.00	1,003,962,900
MARUWA	6,400	60,950.00	390,080,000
品川リフラ	19,100	2,403.00	45,897,300
黒崎播磨	12,700	4,200.00	53,340,000
ヨータイ	9,100	1,978.00	17,999,800
フジインコーポレーテッド	46,500	3,290.00	152,985,000
ニチアス	43,200	9,162.00	395,798,400
日本製鉄	4,362,400	627.30	2,736,533,520
神戸製鋼所	321,700	2,196.00	706,453,200
中山製鋼所	33,200	615.00	20,418,000
合同製鉄	9,000	3,940.00	35,460,000
JFEホールディングス	519,100	2,170.50	1,126,706,550
東京製鉄	44,700	1,569.00	70,134,300
共英製鋼	18,300	2,611.00	47,781,300
大和工業	28,700	12,965.00	372,095,500
東京鐵鋼	6,500	6,230.00	40,495,000
大阪製鉄	7,300	2,606.00	19,023,800
ヨドコウ	92,400	1,416.00	130,838,400
中部鋼鈹	14,700	2,515.00	36,970,500
丸一鋼管	160,900	1,605.00	258,244,500
モリ工業	18,100	1,028.00	18,606,800
大同特殊鋼	113,300	2,240.50	253,848,650
日本冶金工業	10,800	5,080.00	54,864,000
愛知製鋼	29,900	3,405.00	101,809,500
大平洋金属	13,700	3,245.00	44,456,500
新日本電工	87,900	445.00	39,115,500
栗本鐵工所	37,000	1,719.00	63,603,000
日本製鋼所	47,400	9,651.00	457,457,400
三菱製鋼	11,000	2,008.00	22,088,000
日本精線	12,800	1,329.00	17,011,200
エンピプロ・ホールディングス	14,100	1,012.00	14,269,200
大紀アルミニウム工業所	23,000	1,449.00	33,327,000
日本輕金属ホールディングス	46,900	3,105.00	145,624,500
三井金属	40,000	35,740.00	1,429,600,000
東邦亜鉛	13,400	1,684.00	22,565,600
三菱マテリアル	106,800	5,662.00	604,701,600
住友金属鉱山	219,200	11,650.00	2,553,680,000
DOWAホールディングス	43,100	10,495.00	452,334,500
古河機械金属	19,000	5,730.00	108,870,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,700	2,840.00	78,668,000
東邦チタニウム	28,900	1,891.00	54,649,900
UACJ	96,700	2,642.00	255,481,400
CKサンエツ	3,100	4,455.00	13,810,500
古河電氣工業	53,300	28,125.00	1,499,062,500
住友電氣工業	552,400	10,715.00	5,918,966,000
フジクラ	205,800	26,825.00	5,520,585,000

SWCC	23,300	15,800.00	368,140,000
平河ヒューテック	9,200	4,470.00	41,124,000
いよぎんホールディングス	199,900	3,153.00	630,284,700
しずおかフィナンシャルグループ	336,400	2,956.50	994,566,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	128,600	3,108.00	399,688,800
楽天銀行	80,900	7,958.00	643,802,200
京都フィナンシャルグループ	209,700	3,471.00	727,868,700
リョービ	19,000	2,967.00	56,373,000
AREホールディングス	64,700	4,315.00	279,180,500
東洋製罐グループホールディングス	79,900	4,015.00	320,798,500
ホッカフホールディングス	8,500	2,450.00	20,825,000
コロナ	9,000	1,062.00	9,558,000
横河ブリッジホールディングス	27,500	3,180.00	87,450,000
三和ホールディングス	153,800	4,085.00	628,273,000
文化シャッター	50,200	2,090.00	104,918,000
三協立山	20,000	698.00	13,960,000
アルインコ	12,300	1,139.00	14,009,700
LIXIL	250,000	1,802.00	450,500,000
ノーリツ	28,100	2,426.00	68,170,600
長府製作所	15,800	2,132.00	33,685,600
リンナイ	81,800	4,011.00	328,099,800
ユニプレス	28,700	1,484.00	42,590,800
日東精工	21,000	778.00	16,338,000
岡部	28,500	1,019.00	29,041,500
ジーテクト	20,300	2,047.00	41,554,100
東プレ	28,200	2,890.00	81,498,000
高周波熱錬	24,200	1,467.00	35,501,400
東京製綱	9,600	2,008.00	19,276,800
サンコール	15,800	1,171.00	18,501,800
パイオラックス	17,200	1,760.00	30,272,000
エイチワン	16,400	1,445.00	23,698,000
日本発条	120,500	2,997.50	361,198,750
中央発條	10,400	3,365.00	34,996,000
三浦工業	72,600	3,073.00	223,099,800
タクマ	46,800	2,924.00	136,843,200
弁護士ドットコム	5,900	2,305.00	13,599,500
アイ・アールジャパンホールディングス	8,300	803.00	6,664,900
Keeper 技研	9,900	3,460.00	34,254,000
Gunosy	12,600	548.00	6,904,800
イー・ガーディアン	4,900	1,652.00	8,094,800
ジャパンマテリアル	48,800	2,123.00	103,602,400
ベクトル	21,800	1,370.00	29,866,000
チャーム・ケア・コーポレーション	13,300	1,402.00	18,646,600
キャリアリンク	5,800	2,800.00	16,240,000
IBJ	12,200	750.00	9,150,000
アサンテ	7,600	1,621.00	12,319,600
バリューHR	14,300	1,421.00	20,320,300
M&Aキャピタルパートナーズ	12,900	3,540.00	45,666,000

ライドオンエクスプレスホールディングス	6,300	1,025.00	6,457,500	
シグママックス・ホールディングス	44,900	684.00	30,711,600	
ウィルグループ	14,800	1,276.00	18,884,800	
リクルートホールディングス	1,178,900	6,290.00	7,415,281,000	
エラン	14,100	758.00	10,687,800	
ツガミ	33,400	3,985.00	133,099,000	
オークマ	27,300	4,600.00	125,580,000	
芝浦機械	18,700	4,560.00	85,272,000	
アマダ	228,300	2,535.00	578,740,500	
アイダエンジニアリング	29,600	1,170.00	34,632,000	
F U J I	62,400	5,985.00	373,464,000	
牧野フライス製作所	15,800	11,650.00	184,070,000	
オーエスジー	55,800	2,871.00	160,201,800	
旭ダイヤモンド工業	37,600	1,491.00	56,061,600	
D M G 森精機	107,300	3,010.00	322,973,000	
ソディック	38,100	1,475.00	56,197,500	
ディスコ	75,500	80,000.00	6,040,000,000	
日東工器	5,500	1,883.00	10,356,500	
日進工具	13,200	925.00	12,210,000	
富士ダイス	11,600	1,251.00	14,511,600	
日本郵政	1,435,300	1,981.50	2,844,046,950	
ベルシステム24ホールディングス	21,600	1,489.00	32,162,400	
鎌倉新書	15,900	560.00	8,904,000	
エアトリ	13,000	726.00	9,438,000	
アトラエ	11,900	709.00	8,437,100	
ストライク	7,800	4,355.00	33,969,000	
ソラスト	38,500	935.00	35,997,500	
セラク	4,800	1,601.00	7,684,800	
インソース	34,600	704.00	24,358,400	
豊田自動織機	132,300	20,200.00	2,672,460,000	
リケンNPR	18,000	4,445.00	80,010,000	
島精機製作所	25,000	1,012.00	25,300,000	
オプトラン	25,800	2,998.00	77,348,400	
イワキ	10,500	2,839.00	29,809,500	
フリーー	16,400	1,195.00	19,598,000	
ヤマシンフィルタ	32,500	582.00	18,915,000	
日阪製作所	18,400	1,721.00	31,666,400	
やまびこ	25,700	3,815.00	98,045,500	
野村マイクロ・サイエンス	28,200	3,355.00	94,611,000	
平田機工	22,500	2,998.00	67,455,000	
P E G A S U S	17,300	825.00	14,272,500	
マルマエ	6,000	3,615.00	21,690,000	
タツモ	10,400	2,541.00	26,426,400	
ナブテスコ	89,000	4,866.00	433,074,000	
三井海洋開発	39,600	13,000.00	514,800,000	
レオン自動機	18,100	1,607.00	29,086,700	
S M C	44,400	75,960.00	3,372,624,000	
ホソカワミクロン	11,800	6,660.00	78,588,000	
ユニオンツール	6,800	15,980.00	108,664,000	

瑞光	13,300	975.00	12,967,500	
オイレス工業	19,300	2,643.00	51,009,900	
日精エー・エス・ビー機械	6,000	8,980.00	53,880,000	
サトー	21,400	2,464.00	52,729,600	
技研製作所	14,100	2,502.00	35,278,200	
日本エアテック	7,300	1,312.00	9,577,600	
日精樹脂工業	10,300	906.00	9,331,800	
ワイエイシイホールディングス	13,600	1,190.00	16,184,000	
小松製作所	755,200	7,625.00	5,758,400,000	
住友重機械工業	92,600	5,790.00	536,154,000	
日立建機	62,400	6,806.00	424,694,400	
日工	30,200	854.00	25,790,800	
巴工業	17,400	2,170.00	37,758,000	
井関農機	14,700	2,070.00	30,429,000	
TOWA	56,700	2,948.00	167,151,600	
北川鉄工所	6,100	1,851.00	11,291,100	
ローツェ	92,000	3,443.00	316,756,000	
クボタ	792,300	3,103.00	2,458,506,900	
荏原実業	16,400	2,876.00	47,166,400	
東洋エンジニアリング	22,400	3,425.00	76,720,000	
三菱化工機	16,500	3,755.00	61,957,500	
月島ホールディングス	20,900	3,370.00	70,433,000	
帝国電機製作所	10,800	3,360.00	36,288,000	
新東工業	31,600	1,178.00	37,224,800	
澁谷工業	14,700	3,630.00	53,361,000	
アイチコーポレーション	26,000	1,448.00	37,648,000	
小森コーポレーション	37,200	1,774.00	65,992,800	
鶴見製作所	22,100	2,290.00	50,609,000	
酒井重工業	6,100	2,239.00	13,657,900	
荏原製作所	321,600	5,607.00	1,803,211,200	
西島製作所	11,700	2,638.00	30,864,600	
AIRMAN	15,700	2,159.00	33,896,300	
ダイキン工業	204,000	20,530.00	4,188,120,000	
オルガノ	21,500	17,095.00	367,542,500	
トーヨーカネツ	13,000	3,090.00	40,170,000	
栗田工業	94,400	8,531.00	805,326,400	
椿本チエイン	67,800	2,661.00	180,415,800	
日機装	36,100	2,444.00	88,228,400	
木村化工機	11,900	1,351.00	16,076,900	
レイズネクスト	22,000	2,566.00	56,452,000	
アネスト岩田	29,000	1,764.00	51,156,000	
ダイフク	264,300	6,265.00	1,655,839,500	
サムコ	4,200	6,230.00	26,166,000	
タダノ	82,600	1,420.00	117,292,000	
CKD	47,200	5,460.00	257,712,000	
平和	46,300	2,000.00	92,600,000	
理想科学工業	25,200	1,274.00	32,104,800	
SANKYO	165,800	2,156.00	357,464,800	
日本金銭機械	19,000	1,198.00	22,762,000	
マースグループホールディングス	13,200	3,150.00	41,580,000	

ガリレイ	23,100	3,840.00	88,704,000
ダイコク電機	7,700	2,648.00	20,389,600
竹内製作所	28,300	7,640.00	216,212,000
アマノ	41,300	4,053.00	167,388,900
JUKI	24,400	718.00	17,519,200
ジャノメ	11,500	1,440.00	16,560,000
ブラザー工業	194,200	3,184.00	618,332,800
マックス	21,600	6,960.00	150,336,000
モリタホールディングス	24,600	2,962.00	72,865,200
グローリー	41,000	4,098.00	168,018,000
新晃工業	42,000	1,430.00	60,060,000
大和冷機工業	24,100	1,955.00	47,115,500
セガサミーホールディングス	128,300	2,570.00	329,731,000
T P R	35,800	1,386.00	49,618,800
ツバキ・ナカシマ	36,400	352.00	12,812,800
ホシザキ	100,800	5,587.00	563,169,600
大豊工業	12,000	1,117.00	13,404,000
日本精工	289,700	1,358.00	393,412,600
NTN	415,700	412.90	171,642,530
ジェイテクト	147,900	2,077.50	307,262,250
不二越	11,500	5,230.00	60,145,000
ミネベアミツミ	272,400	3,260.00	888,024,000
日本トムソン	42,600	1,075.00	45,795,000
THK	82,900	5,266.00	436,551,400
YUSHIN	12,500	750.00	9,375,000
前澤給装工業	11,400	1,709.00	19,482,600
イーグル工業	17,300	3,435.00	59,425,500
PILLAR	14,500	8,500.00	123,250,000
キッツ	55,900	2,190.00	122,421,000
日立製作所	3,984,900	4,880.00	19,446,312,000
三菱電機	1,715,500	5,860.00	10,052,830,000
富士電機	112,500	13,420.00	1,509,750,000
安川電機	170,200	5,403.00	919,590,600
シンフォニアテクノロジー	17,300	12,410.00	214,693,000
明電舎	29,000	7,750.00	224,750,000
山洋電気	18,100	5,040.00	91,224,000
デンヨー	11,400	3,925.00	44,745,000
PHCホールディングス	29,400	1,068.00	31,399,200
KOKUSAI ELECTRIC	179,500	6,418.00	1,152,031,000
ソシオネクスト	135,600	1,996.00	270,657,600
ベイカレント	117,200	4,061.00	475,949,200
Orchestra Holdings	3,600	1,139.00	4,100,400
アイモバイル	23,600	526.00	12,413,600
MS - Japan	10,200	1,068.00	10,893,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	134,200	1,623.00	217,806,600
エル・ティー・エス	2,200	1,697.00	3,733,400
ミダックホールディングス	8,100	2,099.00	17,001,900
キュービーネットホールディングス	7,700	1,361.00	10,479,700

オープングループ	21,900	239.00	5,234,100	
三櫻工業	23,700	854.00	20,239,800	
マキタ	194,800	6,007.00	1,170,163,600	
東芝テック	20,000	3,235.00	64,700,000	
芝浦メカトロニクス	9,700	28,400.00	275,480,000	
マブチモーター	151,200	1,836.50	277,678,800	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,100	340.00	3,434,000	
トレックス・セミコンダクター	6,000	1,702.00	10,212,000	
東光高岳	8,500	5,730.00	48,705,000	
ダブル・スコープ	51,200	173.00	8,857,600	
宮越ホールディングス	6,800	788.00	5,358,400	
ダイヘン	14,600	14,680.00	214,328,000	
ヤーマン	30,400	700.00	21,280,000	
JVCケンウッド	123,600	1,272.50	157,281,000	
ミマキエンジニアリング	13,000	1,858.00	24,154,000	
大崎電気工業	29,900	1,667.00	49,843,300	
オムロン	131,500	5,532.00	727,458,000	
日東工業	18,800	4,680.00	87,984,000	
I D E C	20,000	3,280.00	65,600,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	64,100	5,513.00	353,383,300	
B U F F A L O	4,200	5,180.00	21,756,000	
テクノメディカ	3,100	2,706.00	8,388,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	6,300	664.00	4,183,200	
日本電気	1,028,400	3,760.00	3,866,784,000	
富士通	1,441,200	3,345.00	4,820,814,000	
沖電気工業	75,900	3,070.00	233,013,000	
電気興業	5,700	3,335.00	19,009,500	
サンケン電気	16,000	7,757.00	124,112,000	
アイホン	8,200	2,924.00	23,976,800	
ルネサスエレクトロニクス	1,518,500	2,949.00	4,478,056,500	
セイコーエプソン	194,800	2,119.00	412,781,200	
ワコム	94,000	870.00	81,780,000	
アルバック	40,100	10,855.00	435,285,500	
アクセル	7,100	1,250.00	8,875,000	
E I Z O	22,100	2,256.00	49,857,600	
ジャパンディスプレイ	900,100	24.00	21,602,400	
日本信号	39,600	1,741.00	68,943,600	
京三製作所	36,500	770.00	28,105,000	
能美防災	21,200	4,430.00	93,916,000	
ホーチキ	12,200	6,170.00	75,274,000	
エレコム	37,400	1,771.00	66,235,400	
パナソニック ホールディングス	1,850,300	2,541.00	4,701,612,300	
シャープ	188,600	632.00	119,195,200	
アンリツ	102,500	3,103.00	318,057,500	
ソニーグループ	5,348,900	3,292.00	17,608,578,800	
T D K	1,352,500	2,378.00	3,216,245,000	
帝国通信工業	6,700	2,875.00	19,262,500	
タムラ製作所	62,500	729.00	45,562,500	
アルプスアルパイン	120,700	2,370.50	286,119,350	

日本電波工業	18,800	1,287.00	24,195,600
鈴木	8,300	3,065.00	25,439,500
メイコー	14,000	22,160.00	310,240,000
日本トリム	3,600	5,010.00	18,036,000
フォスター電機	14,500	3,095.00	44,877,500
S M K	3,800	3,495.00	13,281,000
ヨコオ	13,900	3,745.00	52,055,500
ホシデン	31,400	2,946.00	92,504,400
ヒロセ電機	22,800	23,985.00	546,858,000
日本航空電子工業	36,700	2,659.00	97,585,300
T O A	15,800	1,811.00	28,613,800
マクセル	32,700	2,254.00	73,705,800
古野電気	20,300	7,990.00	162,197,000
スミダコーポレーション	26,800	1,217.00	32,615,600
アイコム	5,900	3,185.00	18,791,500
リオン	6,400	3,015.00	19,296,000
横河電機	171,300	6,014.00	1,030,198,200
新電元工業	6,500	4,080.00	26,520,000
アズビル	376,600	1,388.00	522,720,800
日本光電工業	128,900	1,708.50	220,225,650
チノー	12,900	1,789.00	23,078,100
日本電子材料	9,600	9,990.00	95,904,000
堀場製作所	29,300	19,865.00	582,044,500
アドバンテスト	488,600	28,615.00	13,981,289,000
エスベック	15,200	3,920.00	59,584,000
キーエンス	155,100	67,150.00	10,414,965,000
日置電機	8,100	7,680.00	62,208,000
シスメックス	401,500	1,381.50	554,672,250
日本マイクロニクス	25,600	13,100.00	335,360,000
メガチップス	9,900	8,910.00	88,209,000
O B A R A G R O U P	8,500	5,720.00	48,620,000
デンソー	1,519,200	2,225.50	3,380,979,600
コーセル	19,000	1,362.00	25,878,000
イリソ電子工業	12,800	3,785.00	48,448,000
オブテックスグループ	26,300	3,140.00	82,582,000
千代田インテグレ	3,900	3,475.00	13,552,500
レーザーテック	65,600	32,540.00	2,134,624,000
スタンレー電気	79,300	3,279.00	260,024,700
ウシオ電機	64,400	3,176.00	204,534,400
日本セラミック	12,600	3,875.00	48,825,000
山一電機	15,200	9,030.00	137,256,000
図研	12,900	4,540.00	58,566,000
日本電子	35,900	6,900.00	247,710,000
カシオ計算機	124,000	1,623.50	201,314,000
ファナック	740,500	6,735.00	4,987,267,500
日本シイエムケイ	49,500	629.00	31,135,500
エンプラス	4,500	14,510.00	65,295,000
大真空	22,400	678.00	15,187,200
ローム	304,400	2,785.00	847,754,000
浜松ホトニクス	259,100	2,041.00	528,823,100

三井ハイテック	80,100	835.00	66,883,500
京セラ	963,400	2,779.50	2,677,770,300
太陽誘電	83,000	5,131.00	425,873,000
村田製作所	1,479,800	4,223.00	6,249,195,400
双葉電子工業	32,000	719.00	23,008,000
日東電工	472,100	3,600.00	1,699,560,000
東海理化電機製作所	41,500	3,330.00	138,195,000
ニチコン	40,600	2,211.00	89,766,600
日本ケミコン	19,400	1,826.00	35,424,400
K O A	28,200	2,032.00	57,302,400
三井E & S	77,800	7,808.00	607,462,400
カナデビア	128,300	1,065.00	136,639,500
三菱重工業	2,934,200	4,752.00	13,943,318,400
川崎重工業	116,900	17,400.00	2,034,060,000
I H I	816,200	4,010.00	3,272,962,000
名村造船所	48,300	5,500.00	265,650,000
マネジメントソリューションズ	8,800	1,435.00	12,628,000
プロレド・パートナーズ	3,900	480.00	1,872,000
フロンティア・マネジメント	5,000	558.00	2,790,000
アンピスホールディングス	34,200	499.00	17,065,800
カーブスホールディングス	43,600	784.00	34,182,400
Mac bee Planet	5,900	1,427.00	8,419,300
日本車輛製造	5,900	4,140.00	24,426,000
ユニソルホールディングス	14,100	2,314.00	32,627,400
ヤマエグループホールディングス	16,100	3,085.00	49,668,500
F P G	48,600	2,045.00	99,387,000
ライフネット生命保険	24,500	2,099.00	51,425,500
全国保証	87,800	3,187.00	279,818,600
めぶきフィナンシャルグループ	714,000	1,279.00	913,206,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	24,800	2,000.00	49,600,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,500	11,010.00	214,695,000
九州フィナンシャルグループ	295,600	1,250.00	369,500,000
かんぽ生命保険	172,500	4,886.00	842,835,000
ゆうちょ銀行	1,658,900	2,950.00	4,893,755,000
富山第一銀行	48,500	2,580.00	125,130,000
横浜フィナンシャルグループ	796,400	1,607.00	1,279,814,800
ジェイリース	11,500	1,403.00	16,134,500
西日本フィナンシャルホールディングス	93,400	4,215.00	393,681,000
S B I アルヒ	15,600	913.00	14,242,800
プレミアグループ	26,000	1,809.00	47,034,000
日産自動車	2,368,900	430.90	1,020,759,010
いすゞ自動車	413,800	2,872.00	1,188,433,600
トヨタ自動車	8,242,900	3,720.00	30,663,588,000
日野自動車	233,200	440.00	102,608,000
三菱自動車工業	592,700	414.60	245,733,420
武蔵精密工業	34,200	2,750.00	94,050,000
日産車体	23,700	1,101.00	26,093,700
新明和工業	44,700	2,647.00	118,320,900

極東開発工業	25,700	3,435.00	88,279,500
トビー工業	11,200	3,560.00	39,872,000
ティラド	2,800	10,850.00	30,380,000
曙ブレーキ工業	94,900	145.00	13,760,500
タチエス	28,500	2,315.00	65,977,500
NOK	57,600	3,319.00	191,174,400
フタバ産業	41,600	1,148.00	47,756,800
カヤバ	26,300	5,300.00	139,390,000
市光工業	33,800	574.00	19,401,200
大同メタル工業	30,300	1,185.00	35,905,500
プレス工業	63,800	983.00	62,715,400
太平洋工業	36,100	3,015.00	108,841,500
アイシン	396,100	2,727.50	1,080,362,750
マツダ	512,900	1,328.50	681,387,650
本田技研工業	3,367,700	1,548.50	5,214,883,450
スズキ	1,139,100	2,266.00	2,581,200,600
S U B A R U	467,600	2,955.00	1,381,758,000
ヤマハ発動機	767,300	1,218.50	934,955,050
小糸製作所	160,700	2,796.00	449,317,200
エクセディ	25,400	6,150.00	156,210,000
ミツバ	29,300	1,416.00	41,488,800
豊田合成	51,800	4,935.00	255,633,000
愛三工業	25,800	2,249.00	58,024,200
ヨロズ	14,600	1,070.00	15,622,000
エフ・シー・シー	30,200	3,855.00	116,421,000
シマノ	65,200	16,870.00	1,099,924,000
テイ・エス テック	57,500	2,000.50	115,028,750
三十三フィナンシャルグループ	14,800	5,940.00	87,912,000
第四北越フィナンシャルグループ	143,800	1,926.00	276,958,800
ひろぎんホールディングス	212,500	1,862.50	395,781,250
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	5,760.00	74,880,000
ダイレクトマーケティングミックス	16,700	339.00	5,661,300
ポピンズ	2,400	1,460.00	3,504,000
L I T A L I C O	14,600	1,326.00	19,359,600
十六フィナンシャルグループ	21,400	9,580.00	205,012,000
CCIグループ	159,400	978.00	155,893,200
ネットプロテクションズホールディングス	46,200	485.00	22,407,000
プロクレアホールディングス	18,700	2,902.00	54,267,400
FPパートナー	6,600	2,338.00	15,430,800
あいちフィナンシャルグループ	31,300	6,100.00	190,930,000
小野建	17,600	1,473.00	25,924,800
ノジマ	160,700	1,146.00	184,162,200
佐島電機	10,400	1,979.00	20,581,600
カップ・クリエイト	25,900	1,576.00	40,818,400
伯東	9,800	4,385.00	42,973,000
コンドーテック	13,800	1,533.00	21,155,400
ナガイレーベン	17,900	1,796.00	32,148,400
良品計画	358,200	3,596.00	1,288,087,200
松田産業	12,500	8,210.00	102,625,000

第一興商	54,300	1,716.50	93,205,950
メディバルホールディングス	175,300	2,997.50	525,461,750
アドヴァングループ	10,700	1,037.00	11,095,900
S P K	6,500	2,716.00	17,654,000
萩原電気ホールディングス	7,000	3,875.00	27,125,000
アルビス	5,300	2,739.00	14,516,700
アズワン	52,400	2,217.00	116,170,800
スズデン	9,400	1,773.00	16,666,200
シモジマ	12,400	1,472.00	18,252,800
ドウシシャ	19,400	3,665.00	71,101,000
高速	11,000	3,360.00	36,960,000
G - 7ホールディングス	18,000	1,500.00	27,000,000
たけびし	6,200	2,457.00	15,233,400
イオン北海道	48,600	943.00	45,829,800
コジマ	27,000	1,341.00	36,207,000
コーナン商事	18,100	4,295.00	77,739,500
エコス	6,000	3,275.00	19,650,000
ワタミ	19,700	969.00	19,089,300
リックス	4,100	3,830.00	15,703,000
システムソフト	54,100	57.00	3,083,700
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1,658,100	1,036.00	1,717,791,600
丸文	14,700	1,264.00	18,580,800
西松屋チェーン	36,300	2,189.00	79,460,700
ゼンショーホールディングス	83,900	9,960.00	835,644,000
ハビネット	22,300	2,941.00	65,584,300
幸楽苑	15,700	1,218.00	19,122,600
橋本総業ホールディングス	5,700	1,418.00	8,082,600
日本ライフライン	41,400	1,523.00	63,052,200
サイゼリヤ	21,200	7,150.00	151,580,000
タカショー	13,300	400.00	5,320,000
V Tホールディングス	63,900	567.00	36,231,300
アルゴグラフィックス	55,800	1,592.00	88,833,600
魚力	5,700	2,330.00	13,281,000
I D O M	49,500	1,474.00	72,963,000
日本エム・ディ・エム	12,300	583.00	7,170,900
ユナイテッドアローズ	17,500	2,611.00	45,692,500
進和	9,600	3,335.00	32,016,000
ダイトロン	13,400	3,000.00	40,200,000
ハイデイ日高	26,600	3,230.00	85,918,000
シークス	26,300	1,408.00	37,030,400
コロワイド	92,600	1,847.50	171,078,500
オーハシテクニカ	15,200	1,279.00	19,440,800
壱番屋	64,800	919.00	59,551,200
白銅	4,700	2,660.00	12,502,000
スギホールディングス	88,100	3,573.00	314,781,300
薬王堂ホールディングス	9,200	2,075.00	19,090,000
ダブルエー	6,600	1,344.00	8,870,400
島津製作所	206,000	4,316.00	889,096,000
J M S	14,300	446.00	6,377,800

長野計器	10,200	3,095.00	31,569,000
バイ・テクノロジー	7,600	4,545.00	34,542,000
東京計器	12,900	8,470.00	109,263,000
愛知時計電機	7,400	3,220.00	23,828,000
インターアクション	8,000	1,471.00	11,768,000
東京精密	29,400	17,890.00	525,966,000
マニー	62,000	1,661.00	102,982,000
ニコン	193,500	1,972.50	381,678,750
オリンパス	840,100	1,450.50	1,218,565,050
理研計器	22,000	3,675.00	80,850,000
S C R E E Nホールディングス	55,400	23,370.00	1,294,698,000
タムロン	79,200	1,032.00	81,734,400
H O Y A	298,500	28,965.00	8,646,052,500
ノーリツ鋼機	43,600	2,243.00	97,794,800
A & Dホロンホールディングス	21,000	2,785.00	58,485,000
朝日インテック	184,600	3,260.00	601,796,000
キヤノン	696,100	4,659.00	3,243,129,900
リコー	363,300	1,446.00	525,331,800
シチズン時計	128,200	1,812.00	232,298,400
メニコン	57,800	1,876.00	108,432,800
トランザクション	16,700	1,365.00	22,795,500
ニホンフラッシュ	14,600	860.00	12,556,000
前田工織	31,600	2,094.00	66,170,400
アートネイチャー	14,100	815.00	11,491,500
フルヤ金属	14,700	7,640.00	112,308,000
バンダイナムコホールディングス	414,600	4,071.00	1,687,836,600
S H O E I	40,500	1,715.00	69,457,500
フランスベッドホールディングス	22,200	1,359.00	30,169,800
マーベラス	28,800	502.00	14,457,600
パイロットコーポレーション	23,700	4,931.00	116,864,700
萩原工業	10,400	1,825.00	18,980,000
エイベックス	26,600	1,202.00	31,973,200
フジシールインターナショナル	31,400	2,764.00	86,789,600
タカラトミー	76,000	2,738.50	208,126,000
広済堂ホールディングス	50,100	481.00	24,098,100
レック	15,600	1,191.00	18,579,600
三光合成	19,500	1,060.00	20,670,000
プロネクサス	16,100	1,169.00	18,820,900
T O P P A Nホールディングス	187,900	4,919.00	924,280,100
大日本印刷	334,500	3,180.00	1,063,710,000
共同印刷	15,700	1,700.00	26,690,000
N I S S H A	27,800	1,340.00	37,252,000
Z A C R O S	49,200	1,477.00	72,668,400
T A K A R A & C O M P A N Y	8,300	4,145.00	34,403,500
前澤化成工業	10,000	2,409.00	24,090,000
未来工業	7,400	3,450.00	25,530,000
アシックス	596,300	4,670.00	2,784,721,000
ツツミ	3,700	3,265.00	12,080,500
J S P	11,000	2,822.00	31,042,000
ニチハ	18,000	3,695.00	66,510,000

ローランド	12,300	3,990.00	49,077,000
エフピコ	29,400	2,790.00	82,026,000
小松ウオール工業	11,400	2,954.00	33,675,600
ヤマハ	262,500	1,176.50	308,831,250
河合楽器製作所	4,200	2,883.00	12,108,600
クリナップ	17,500	1,057.00	18,497,500
ピジョン	91,600	1,683.00	154,162,800
キングジム	13,900	824.00	11,453,600
象印マホービン	42,000	1,606.00	67,452,000
リンテック	33,700	5,380.00	181,306,000
信越ポリマー	33,600	2,175.00	73,080,000
イトーキ	34,100	3,410.00	116,281,000
任天堂	979,000	8,514.00	8,335,206,000
三菱鉛筆	20,900	2,325.00	48,592,500
松風	14,000	1,835.00	25,690,000
タカラスタンダード	35,100	3,030.00	106,353,000
コクヨ	306,800	891.50	273,512,200
ナカバヤシ	16,800	625.00	10,500,000
ニフコ	58,100	5,258.00	305,489,800
立川ブラインド工業	8,100	2,545.00	20,614,500
グロープライド	14,500	2,340.00	33,930,000
オカムラ	46,700	2,618.00	122,260,600
バルカー	13,000	5,150.00	66,950,000
伊藤忠商事	5,514,000	2,199.00	12,125,286,000
丸紅	1,251,900	6,010.00	7,523,919,000
スクロール	28,100	1,368.00	38,440,800
ヨンドシーホールディングス	15,500	1,892.00	29,326,000
三陽商会	7,300	4,590.00	33,507,000
長瀬産業	70,100	4,841.00	339,354,100
蝶理	8,800	4,540.00	39,952,000
豊田通商	492,700	7,094.00	3,495,213,800
オンワードホールディングス	90,500	839.00	75,929,500
三共生興	21,400	898.00	19,217,200
兼松	137,000	2,375.50	325,443,500
美津濃	41,600	4,100.00	170,560,000
ルックホールディングス	5,000	2,512.00	12,560,000
三井物産	2,358,800	5,700.00	13,445,160,000
日本紙パルプ商事	87,200	1,119.00	97,576,800
東京エレクトロン	328,200	46,230.00	15,172,686,000
カメイ	15,400	3,360.00	51,744,000
スターゼン	37,300	1,350.00	50,355,000
セイコーグループ	21,600	13,260.00	286,416,000
山善	49,600	1,528.00	75,788,800
椿本興業	11,400	3,070.00	34,998,000
住友商事	983,400	6,427.00	6,320,311,800
B I P R O G Y	52,500	4,486.00	235,515,000
内田洋行	30,000	2,048.00	61,440,000
三菱商事	3,270,600	5,161.00	16,879,566,600
第一実業	15,300	3,510.00	53,703,000
キヤノンマーケティングジャパン	38,600	6,843.00	264,139,800

西華産業	23,600	2,828.00	66,740,800
佐藤商事	11,400	2,455.00	27,987,000
東京産業	16,600	988.00	16,400,800
ユアサ商事	14,100	6,380.00	89,958,000
神鋼商事	12,300	2,766.00	34,021,800
阪和興業	26,900	8,800.00	236,720,000
正栄食品工業	10,900	4,100.00	44,690,000
カナデン	13,100	2,310.00	30,261,000
R Y O D E N	12,500	3,640.00	45,500,000
ニプロ	129,200	1,550.00	200,260,000
岩谷産業	163,000	1,956.00	318,828,000
極東貿易	9,200	2,149.00	19,770,800
アステナホールディングス	31,300	502.00	15,712,600
三愛オブリ	38,200	2,433.00	92,940,600
稲畑産業	37,300	4,310.00	160,763,000
G S I クレオス	9,500	2,741.00	26,039,500
明和産業	23,500	919.00	21,596,500
ゴールドウイン	90,800	2,431.00	220,734,800
ユニ・チャーム	971,900	1,095.00	1,064,230,500
ワキタ	27,100	2,114.00	57,289,400
東邦ホールディングス	46,600	4,767.00	222,142,200
サンゲツ	41,200	3,325.00	136,990,000
ミツウロコグループホールディングス	19,800	2,311.00	45,757,800
シナネンホールディングス	3,200	7,090.00	22,688,000
伊藤忠エネクス	40,700	2,014.00	81,969,800
サンリオ	162,900	5,385.00	877,216,500
サンワ テクノス	9,300	3,390.00	31,527,000
新光商事	19,700	1,089.00	21,453,300
トーヨー	18,900	1,319.00	24,929,100
三信電気	9,400	3,135.00	29,469,000
東陽テクニカ	15,200	1,883.00	28,621,600
モスフードサービス	24,200	4,335.00	104,907,000
加賀電子	30,400	4,300.00	130,720,000
都築電気	9,900	4,020.00	39,798,000
ソーダニッカ	16,000	1,195.00	19,120,000
立花エレテック	9,800	3,410.00	33,418,000
木曽路	24,900	2,603.00	64,814,700
S R S ホールディングス	27,000	1,256.00	33,912,000
千趣会	33,300	135.00	4,495,500
リテールパートナーズ	24,400	1,412.00	34,452,800
上新電機	17,800	2,832.00	50,409,600
日本瓦斯	78,600	3,062.00	240,673,200
ロイヤルホールディングス	63,600	1,538.00	97,816,800
チヨダ	16,500	1,119.00	18,463,500
ライフコーポレーション	31,500	2,741.00	86,341,500
リンガーハット	22,700	2,284.00	51,846,800
MrMaxHD	13,900	813.00	11,300,700
A O K I ホールディングス	35,200	1,789.00	62,972,800
オークワ	21,900	889.00	19,469,100
コメリ	21,800	3,670.00	80,006,000

青山商事	35,100	2,594.00	91,049,400
しまむら	115,500	3,581.00	413,605,500
高島屋	237,800	2,107.50	501,163,500
松屋	30,900	2,866.00	88,559,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	79,900	2,470.00	197,353,000
近鉄百貨店	9,400	1,830.00	17,202,000
丸井グループ	95,800	3,116.00	298,512,800
クレディセゾン	86,100	4,656.00	400,881,600
アクシアル リテイリング	44,800	1,296.00	58,060,800
イオン	1,936,700	2,283.50	4,422,454,450
イズミ	29,000	3,130.00	90,770,000
フォーバル	6,400	1,116.00	7,142,400
平和堂	26,800	3,010.00	80,668,000
フジ	25,300	2,168.00	54,850,400
ゼビオホールディングス	19,400	1,107.00	21,475,800
ケーズホールディングス	111,500	1,695.50	189,048,250
PALTA C	25,200	4,973.00	125,319,600
三谷産業	28,600	720.00	20,592,000
SBI新生銀行	194,700	1,810.50	352,504,350
あおぞら銀行	97,200	2,732.00	265,550,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,633,500	2,831.00	27,272,438,500
りそなホールディングス	1,872,900	1,830.00	3,427,407,000
三井住友トラストグループ	531,700	5,347.00	2,842,999,900
三井住友フィナンシャルグループ	3,355,000	5,699.00	19,120,145,000
千葉銀行	467,100	2,191.00	1,023,416,100
群馬銀行	275,500	2,087.00	574,968,500
武蔵野銀行	21,300	6,170.00	131,421,000
千葉興業銀行	28,800	2,307.00	66,441,600
筑波銀行	66,900	652.00	43,618,800
七十七銀行	48,900	9,241.00	451,884,900
秋田銀行	10,300	5,340.00	55,002,000
山形銀行	19,600	2,618.00	51,312,800
岩手銀行	9,700	6,660.00	64,602,000
東邦銀行	175,700	695.00	122,111,500
ふくおかフィナンシャルグループ	121,900	6,472.00	788,936,800
スルガ銀行	102,800	2,048.00	210,534,400
八十二長野銀行	315,000	1,941.00	611,415,000
山梨中央銀行	18,600	5,150.00	95,790,000
大垣共立銀行	31,500	6,220.00	195,930,000
福井銀行	14,700	3,365.00	49,465,500
清水銀行	6,000	2,806.00	16,836,000
滋賀銀行	23,100	8,330.00	192,423,000
南都銀行	23,000	7,160.00	164,680,000
百五銀行	143,600	1,505.00	216,118,000
紀陽銀行	50,700	4,115.00	208,630,500
ほくほくフィナンシャルグループ	92,100	5,856.00	539,337,600
山陰合同銀行	95,500	1,705.00	162,827,500
百十四銀行	15,000	9,320.00	139,800,000
四国銀行	24,000	2,302.00	55,248,000
阿波銀行	22,600	5,700.00	128,820,000

大分銀行	9,600	9,440.00	90,624,000
宮崎銀行	8,900	9,120.00	81,168,000
佐賀銀行	9,600	4,830.00	46,368,000
琉球銀行	32,500	2,387.00	77,577,500
セブン銀行	478,500	290.10	138,812,850
みずほフィナンシャルグループ	2,165,500	6,643.00	14,385,416,500
山口フィナンシャルグループ	149,700	2,621.50	392,438,550
芙蓉総合リース	42,100	4,522.00	190,376,200
みずほリース	114,700	1,505.00	172,623,500
東京センチュリー	114,200	2,228.00	254,437,600
SBIホールディングス	536,200	3,187.00	1,708,869,400
日本証券金融	56,200	2,329.00	130,889,800
アイフル	253,000	502.00	127,006,000
名古屋銀行	28,600	5,270.00	150,722,000
北洋銀行	197,300	1,005.00	198,286,500
愛媛銀行	22,300	1,794.00	40,006,200
京葉銀行	65,900	2,116.00	139,444,400
栃木銀行	82,500	949.00	78,292,500
北日本銀行	4,900	5,050.00	24,745,000
東和銀行	30,200	1,168.00	35,273,600
リコーリース	14,500	6,150.00	89,175,000
イオンフィナンシャルサービス	87,600	1,750.00	153,300,000
アコム	272,700	506.80	138,204,360
ジャックス	18,300	4,305.00	78,781,500
オリエントコーポレーション	59,700	1,126.00	67,222,200
オリックス	944,100	5,482.00	5,175,556,200
三菱HCキャピタル	765,400	1,487.00	1,138,149,800
ジャフコグループ	40,900	2,429.00	99,346,100
トモニホールディングス	145,800	946.00	137,926,800
大和証券グループ本社	1,092,000	1,605.00	1,752,660,000
野村ホールディングス	2,568,100	1,399.50	3,594,055,950
岡三証券グループ	120,600	956.00	115,293,600
丸三証券	50,700	1,087.00	55,110,900
東洋証券	47,100	768.00	36,172,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	181,100	797.00	144,336,700
水戸証券	41,900	643.00	26,941,700
いちよし証券	28,500	1,452.00	41,382,000
松井証券	105,100	928.00	97,532,800
SOMPOホールディングス	758,400	5,991.00	4,543,574,400
日本取引所グループ	837,600	2,050.50	1,717,498,800
マネックスグループ	161,800	706.00	114,230,800
極東証券	20,900	1,825.00	38,142,500
岩井コスモホールディングス	15,900	3,770.00	59,943,000
アイザワ証券グループ	16,000	1,515.00	24,240,000
フィデアホールディングス	15,700	2,088.00	32,781,600
池田泉州ホールディングス	211,800	877.00	185,748,600
アニコムホールディングス	47,700	1,195.00	57,001,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	952,000	4,236.00	4,032,672,000

ソニーフィナンシャルグループ	5,348,000	153.70	821,987,600	
スパークス・グループ	16,900	2,097.00	35,439,300	
第一生命ホールディングス	3,004,200	1,516.50	4,555,869,300	
東京海上ホールディングス	1,570,000	6,373.00	10,005,610,000	
イー・ギャランティ	25,100	1,714.00	43,021,400	
NECキャピタルソリューション	7,500	4,265.00	31,987,500	
T&Dホールディングス	378,500	3,991.00	1,510,593,500	
アドバンスクリエイト	11,900	218.00	2,594,200	
三井不動産	2,258,500	2,095.00	4,731,557,500	
三菱地所	917,500	5,220.00	4,789,350,000	
平和不動産	31,500	2,510.00	79,065,000	
東京建物	144,700	4,266.00	617,290,200	
京阪神ビルディング	22,700	2,096.00	47,579,200	
住友不動産	434,100	5,201.00	2,257,754,100	
テーオーシー	27,200	899.00	24,452,800	
レオパレス21	135,700	740.00	100,418,000	
スターツコーポレーション	28,100	5,270.00	148,087,000	
フジ住宅	19,100	891.00	17,018,100	
空港施設	21,500	1,035.00	22,252,500	
明和地所	12,200	1,154.00	14,078,800	
ゴールドクレスト	8,300	3,350.00	27,805,000	
リログループ	71,000	1,880.00	133,480,000	
エスリード	7,100	7,240.00	51,404,000	
日神グループホールディングス	24,500	817.00	20,016,500	
エスコン	34,200	1,126.00	38,509,200	
MIRARTHホールディングス	97,300	413.00	40,184,900	
ランド	984,500	9.00	8,860,500	
カチタス	41,100	3,550.00	145,905,000	
東祥	13,400	941.00	12,609,400	
トーセイ	45,200	1,634.00	73,856,800	
サンフロンティア不動産	22,600	2,741.00	61,946,600	
FJネクストホールディングス	14,100	1,902.00	26,818,200	
グランディハウス	14,400	653.00	9,403,200	
東武鉄道	160,100	3,116.00	498,871,600	
相鉄ホールディングス	59,700	2,943.00	175,697,100	
東急	398,600	1,938.50	772,686,100	
京浜急行電鉄	175,900	1,550.00	272,645,000	
小田急電鉄	235,000	1,761.50	413,952,500	
京王電鉄	69,400	4,167.00	289,189,800	
京成電鉄	269,900	1,314.50	354,783,550	
富士急行	19,000	2,339.00	44,441,000	
東日本旅客鉄道	855,100	3,819.00	3,265,626,900	
西日本旅客鉄道	369,800	3,352.00	1,239,569,600	
東海旅客鉄道	657,000	4,623.00	3,037,311,000	
東京地下鉄	246,900	1,689.50	417,137,550	
西武ホールディングス	168,800	4,589.00	774,623,200	
鴻池運輸	26,400	3,520.00	92,928,000	
西日本鉄道	44,900	3,207.00	143,994,300	
ハマキョウレックス	48,500	1,932.00	93,702,000	
サカイ引越センター	19,600	2,909.00	57,016,400	

近鉄グループホールディングス	165,800	3,329.00	551,948,200	
阪急阪神ホールディングス	204,200	4,536.00	926,251,200	
南海電気鉄道	73,900	3,071.00	226,946,900	
京阪ホールディングス	80,500	3,419.00	275,229,500	
神戸電鉄	4,200	2,510.00	10,542,000	
名古屋鉄道	171,100	1,833.00	313,626,300	
山陽電気鉄道	11,700	2,041.00	23,879,700	
ヤマトホールディングス	188,100	1,881.00	353,816,100	
山九	35,400	9,884.00	349,893,600	
丸全昭和運輸	9,600	9,290.00	89,184,000	
センコーグループホールディングス	112,000	1,914.00	214,368,000	
ニッコンホールディングス	66,000	3,920.00	258,720,000	
福山通運	16,500	5,610.00	92,565,000	
セイノーホールディングス	76,100	2,638.00	200,751,800	
神奈川中央交通	4,400	3,670.00	16,148,000	
A Z - C O M丸和ホールディングス	48,000	953.00	45,744,000	
日本郵船	327,200	5,248.00	1,717,145,600	
商船三井	294,500	5,495.00	1,618,277,500	
川崎汽船	333,500	2,433.50	811,572,250	
N S ユナイテッド海運	9,700	7,620.00	73,914,000	
飯野海運	56,900	1,632.00	92,860,800	
九州旅客鉄道	116,600	3,924.00	457,538,400	
S Gホールディングス	259,900	1,525.00	396,347,500	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	155,000	3,850.00	596,750,000	
日本航空	354,800	3,177.00	1,127,199,600	
A N Aホールディングス	421,300	3,350.00	1,411,355,000	
ビーウィズ	4,100	1,767.00	7,244,700	
サンウェルズ	12,200	259.00	3,159,800	
T R Eホールディングス	36,600	1,792.00	65,587,200	
人・夢・技術グループ	6,400	1,652.00	10,572,800	
シルバーライフ	4,500	820.00	3,690,000	
Genky DrugStores	14,400	4,520.00	65,088,000	
コア商事ホールディングス	14,800	874.00	12,935,200	
K P Pグループホールディングス	42,900	927.00	39,768,300	
ブックオフグループホールディングス	11,900	1,968.00	23,419,200	
ギフトホールディングス	9,300	4,180.00	38,874,000	
三菱倉庫	175,700	1,396.50	245,365,050	
三井倉庫ホールディングス	47,800	3,571.00	170,693,800	
住友倉庫	45,100	3,945.00	177,919,500	
澁澤倉庫	24,800	1,402.00	34,769,600	
ヤマタネ	13,200	2,304.00	30,412,800	
乾汽船	19,600	1,657.00	32,477,200	
日本トランスシティ	39,000	1,336.00	52,104,000	
中央倉庫	8,400	1,699.00	14,271,600	
安田倉庫	10,600	2,589.00	27,443,400	
N I S S Oホールディングス	13,800	677.00	9,342,600	
大栄環境	34,700	3,720.00	129,084,000	
G E N O V A	9,400	608.00	5,715,200	
日本管財ホールディングス	16,700	2,876.00	48,029,200	

上組	68,000	5,726.00	389,368,000	
キューソー流通システム	8,800	3,195.00	28,116,000	
エーアイティ	9,800	2,310.00	22,638,000	
TBSホールディングス	76,900	5,670.00	436,023,000	
日本テレビホールディングス	137,700	3,218.00	443,118,600	
朝日放送グループホールディングス	19,400	831.00	16,121,400	
テレビ朝日ホールディングス	37,700	3,250.00	122,525,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	103,500	2,798.00	289,593,000	
テレビ東京ホールディングス	9,600	4,305.00	41,328,000	
ビジョン	32,500	1,301.00	42,282,500	
U-NEXT HOLDINGS	52,300	1,840.00	96,232,000	
日本通信	125,300	134.00	16,790,200	
NTT	42,699,800	150.90	6,443,399,820	
KDDI	2,185,600	2,655.50	5,803,860,800	
ソフトバンク	25,002,200	210.40	5,260,462,880	
光通信	15,300	41,320.00	632,196,000	
エムティーアイ	10,600	672.00	7,123,200	
GMOインターネットグループ	50,200	2,839.50	142,542,900	
ファイバーゲート	5,900	690.00	4,071,000	
KADOKAWA	86,400	2,786.50	240,753,600	
学研ホールディングス	28,400	1,058.00	30,047,200	
ゼンリン	23,300	1,015.00	23,649,500	
東京電力ホールディングス	1,397,700	689.00	963,015,300	
中部電力	571,400	2,568.00	1,467,355,200	
関西電力	840,500	2,744.00	2,306,332,000	
中国電力	269,300	1,038.50	279,668,050	
北陸電力	158,500	1,069.00	169,436,500	
東北電力	408,200	1,244.50	508,004,900	
四国電力	144,400	1,722.50	248,729,000	
九州電力	357,400	1,907.00	681,561,800	
北海道電力	174,700	1,192.50	208,329,750	
沖縄電力	39,600	1,163.00	46,054,800	
電源開発	116,800	3,632.00	424,217,600	
エフオン	11,400	348.00	3,967,200	
イーレックス	31,800	680.00	21,624,000	
レノバ	42,300	688.00	29,102,400	
東京瓦斯	279,700	7,598.00	2,125,160,600	
大阪瓦斯	276,900	6,460.00	1,788,774,000	
東邦瓦斯	57,100	5,543.00	316,505,300	
北海道瓦斯	46,300	905.00	41,901,500	
広島ガス	33,100	382.00	12,644,200	
西部ガスホールディングス	17,900	2,550.00	45,645,000	
静岡ガス	35,400	1,494.00	52,887,600	
メタウォーター	20,500	4,130.00	84,665,000	
クオッツ総研ホールディングス	18,900	750.00	14,175,000	
松竹	8,900	11,630.00	103,507,000	
東宝	81,600	7,763.00	633,460,800	
エイチ・アイ・エス	46,300	1,259.00	58,291,700	
東映	25,800	5,300.00	136,740,000	
ラックランド	7,200	1,766.00	12,715,200	

共立メンテナンス	60,300	2,626.50	158,377,950	
イチネンホールディングス	15,200	2,195.00	33,364,000	
建設技術研究所	16,400	3,415.00	56,006,000	
スペース	11,500	1,638.00	18,837,000	
アインホールディングス	18,500	6,090.00	112,665,000	
燦ホールディングス	13,400	1,500.00	20,100,000	
ピー・シー・エー	10,300	1,940.00	19,982,000	
スバル興業	5,300	3,600.00	19,080,000	
タナベコンサルティンググループ	13,300	752.00	10,001,600	
ビジネスブレイン太田昭和	5,500	2,997.00	16,483,500	
ナガワ	4,300	6,120.00	26,316,000	
東京都競馬	11,600	5,970.00	69,252,000	
カナモト	22,500	4,235.00	95,287,500	
D T S	123,700	1,102.00	136,317,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	255,800	2,488.00	636,430,400	
シーイーシー	18,900	1,921.00	36,306,900	
カブコン	309,100	3,252.00	1,005,193,200	
ニシオホールディングス	13,200	4,555.00	60,126,000	
アイ・エス・ピー	7,300	1,934.00	14,118,200	
日本空港ビルデング	54,000	5,307.00	286,578,000	
トランス・コスモス	20,300	3,990.00	80,997,000	
乃村工藝社	69,500	1,441.00	100,149,500	
藤田観光	31,600	2,319.00	73,280,400	
K N T - C Tホールディングス	7,900	1,654.00	13,066,600	
トーカイ	11,500	2,572.00	29,578,000	
セコム	297,700	5,980.00	1,780,246,000	
N S W	6,700	2,426.00	16,254,200	
セントラル警備保障	7,700	3,045.00	23,446,500	
アイネス	12,100	2,021.00	24,454,100	
丹青社	33,700	1,558.00	52,504,600	
メイテックグループホールディングス	58,700	3,370.00	197,819,000	
T K C	24,000	3,920.00	94,080,000	
応用地質	14,100	3,035.00	42,793,500	
船井総研ホールディングス	63,800	1,121.00	71,519,800	
N S D	54,900	2,771.00	152,127,900	
コナミグループ	66,600	19,235.00	1,281,051,000	
学究社	6,300	2,440.00	15,372,000	
ナック	16,300	543.00	8,850,900	
福井コンピュータホールディングス	8,400	3,350.00	28,140,000	
ダイセキ	30,600	3,800.00	116,280,000	
ステップ	5,800	2,551.00	14,795,800	
泉州電業	10,500	6,460.00	67,830,000	
GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	9,300	2,921.00	27,165,300	
トラスコ中山	34,400	2,440.00	83,936,000	
ヤマダホールディングス	504,600	576.00	290,649,600	
オートバックスセブン	57,100	1,754.00	100,153,400	
モリト	11,600	2,051.00	23,791,600	
アークランズ	48,800	2,035.00	99,308,000	

ニトリホールディングス	265,400	3,118.00	827,517,200	
グルメ杵屋	13,400	1,009.00	13,520,600	
ケーユーホールディングス	11,500	1,331.00	15,306,500	
吉野家ホールディングス	60,400	3,146.00	190,018,400	
加藤産業	20,300	6,820.00	138,446,000	
イノテック	10,400	2,807.00	29,192,800	
イエローハット	41,400	1,736.00	71,870,400	
松屋フーズホールディングス	7,700	6,000.00	46,200,000	
J B C Cホールディングス	41,300	1,276.00	52,698,800	
J Kホールディングス	11,000	1,533.00	16,863,000	
サガミホールディングス	26,400	1,917.00	50,608,800	
日伝	9,200	2,530.00	23,276,000	
ミロク情報サービス	13,200	1,749.00	23,086,800	
杉本商事	13,200	1,424.00	18,796,800	
因幡電機産業	85,700	2,852.00	244,416,400	
王将フードサービス	33,900	3,245.00	110,005,500	
ミニストップ	11,900	2,020.00	24,038,000	
アークス	27,500	4,005.00	110,137,500	
バローホールディングス	31,300	3,750.00	117,375,000	
東テク	18,300	4,375.00	80,062,500	
ミスミグループ本社	231,500	3,165.00	732,697,500	
ベルク	7,200	7,950.00	57,240,000	
大 庄	11,200	1,191.00	13,339,200	
ファーストリテイリング	110,600	67,690.00	7,486,514,000	
ソフトバンクグループ	2,980,800	4,037.00	12,033,489,600	
スズケン	54,400	6,555.00	356,592,000	
サンドラッグ	48,400	4,212.00	203,860,800	
サックスパー ホールディングス	14,000	840.00	11,760,000	
ジェコス	11,800	1,869.00	22,054,200	
ペルーナ	39,500	967.00	38,196,500	
合計	318,484,100		843,049,975,010	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2026年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	21,735,594,829
コール・ローン	314,523,759
株式	2,390,802,923,436
投資信託受益証券	2,847,876,419
投資証券	36,967,270,896
派生商品評価勘定	350,291,748
未収入金	73,213,488
未収配当金	2,058,050,568
差入委託証拠金	16,714,137,271
流動資産合計	2,471,863,882,414
資産合計	
2,471,863,882,414	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	193,740,749
未払解約金	146,965,000
流動負債合計	340,705,749
負債合計	
340,705,749	
純資産の部	
元本等	
元本	199,418,104,004
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,272,105,072,661
元本等合計	2,471,523,176,665
純資産合計	2,471,523,176,665
負債純資産合計	2,471,863,882,414

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2月26日 至 2026年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年2月25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	182,875,484,297円
同期中追加設定元本額	41,124,544,087円
同期中一部解約元本額	24,581,924,380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	31,076,324円
インデックスオープン・先進国株式	42,838,561円
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,869,463,345円
たわらノーロード 先進国株式	90,389,859,491円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,884,504,578円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,219,095,317円
たわらノーロード バランス(堅実型)	66,846,914円
たわらノーロード バランス(標準型)	823,134,093円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,401,956,039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)	55,993,700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)	353,544,202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)	453,189,796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)	721,592,036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)	640,871円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,174,778円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	10,851,130円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	23,406,541円
たわらノーロード 全世界株式	16,430,763,066円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	12,351,088円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	52,531,250円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	22,390,357円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,623,027,261円
One DC 先進国株式インデックスファンド	4,303,911,679円
Oneグローバルバランス	63,832,068円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	113,392,077円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	635,216,919円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	945,877,265円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	52,796,005円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	175,699,647円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	201,242,979円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	13,031,831円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	553,950,253円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	102,106,508円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	111,917,247円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	159,863,950円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	291,088,039円
投資のソムリエ	2,775,114,449円
クルーズコントロール	28,003,980円
投資のソムリエ<DC年金>	554,355,575円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	161,954,326円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	370,951,436円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	263,713,857円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	467,241,821円
ワールドアセットバランス(基本コース)	46,933,487円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	122,442,941円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	89,796,723円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	48,206,357円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,237,159円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	171,210,395円

4資産分散投資・スタンダード<DC年金> リスクコントロール世界資産分散ファンド	170,742,645円 160,097,238円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	94,623,441円 78,418,464円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	53,680,626円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	31,594,820円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	226,181,712円 12,227,652円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け> 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	23,116,531円 422,693円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	6,187,835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)	6,192,796円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	3,246,940円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	16,050,087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)	19,201,606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)	7,006,109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)	13,678,330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)	16,936,171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)	223,045,395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)	12,085,981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)	880,323,665円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	867,696,614円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	35,725,305円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	2,899,136円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	10,996,789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)	1,888,546円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,044,468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)	24,417,634円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	857,144円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,419,973円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	549,874円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,919円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	42,860,351円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	114,674,191円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	430,264,378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)	15,084,465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)	14,073,479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)	63,763,334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)	2,324,812円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	95,498円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	22,679,099円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	2,637,913円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	6,910,142円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	10,611,086円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	19,334,629円
動的パッケージファンド< D C年金>	10,908,435円
コア資産形成ファンド	3,873,989円
たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジなし)<ラップ専用>	2,929,588,082円
One 外国株式インデックスファンド	123,046,387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>	666,438,281円
M H A M動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,061,315,669円
M H A M外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,528,718,152円
計	199,418,104,004円
2. 受益権の総数	199,418,104,004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2月26日 至 2026年2月25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2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年2月25日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	24,863,243,222	
投資信託受益証券	120,122,642	
投資証券	121,961,401	
合計	24,865,081,981	

（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2月25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2月25日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	1,559,405,669	-	1,559,428,191	22,522	
イギリス・ポンド	1,200,383,352	-	1,200,412,627	29,275	
カナダ・ドル	67,742,199	-	67,743,165	966	
ユーロ	76,996,970	-	76,998,595	1,625	
合計	214,283,148	-	214,273,804	9,344	
合計	1,559,405,669	-	1,559,428,191	22,522	

（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。

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。

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

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

- ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表さ

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2026年2月25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	42,032,651,650	-	42,189,180,127	156,528,477
合計	42,032,651,650	-	42,189,180,127	156,528,477

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2026年2月25日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	12.3937円 (123,937円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2026年2月25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	1,874,064	208.560	390,854,787.840	
	ABBOTT LABORATORIES	340,306	114.580	38,992,261.480	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	182,050	229.320	41,747,706.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	317,135	213.840	67,816,148.400	
	ADOBE INC	81,005	255.170	20,670,045.850	
	CHUBB LTD	74,111	336.850	24,964,290.350	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	43,670	279.470	12,204,454.900	
	ALLSTATE CORP	50,798	209.820	10,658,436.360	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	122,879	243.610	29,934,553.190	
	AMGEN INC	105,333	382.870	40,328,845.710	
	AMERICAN EXPRESS CO	109,238	320.480	35,008,594.240	

AMERICAN ELECTRIC POWER	104,525	132.390	13,838,064.750	
AFLAC INC	97,081	112.460	10,917,729.260	
AMERICAN INTL GROUP	107,917	79.840	8,616,093.280	
ANALOG DEVICES	96,254	356.090	34,275,086.860	
COMFORT SYSTEMS USA INC	6,758	1,468.580	9,924,663.640	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	128,446	144.710	18,587,420.660	
VALERO ENERGY CORP	59,921	199.330	11,944,052.930	
APPLE INC	2,897,276	272.140	788,464,690.640	
APPLIED MATERIALS INC	155,424	377.930	58,739,392.320	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	94,789	68.020	6,447,547.780	
AMEREN CORP	53,291	111.270	5,929,689.570	
AUTODESK INC	40,846	220.910	9,023,289.860	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	79,375	205.680	16,325,850.000	
AUTOZONE INC	3,300	3,784.420	12,488,586.000	
AVERY DENNISON CORP	15,877	197.450	3,134,913.650	
BALL CORP	51,188	66.520	3,405,025.760	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	269,092	494.510	133,068,684.920	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	136,211	116.550	15,875,392.050	
BAXTER INTERNATIONAL INC	92,098	20.630	1,899,981.740	
BECTON DICKINSON & CO	54,999	182.490	10,036,767.510	
AMETEK INC	45,217	236.840	10,709,194.280	
VERIZON COMM INC	825,307	49.860	41,149,807.020	
WR BERKLEY CORP	56,763	71.630	4,065,933.690	
BEST BUY CO INC	40,496	62.730	2,540,314.080	
YUM! BRANDS INC	53,425	165.950	8,865,878.750	
FIRSTENERGY CORP	106,507	50.640	5,393,514.480	
BOEING CO	152,193	233.390	35,520,324.270	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	290,423	75.150	21,825,288.450	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	23,522	177.350	4,171,626.700	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	36,292	204.190	7,410,463.480	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	4,001	1,379.660	5,520,019.660	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	394,465	61.600	24,299,044.000	
ONEOK INC	124,128	82.890	10,288,969.920	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,940	130.850	1,693,199.000	
UNITED RENTALS INC	12,674	896.880	11,367,057.120	
SEMPRA	127,538	93.970	11,984,745.860	
FEDEX CORP	43,144	386.560	16,677,744.640	
VERISIGN INC	16,703	213.450	3,565,255.350	
AMPHENOL CORP	239,426	151.500	36,273,039.000	
BROWN-FORMAN CORP	35,882	30.420	1,091,530.440	

QUANTA SERVICES INC	29,238	568.210	16,613,323.980	
CSX CORP	366,226	42.470	15,553,618.220	
COTERRA ENERGY INC	150,818	30.500	4,599,949.000	
CONSTELLATION BRANDS INC	30,084	160.070	4,815,545.880	
CARDINAL HEALTH INC	45,384	225.970	10,255,422.480	
CARLISLE COS INC	8,371	407.860	3,414,196.060	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	208,752	31.610	6,598,650.720	
CATERPILLAR INC	91,579	768.230	70,353,735.170	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	16,461	152.440	2,509,314.840	
JPMORGAN CHASE & CO	537,023	297.300	159,656,937.900	
CHURCH & DWIGHT CO INC	47,891	105.080	5,032,386.280	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	29,114	160.730	4,679,493.220	
CINTAS CORP	70,809	198.550	14,059,126.950	
CISCO SYSTEMS INC	773,127	78.140	60,412,143.780	
CLOROX COMPANY	25,012	126.650	3,167,769.800	
COCA-COLA CO/THE	797,826	80.720	64,400,514.720	
COPART INC	183,663	35.280	6,479,630.640	
COLGATE-PALMOLIVE CO	150,505	98.110	14,766,045.550	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	45,093	343.150	15,473,662.950	
CIENA CORP	28,060	342.700	9,616,162.000	
NRG ENERGY, INC.	37,793	184.030	6,955,045.790	
COMCAST CORP-CL A	723,544	31.610	22,871,225.840	
CONSOLIDATED EDISON INC	71,768	111.010	7,966,965.680	
CMS ENERGY CORP	61,821	76.780	4,746,616.380	
COOPER COS INC	41,316	83.560	3,452,364.960	
CORNING INC	158,638	151.590	24,047,934.420	
HEICO CORP-CL A	14,337	259.390	3,718,874.430	
CUMMINS INC	26,903	600.480	16,154,713.440	
DR HORTON INC	51,443	163.950	8,434,079.850	
DANAHER CORP	126,081	209.190	26,374,884.390	
MOODY'S CORP	31,382	452.570	14,202,551.740	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	96,679	61.060	5,903,219.740	
TARGET CORP	87,217	115.520	10,075,307.840	
DEERE & CO	49,726	644.540	32,050,396.040	
MORGAN STANLEY	234,224	168.790	39,534,668.960	
REPUBLIC SERVICES INC	42,963	220.740	9,483,652.620	
COSTAR GROUP INC	84,266	49.150	4,141,673.900	
DECKERS OUTDOOR CORP	29,843	120.940	3,609,212.420	
THE WALT DISNEY CO	351,492	106.050	37,275,726.600	
DOLLAR TREE INC	38,951	131.710	5,130,236.210	
DOVER CORP	26,860	231.350	6,214,061.000	
OMNICOM GROUP	64,516	82.460	5,319,989.360	
DTE ENERGY CO	39,623	146.090	5,788,524.070	
DUKE ENERGY CORP	150,490	128.460	19,331,945.400	

DARDEN RESTAURANTS INC	23,659	213.920	5,061,133.280	
EBAY INC	88,123	85.300	7,516,891.900	
BANK OF AMERICA CORP	1,375,317	50.410	69,329,729.970	
CITIGROUP INC	360,544	109.560	39,501,200.640	
EATON CORP PLC	75,552	374.560	28,298,757.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	52,838	290.630	15,356,307.940	
ECOLAB INC	49,813	308.160	15,350,374.080	
ELECTRONIC ARTS INC	46,324	201.000	9,311,124.000	
SALESFORCE INC	186,826	185.420	34,641,276.920	
ERIE INDEMNITY CO	4,706	257.010	1,209,489.060	
EMERSON ELECTRIC CO	109,633	150.880	16,541,427.040	
ATMOS ENERGY CORP	30,635	182.020	5,576,182.700	
ENTERGY CORP	87,669	105.200	9,222,778.800	
EOG RESOURCES INC	104,298	123.700	12,901,662.600	
EQUIFAX INC	23,385	194.320	4,544,173.200	
EQT CORP	122,739	58.410	7,169,184.990	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	46,036	115.290	5,307,490.440	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	25,296	138.830	3,511,843.680	
EXXON MOBIL CORP	831,775	149.260	124,150,736.500	
NEXTERA ENERGY INC	402,681	95.680	38,528,518.080	
FAIR ISAAC CORP	4,652	1,227.630	5,710,934.760	
FASTENAL CO	225,020	45.460	10,229,409.200	
FIFTH THIRD BANCORP	173,517	50.200	8,710,553.400	
M&T BANK CORP	29,858	218.520	6,524,570.160	
FISERV INC	105,634	59.130	6,246,138.420	
FORD MOTOR CO	747,269	14.200	10,611,219.800	
FREEPORT-MCMORAN INC	278,704	67.880	18,918,427.520	
FLEX LTD	70,393	64.920	4,569,913.560	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,770	1,981.020	3,506,405.400	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	50,606	215.980	10,929,883.880	
GENERAL DYNAMICS CORP	44,701	351.180	15,698,097.180	
GENERAL MILLS INC	108,036	45.420	4,906,995.120	
GENUINE PARTS CO	27,885	118.820	3,313,295.700	
GILEAD SCIENCES INC	242,939	147.640	35,867,513.960	
GARTNER INC	14,507	147.340	2,137,461.380	
MCKESSON CORP	24,310	957.360	23,273,421.600	
NVIDIA CORP	4,744,200	192.850	914,918,970.000	
GRACO INC	35,832	93.480	3,349,575.360	
GE AEROSPACE	207,105	345.640	71,583,772.200	
WW GRAINGER INC	8,993	1,126.680	10,132,233.240	
HALLIBURTON CO	174,094	35.790	6,230,824.260	
MONSTER BEVERAGE CORP	143,582	85.540	12,282,004.280	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	59,241	902.270	53,451,377.070	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	36,009	354.270	12,756,908.430	
HEICO CORP	9,043	350.640	3,170,837.520	
HERSHEY FOODS CORP	28,542	230.210	6,570,653.820	
HP INC	182,679	18.200	3,324,757.800	

F5 INC	10,684	272.030	2,906,368.520	
UNITED THERAPEUTICS CORP	8,650	473.430	4,095,169.500	
HOLOGIC INC	42,879	75.350	3,230,932.650	
HOME DEPOT INC	194,589	384.480	74,815,578.720	
HORMEL FOODS CORP	62,145	25.800	1,603,341.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	125,682	42.800	5,379,189.600	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,572	558.320	3,669,279.040	
HUBBELL INC	10,317	526.750	5,434,479.750	
HUMANA INC	23,738	174.640	4,145,604.320	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	15,087	222.900	3,362,892.300	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	390,176	17.020	6,640,795.520	
BIOGEN INC	28,721	195.130	5,604,328.730	
IDEX CORP	14,254	208.450	2,971,246.300	
ILLINOIS TOOL WORKS	53,947	294.560	15,890,628.320	
INTUIT INC	54,692	358.710	19,618,567.320	
IDEXX LABORATORIES INC	15,757	649.230	10,229,917.110	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	43,285	463.730	20,072,553.050	
INTEL CORP	883,713	46.120	40,756,843.560	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	52,909	82.110	4,344,357.990	
INTERNATIONAL PAPER CO	96,821	44.020	4,262,060.420	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	13,747	156.180	2,147,006.460	
JABIL CIRCUIT INC	21,288	266.260	5,668,142.880	
INCYTE CORP	32,676	101.050	3,301,909.800	
EMCOR GROUP INC	8,954	806.800	7,224,087.200	
JOHNSON & JOHNSON	470,081	246.280	115,771,548.680	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	54,053	140.540	7,596,608.620	
KLA CORPORATION	25,774	1,506.650	38,832,397.100	
DEVON ENERGY CORP	120,383	43.280	5,210,176.240	
KEYCORP	192,791	21.000	4,048,611.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	66,322	111.110	7,369,037.420	
KROGER CO	121,914	69.760	8,504,720.640	
LAM RESEARCH CORP	246,275	244.250	60,152,668.750	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,512	683.220	6,498,788.640	
PACKAGING CORP OF AMERICA	17,694	228.890	4,049,979.660	
LENNAR CORP	42,935	116.400	4,997,634.000	
ELI LILLY & CO	157,119	1,042.150	163,741,565.850	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	144,089	115.370	16,623,547.930	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	54,181	124.400	6,740,116.400	
LOCKHEED MARTIN CORP	41,100	664.430	27,308,073.000	
LOEWS CORP	35,267	109.340	3,856,093.780	
LOWE'S COS INC	108,802	278.590	30,311,149.180	

DOMINION ENERGY INC	168,073	63.740	10,712,973.020	
MCCORMICK & CO INC	50,907	70.000	3,563,490.000	
MCDONALD'S CORPORATION	139,375	333.050	46,418,843.750	
S&P GLOBAL INC	61,010	418.270	25,518,652.700	
EVEREST GROUP LTD	8,099	339.650	2,750,825.350	
MARKEL GROUP INC	2,392	2,066.970	4,944,192.240	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	114,174	82.400	9,407,937.600	
MARSH & MCLENNAN COS	96,062	178.430	17,140,342.660	
MASCO CORP	38,833	73.880	2,868,982.040	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	11,459	696.850	7,985,204.150	
METLIFE INC	112,337	75.340	8,463,469.580	
MEDTRONIC PLC	247,955	96.750	23,989,646.250	
CVS HEALTH CORP	246,125	74.180	18,257,552.500	
MERCK & CO. INC.	488,187	123.930	60,501,014.910	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	81,106	70.030	5,679,853.180	
MICROSOFT CORP	1,378,753	389.000	536,334,917.000	
MICRON TECH INC	219,335	418.010	91,684,223.350	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	104,072	75.930	7,902,186.960	
3M CO	104,209	166.460	17,346,630.140	
ENTEGRIS INC	30,003	136.270	4,088,508.810	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	32,437	470.850	15,272,961.450	
ILLUMINA INC	30,724	122.900	3,775,979.600	
INSMED INC	40,347	158.620	6,399,841.140	
XCEL ENERGY INC	116,425	83.910	9,769,221.750	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19,683	130.960	2,577,685.680	
NETAPP INC	40,052	99.870	3,999,993.240	
NEWMONT CORP	214,166	124.090	26,575,858.940	
NVR INC	548	7,504.790	4,112,624.920	
NIKE INC-CL B	231,559	64.090	14,840,616.310	
NORDSON CORP	10,461	294.820	3,084,112.020	
NORFOLK SOUTHERN CORP	43,906	316.090	13,878,247.540	
EVERSOURCE ENERGY	71,792	75.130	5,393,732.960	
NISOURCE INC	93,648	46.420	4,347,140.160	
TAPESTRY INC	39,685	154.510	6,131,729.350	
NORTHERN TRUST CORP	36,316	141.410	5,135,445.560	
NORTHROP GRUMMAN CORP	26,596	727.730	19,354,707.080	
WELLS FARGO & CO	626,185	84.570	52,956,465.450	
NUCOR CORP	43,684	175.150	7,651,252.600	
CHENIERE ENERGY INC	43,236	220.960	9,553,426.560	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	124,322	196.560	24,436,732.320	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	149,419	51.950	7,762,317.050	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	36,730	196.700	7,224,791.000	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	166,836	94.330	15,737,639.880	
ORACLE CORP	334,650	146.140	48,905,751.000	
PACCAR INC	101,306	126.250	12,789,882.500	
PTC INC	22,688	153.570	3,484,196.160	
EXELON CORP	199,466	48.590	9,692,052.940	
PARKER HANNIFIN CORP	24,698	1,023.020	25,266,547.960	
PAYCHEX INC	61,583	88.480	5,448,863.840	
PPL CORPORATION	143,074	38.120	5,453,980.880	
PEPSICO INC	267,208	169.540	45,302,444.320	
PENTAIR PLC	30,201	102.930	3,108,588.930	
PFIZER INC	1,110,361	27.140	30,135,197.540	
ESSENTIAL UTILITIES INC	50,450	39.760	2,005,892.000	
CONOCOPHILLIPS	242,587	110.590	26,827,696.330	
PG&E CORP	420,952	18.660	7,854,964.320	
ALTRIA GROUP INC	325,661	69.250	22,552,024.250	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	76,487	217.910	16,667,282.170	
BROWN & BROWN INC	55,759	69.840	3,894,208.560	
GARMIN LTD	31,012	251.490	7,799,207.880	
PPG INDUSTRIES INC	44,165	125.550	5,544,915.750	
COSTCO WHOLESALE CORP	86,579	998.430	86,443,070.970	
T ROWE PRICE GROUP INC	42,210	94.800	4,001,508.000	
QUEST DIAGNOSTICS	22,778	209.540	4,772,902.120	
PROCTER & GAMBLE CO	457,198	165.280	75,565,685.440	
PROGRESSIVE CORP	114,132	206.080	23,520,322.560	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	98,059	86.240	8,456,608.160	
PULTE GROUP INC	38,191	140.900	5,381,111.900	
GLOBAL PAYMENTS INC	50,003	78.340	3,917,235.020	
QUALCOMM INC	209,770	144.780	30,370,500.600	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	37,191	155.480	5,782,456.680	
RELIANCE INC	10,580	317.110	3,355,023.800	
REGENERON PHARMACEUTICALS	20,124	772.190	15,539,551.560	
RESMED INC	27,634	251.630	6,953,543.420	
US BANCORP	304,979	55.030	16,782,994.370	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	73,570	99.180	7,296,672.600	
ROSS STORES INC	62,444	200.550	12,523,144.200	
ROLLINS INC	59,922	60.510	3,625,880.220	
ROPER TECHNOLOGIES INC	20,624	337.700	6,964,724.800	
ROCKWELL AUTOMATION INC	22,141	405.300	8,973,747.300	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	50,813	316.500	16,082,314.500	
RPM INTERNATIONAL INC	26,441	116.350	3,076,410.350	
ACCENTURE PLC-CL A	121,518	196.730	23,906,236.140	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	254,146	61.130	15,535,944.980	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18,910	291.270	5,507,915.700	

AXON ENTERPRISE INC	14,113	442.510	6,245,143.630	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	43,955	305.430	13,425,175.650	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	98,588	48.110	4,743,068.680	
BOOKING HOLDINGS INC	6,355	4,068.560	25,855,698.800	
SLB LTD	290,153	51.850	15,044,433.050	
SCHWAB (CHARLES) CORP	337,201	93.120	31,400,157.120	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	40,666	99.870	4,061,313.420	
ELEVANCE HEALTH INC	44,145	327.140	14,441,595.300	
CENCORA INC	36,044	364.380	13,133,712.720	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	43,108	94.850	4,088,793.800	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	46,383	364.730	16,917,271.590	
CENTENE CORP	104,991	42.370	4,448,468.670	
SNAP-ON INC	9,520	387.040	3,684,620.800	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	66,964	100.390	6,722,515.960	
EDISON INTERNATIONAL	76,731	75.240	5,773,240.440	
SOUTHERN CO	213,006	95.810	20,408,104.860	
TRUIST FINANCIAL CORP	252,862	49.660	12,557,126.920	
AT&T INC	1,399,365	28.350	39,671,997.750	
CHEVRON CORP	376,023	185.340	69,692,102.820	
STATE STREET CORP	54,885	127.230	6,983,018.550	
STARBUCKS CORP	220,990	96.510	21,327,744.900	
STEEL DYNAMICS INC	27,961	190.870	5,336,916.070	
STRYKER CORP	67,358	381.330	25,685,626.140	
NETFLIX INC	830,634	78.040	64,822,677.360	
GEN DIGITAL INC	108,241	21.970	2,378,054.770	
SYNOPSIS INC	36,472	440.720	16,073,939.840	
SYSCO CORP	92,768	89.870	8,337,060.160	
INTUITIVE SURGICAL INC	70,154	494.020	34,657,479.080	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	221,464	33.920	7,512,058.880	
TERADYNE INC	31,202	329.090	10,268,266.180	
TEXAS INSTRUMENTS INC	177,710	213.350	37,914,428.500	
TEXTRON INC	33,319	98.990	3,298,247.810	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	73,838	515.600	38,070,872.800	
TRACTOR SUPPLY CO	106,564	53.270	5,676,664.280	
TRIMBLE INC	48,211	66.740	3,217,602.140	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,175	323.780	2,646,901.500	
TYSON FOODS INC	56,217	63.420	3,565,282.140	
UNION PACIFIC CORP	116,082	266.660	30,954,426.120	
RTX CORP	261,305	198.460	51,858,590.300	
UNITEDHEALTH GROUP INC	177,073	273.950	48,509,148.350	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	229.980	2,277,491.940	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	50,278	487.430	24,507,005.540	
VULCAN MATERIALS CO	26,210	317.890	8,331,896.900	
WALMART INC	856,295	126.750	108,535,391.250	
WASTE MANAGEMENT INC	78,385	229.580	17,995,628.300	
WATERS CORP	18,479	326.300	6,029,697.700	
WATSCO INC	7,083	412.130	2,919,116.790	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	14,539	245.380	3,567,579.820	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	19,624	109.350	2,145,884.400	
WESTERN DIGITAL CORP	68,036	270.570	18,408,500.520	
WABTEC CORP	32,335	264.470	8,551,637.450	
NASDAQ INC	88,792	81.110	7,201,919.120	
CME GROUP INC	70,558	319.030	22,510,118.740	
WILLIAMS COS INC	239,317	73.500	17,589,799.500	
WILLIAMS-SONOMA INC	23,215	208.970	4,851,238.550	
DICK'S SPORTING GOODS INC	13,092	212.490	2,781,919.080	
ALLIANT ENERGY CORP	51,637	71.630	3,698,758.310	
WEC ENERGY GROUP INC	63,542	115.900	7,364,517.800	
STRATEGY INC-CL A	51,441	124.610	6,410,063.010	
TJX COMPANIES INC	215,277	157.660	33,940,571.820	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	10,685	235.830	2,519,843.550	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	241,849	8.720	2,108,923.280	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	32,128	78.830	2,532,650.240	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	25,421	332.850	8,461,379.850	
CBRE GROUP INC	58,510	146.170	8,552,406.700	
REGIONS FINANCIAL CORP	175,370	28.440	4,987,522.800	
DOMINO'S PIZZA INC	5,925	414.200	2,454,135.000	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	9,157	1,213.670	11,113,576.190	
CRH PLC	132,296	122.660	16,227,427.360	
T-MOBILE US INC	98,298	221.980	21,820,190.040	
LAS VEGAS SANDS CORP	58,121	55.050	3,199,561.050	
DEXCOM INC	73,789	73.090	5,393,238.010	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	22,520	109.680	2,469,993.600	
EXPEDIA GROUP INC	23,401	198.120	4,636,206.120	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	96.110	2,976,430.590	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,656	466.240	8,698,173.440	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	111,177	155.360	17,272,458.720	
LIVE NATION	30,095	157.980	4,754,408.100	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	258,246	36.490	9,423,396.540	

UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	16,804	112.590	1,891,962.360	
TRANSDIGM GROUP INC	10,958	1,293.870	14,178,227.460	
MASTERCARD INC	166,622	498.000	82,977,756.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	22,802	174.130	3,970,512.260	
AERCAP HOLDINGS NV	33,912	148.460	5,034,575.520	
FIRST SOLAR INC	19,569	243.210	4,759,376.490	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	22,446	177.780	3,990,449.880	
SUPER MICRO COMPUTER INC	101,720	31.130	3,166,543.600	
AECOM TECHNOLOGY CORP	23,905	95.340	2,279,102.700	
DELTA AIR LINES INC	30,555	69.230	2,115,322.650	
INTERACTIVE BROKERS GROUP INC	84,559	71.920	6,081,483.280	
INSULET CORP	13,390	245.250	3,283,897.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	21,544	179.490	3,866,932.560	
MERCADOLIBRE INC	8,859	1,922.560	17,031,959.040	
ULTA BEAUTY INC	8,638	686.440	5,929,468.720	
MSCI INC	15,204	548.710	8,342,586.840	
ECHOSTAR CORP	27,136	106.780	2,897,582.080	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	304,172	187.000	56,880,164.000	
VISA INC	332,012	307.220	102,000,726.640	
KEURIG DR PEPPER INC	249,108	31.030	7,729,821.240	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	38,431	134.080	5,152,828.480	
MARATHON PETROLEUM CORP	58,796	195.290	11,482,270.840	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	390,962	32.690	12,780,547.780	
XYLEM INC	46,044	128.130	5,899,617.720	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	46,489	58.320	2,711,238.480	
HCA HEALTHCARE INC	32,021	526.520	16,859,696.920	
VERISK ANALYTICS INC	28,116	191.170	5,374,935.720	
CORPAY INC	13,937	338.770	4,721,437.490	
NXP SEMICONDUCTOR NV	49,535	234.630	11,622,397.050	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	24,062	75.700	1,821,493.400	
TARGA RESOURCES CORP	42,287	231.720	9,798,743.640	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	20,737	292.940	6,074,696.780	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	40,776	70.370	2,869,407.120	
DOLLAR GENERAL CORP	43,366	153.960	6,676,629.360	
FORTINET INC	124,594	75.230	9,373,206.620	
HYATT HOTELS CORP	9,487	164.020	1,556,057.740	
NEBIUS GROUP NV	39,966	102.580	4,099,712.280	
TESLA INC	551,873	409.380	225,925,768.740	
GENERAL MOTORS CO	184,861	81.290	15,027,350.690	

LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	15,225	308.700	4,699,957.500	
PHILLIPS 66	79,322	154.360	12,244,143.920	
META PLATFORMS INC	423,713	639.300	270,879,720.900	
IQVIA HOLDINGS INC	33,630	164.880	5,544,914.400	
DIAMONDBACK ENERGY INC	37,572	172.520	6,481,921.440	
SERVICENOW INC	205,040	102.490	21,014,549.600	
PALO ALTO NETWORKS INC	152,830	141.670	21,651,426.100	
WORKDAY INC	42,662	130.230	5,555,872.260	
ABBVIE INC	345,197	228.440	78,856,802.680	
ZOETIS INC	86,811	128.660	11,169,103.260	
NEWS CORP/NEW-CL A	74,879	23.180	1,735,695.220	
CDW CORP	26,509	125.530	3,327,674.770	
HOWMET AEROSPACE INC	74,308	260.950	19,390,672.600	
TWILIO INC	30,284	113.850	3,447,833.400	
SNAP INC	211,448	4.970	1,050,896.560	
TRADE DESK INC A	85,325	24.940	2,128,005.500	
BLOOM ENERGY CORP	41,958	166.200	6,973,419.600	
OKTA INC	33,875	71.140	2,409,867.500	
BAKER HUGHES CO	191,551	64.720	12,397,180.720	
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	12.750	2,065,015.500	
BROADCOM INC	876,033	325.490	285,139,981.170	
ARES MANAGEMENT CORP	43,107	117.160	5,050,416.120	
MONGODB INC	15,583	312.510	4,869,843.330	
BURLINGTON STORES INC	12,574	308.070	3,873,672.180	
VEEVA SYSTEMS INC	29,383	175.790	5,165,237.570	
EVERGY INC	42,893	82.500	3,538,672.500	
ALLEGION PLC	15,800	158.860	2,509,988.000	
STERIS PLC	18,903	246.740	4,664,126.220	
DOCUSIGN INC	35,627	42.850	1,526,616.950	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	30,765	465.660	14,326,029.900	
WIX.COM LTD	8,997	65.490	589,213.530	
KKR & CO INC	122,749	95.720	11,749,534.280	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	11,993	143.970	1,726,632.210	
ZOOM COMMUNICATIONS INC	51,232	87.510	4,483,312.320	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	45,166	312.780	14,127,021.480	
CIGNA GROUP	52,355	281.000	14,711,755.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	26,874	139.000	3,735,486.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	61,689	119.780	7,389,108.420	
DOW INC	145,651	31.050	4,522,463.550	
AMCOR PLC	91,979	50.180	4,615,506.220	
PINTEREST INC	121,804	16.950	2,064,577.800	
FOX CORP-A	44,561	55.980	2,494,524.780	
FOX CORP-B	27,507	51.460	1,415,510.220	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	48,625	350.250	17,030,906.250	
DYNATRACE INC	61,098	34.250	2,092,606.500	
CLOUDFLARE INC	61,804	163.810	10,124,113.240	

TRADEWEB MARKETS INC	24,737	121.090	2,995,403.330	
CARRIER GLOBAL CORP	148,267	63.530	9,419,402.510	
OTIS WORLDWIDE CORP	76,799	89.910	6,904,998.090	
UBER TECHNOLOGIES INC	387,352	71.380	27,649,185.760	
CORTEVA INC	133,070	77.970	10,375,467.900	
BLACKSTONE INC	144,817	116.410	16,858,146.970	
CARLYLE GROUP INC	47,472	50.890	2,415,850.080	
DATADOG INC	60,838	104.430	6,353,312.340	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	41,558	396.020	16,457,799.160	
VERTIV HOLDINGS CO	71,367	253.150	18,066,556.050	
INGERSOLL RAND INC	79,632	94.640	7,536,372.480	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	89,932	84.050	7,558,784.600	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	119.340	1,067,018.940	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	150,179	15.120	2,270,706.480	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDING LTD	29,947	120.830	3,618,496.010	
DRAFTKINGS INC	85,667	22.370	1,916,370.790	
AON PLC	39,920	319.330	12,747,653.600	
SOFI TECHNOLOGIES INC	226,938	18.660	4,234,663.080	
WARNER BROS DISCOVERY INC	460,698	29.150	13,429,346.700	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	11,625	531.950	6,183,918.750	
BENTLEY SYSTEMS INC	27,315	32.340	883,367.100	
COINBASE GLOBAL INC	39,941	162.030	6,471,640.230	
ROCKET COS INC	170,295	17.710	3,015,924.450	
OKLO INC	21,102	65.060	1,372,896.120	
AFFIRM HOLDINGS INC	51,203	47.870	2,451,087.610	
AIRBNB INC	83,844	125.660	10,535,837.040	
CONSTELLATION ENERGY CORP	60,485	312.640	18,910,030.400	
MONDAY.COM LTD	7,760	75.340	584,638.400	
ASTERA LABS INC	25,360	128.400	3,256,224.000	
SOLVENTUM CORP	31,700	73.420	2,327,414.000	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	60,836	27.530	1,674,815.080	
APPROVIN CORP	44,601	393.220	17,538,005.220	
REDDIT INC	19,914	142.080	2,829,381.120	
ROYALTY PHARMA PLC	83,460	45.400	3,789,084.000	
ROBLOX CORP	114,887	67.090	7,707,768.830	
EXPAND ENERGY CORP	47,257	103.180	4,875,977.260	
BLACKROCK INC	28,832	1,081.050	31,168,833.600	
SNOWFLAKE INC	62,550	161.060	10,074,303.000	
DOORDASH INC	75,131	164.380	12,350,033.780	
ARISTA NETWORKS INC	207,190	128.770	26,679,856.300	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	84,140	114.130	9,602,898.200	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	444,830	128.840	57,311,897.200	

FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	52,125	51.940	2,707,372.500	
JACOBS SOLUTIONS INC	23,919	134.530	3,217,823.070	
MARVELL TECHNOLOGY INC	167,692	78.390	13,145,375.880	
LINDE PLC	91,437	504.000	46,084,248.000	
ROBINHOOD MARKETS INC	142,810	73.390	10,480,825.900	
IONQ INC	56,274	31.620	1,779,383.880	
TOAST INC	93,856	25.570	2,399,897.920	
GE VERNOVA INC	53,284	879.730	46,875,533.320	
GRAB HOLDINGS LTD	445,513	4.150	1,848,878.950	
SYNCHRONY FINANCIAL	70,641	70.770	4,999,263.570	
VERALTO CORP	47,699	93.650	4,467,011.350	
SAMSARA INC	67,082	26.070	1,748,827.740	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	41,459	87.170	3,613,981.030	
BUNGE GLOBAL SA	27,820	122.510	3,408,228.200	
KENVUE INC	370,111	19.010	7,035,810.110	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	90,573	62.070	5,621,866.110	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	33,433	301.480	10,079,380.840	
HUBSPOT INC	9,800	232.600	2,279,480.000	
TE CONNECTIVITY PLC	56,867	241.440	13,729,968.480	
SMURFIT WESTROCK PLC	99,630	45.900	4,573,017.000	
FERGUSON ENTERPRISES INC	38,451	261.850	10,068,394.350	
LABCORP HOLDINGS INC	16,433	287.130	4,718,407.290	
ROCKET LAB CORP	82,512	69.970	5,773,364.640	
APTIV PLC	43,097	77.690	3,348,205.930	
COREWEAVE INC	32,829	99.300	3,259,919.700	
AMRIZE LTD	93,550	65.860	6,161,203.000	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS INC	28,482	94.170	2,682,149.940	
QNTITY ELECTRONICS INC	40,198	116.790	4,694,724.420	
GODADDY INC	26,695	92.300	2,463,948.500	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	33,123	118.390	3,921,431.970	
TRANSUNION	39,291	72.010	2,829,344.910	
BLOCK INC	108,820	51.000	5,549,820.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	80,396	51.070	4,105,823.720	
NUTANIX INC	44,547	37.860	1,686,549.420	
CARVANA CO	25,804	325.160	8,390,428.640	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	40,260	107.750	4,338,015.000	
NATERA INC	25,081	209.530	5,255,221.930	
KRAFT HEINZ CO	165,661	24.780	4,105,079.580	
FORTIVE CORP	61,764	57.680	3,562,547.520	
WASTE CONNECTIONS INC	50,733	165.480	8,395,296.840	
ALPHABET INC-CL A	1,135,581	310.900	353,052,132.900	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	261,801	20.250	5,301,470.250	
	PAYPAL HOLDINGS INC	174,416	47.020	8,201,040.320	
	SEA LTD ADR	75,231	107.110	8,057,992.410	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	58,808	41.110	2,417,596.880	
	ZILLOW GROUP INC-C	31,954	43.730	1,397,348.420	
	ALPHABET INC-CL C	954,184	310.920	296,674,889.280	
	PURE STORAGE INC	59,995	67.720	4,062,861.400	
	ZSCALER INC	19,560	149.360	2,921,481.600	
	ATLASSIAN CORP PLC	31,810	71.180	2,264,235.800	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	17,132	231.850	3,972,054.200	
	VISTRA CORP	66,829	171.620	11,469,192.980	
アメリカ・ドル	小計	72,037,245		11,523,421,041.850 (1,795,694,700,952)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	79,060	42.130	3,330,797.800	
	ASHTED GROUP	82,201	52.520	4,317,196.520	
	SEVERN TRENT PLC	59,179	32.020	1,894,911.580	
	BARCLAYS PLC	2,703,740	4.599	12,434,500.260	
	BARRATT REDROW PLC	284,568	3.725	1,060,015.800	
	BT GROUP PLC	1,171,195	2.093	2,451,311.130	
	BUNZL PLC	61,315	21.340	1,308,462.100	
	AVIVA PLC	588,537	6.532	3,844,323.680	
	DIAGEO PLC	440,530	18.740	8,255,532.200	
	SCHRODERS PLC	110,366	5.860	646,744.760	
	DCC PLC	17,471	51.850	905,871.350	
	NATIONAL GRID PLC	956,907	13.730	13,138,333.110	
	KINGFISHER PLC	336,026	3.649	1,226,158.870	
	BAE SYSTEMS PLC	578,228	21.410	12,379,861.480	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	427,783	45.570	19,494,071.310	
	HALMA PLC	76,539	40.620	3,109,014.180	
	NEXT PLC	21,704	132.600	2,877,950.400	
	IMPERIAL BRANDS PLC	150,861	32.430	4,892,422.230	
	ANGLO AMERICAN PLC	219,857	36.680	8,064,354.760	
	COMPASS GROUP PLC	326,972	21.840	7,141,068.480	
	HSBC HOLDINGS PLC	3,366,254	12.914	43,471,804.150	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,077,905	2.662	2,869,383.110	
	CENTRICA PLC	963,585	1.909	1,839,483.760	
	UNILEVER PLC	426,348	54.720	23,329,762.560	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	143,835	13.670	1,966,224.450	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	19.600	1,078,842.800	
	PEARSON PLC	116,743	9.336	1,089,912.640	
	PRUDENTIAL PLC	499,870	11.065	5,531,061.550	
	RIO TINTO PLC	218,341	72.690	15,871,207.290	

VODAFONE GROUP PLC	3,849,443	1.162	4,473,052.760		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	122,753	63.920	7,846,371.760		
RELX PLC	356,287	22.730	8,098,403.510		
RENTOKIL INITIAL PLC	492,609	4.457	2,195,558.310		
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,647,671	13.100	21,584,490.100		
NATWEST GROUP PLC	1,584,323	6.044	9,575,648.210		
SSE PLC	230,006	26.130	6,010,056.780		
BP PLC	3,086,268	4.712	14,542,494.810		
THE SAGE GROUP PLC	186,583	7.868	1,468,035.040		
SMITHS GROUP PLC	70,278	26.940	1,893,289.320		
SPIRAX GROUP PLC	12,537	79.200	992,930.400		
STANDARD CHARTERED PLC	377,859	17.890	6,759,897.510		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,624,402	1.026	11,926,636.450		
TESCO PLC	1,286,682	5.012	6,448,850.180		
3I GROUP PLC	196,566	32.880	6,463,090.080		
SMITH & NEPHEW PLC	157,186	13.265	2,085,072.290		
GSK PLC	796,073	22.010	17,521,566.730		
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	90,373	76.780	6,938,838.940		
ASTRAZENECA PLC	303,091	153.260	46,451,726.660		
WHITBREAD PLC	31,475	26.190	824,330.250		
MARKS & SPENCER GROUP PLC	439,486	4.037	1,774,204.980		
INTERTEK GROUP PLC	29,397	45.340	1,332,859.980		
SAINSBURY (J) PLC	371,991	3.594	1,336,935.650		
ADMIRAL GROUP PLC	55,777	28.220	1,574,026.940		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	34,042	16.530	562,714.260		
EXPERIAN PLC	181,172	25.610	4,639,814.920		
FRESNILLO PLC NPR	40,047	40.320	1,614,695.040		
INFORMA PLC	259,912	8.176	2,125,040.510		
GLENCORE PLC	1,959,689	5.193	10,176,664.970		
ENTAIN PLC	96,924	5.644	547,039.050		
COCA-COLA HBC AG	40,130	47.860	1,920,621.800		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	7.410	1,006,485.480		
M&G PLC	454,395	3.117	1,416,349.210		
ENDEAVOUR MINING PLC	38,875	49.740	1,933,642.500		
WISE PLC	120,090	8.330	1,000,349.700		
JD SPORTS FASHION PLC	382,071	0.812	310,241.650		
HALEON PLC	1,747,850	4.057	7,091,027.450		
SHELL PLC	1,133,746	29.715	33,689,262.390		
AUTOTRADER GROUP PLC	175,449	4.715	827,242.030		
MELROSE INDUSTRIES PLC	253,295	6.404	1,622,101.180		
イギリス・ボンド 小計	50,013,594		470,422,244.090 (98,976,840,157)		
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	228,416	80.080	18,291,553.280	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	290,575	76.360	22,188,307.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,273	2,305.000	12,154,265.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	244,057	39.450	9,628,048.650	
	ICL GROUP LTD	161,905	16.170	2,618,003.850	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	50,192	158.800	7,970,489.600	
	NOVA LTD	5,865	1,412.200	8,282,553.000	
	NICE LTD	12,389	355.900	4,409,245.100	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	246.800	7,266,779.200	
	AZRIELI GROUP	10,380	451.300	4,684,494.000	
	イスラエル・シュケル 小計	1,038,496		97,493,738.680 (4,886,834,654)	
オーストラリア・ドル	WESTPAC BANKING CORPORATION	663,875	42.650	28,314,268.750	
	FORTESCUE LTD	330,859	20.200	6,683,351.800	
	TELSTRA GROUP LTD	824,041	5.250	4,326,215.250	
	LYNAS CORP LTD	171,192	15.780	2,701,409.760	
	ASX LTD	45,184	52.040	2,351,375.360	
	BHP GROUP LTD	983,630	54.750	53,853,742.500	
	COMPUTERSHARE LT	109,500	30.650	3,356,175.000	
	CSL LIMITED	95,394	145.000	13,832,130.000	
	REA GROUP LTD	9,317	152.900	1,424,569.300	
	TRANSURBAN GROUP	588,551	14.350	8,445,706.850	
	COCHLEAR LTD	12,995	193.000	2,508,035.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	326,442	12.110	3,953,212.620	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	328,053	178.500	58,557,460.500	
	RIO TINTO LIMITED	73,132	159.320	11,651,390.240	
	APA GROUP	278,473	9.150	2,548,027.950	
	ARISTOCRAT LEISU	104,372	46.030	4,804,243.160	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	444,982	6.730	2,994,728.860	
	PRO MEDICUS LTD	11,011	108.150	1,190,839.650	
	MACQUARIE GROUP LTD	70,060	206.490	14,466,689.400	
	SUNCORP GROUP LTD	196,764	14.670	2,886,527.880	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	602,514	48.370	29,143,602.180	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	10.420	1,173,906.780	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	286,795	21.870	6,272,206.650	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	269,243	29.760	8,012,671.680	
	SANTOS LTD	654,961	6.810	4,460,284.410	
	SONIC HEALTHCARE	88,200	22.840	2,014,488.000	
	WESFARMERS LTD	223,082	81.090	18,089,719.380	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	361,471	27.750	10,030,820.250	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	243,597	31.540	7,683,049.380	
	BRAMBLES LTD	276,036	24.840	6,856,734.240	
	EVOLUTION MINING LTD	393,664	15.710	6,184,461.440	

	CAR GROUP LTD	70,405	23.930	1,684,791.650	
	SGH LTD	39,806	48.000	1,910,688.000	
	XERO LTD	31,885	71.840	2,290,618.400	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	901,744	3.000	2,705,232.000	
	LOTTERY CORP LTD	366,780	5.450	1,998,951.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	580,849	39.490	22,937,727.010	
	MEDIBANK PVT LTD	629,748	4.420	2,783,486.160	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	76,399	36.990	2,825,999.010	
	SOUTH32 LTD(AUD)	867,426	4.510	3,912,091.260	
	COLES GROUP LTD	264,538	21.870	5,785,446.060	
	WISETECH GLOBAL LTD	38,698	42.990	1,663,627.020	
	オーストラリア・ドル 小計	13,048,327		381,270,701.790 (42,035,094,872)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	97,981	334.660	32,790,321.460	
	BARRICK MINING CORP	332,994	68.150	22,693,541.100	
	BANK OF MONTREAL	140,000	195.060	27,308,400.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	242,857	103.320	25,091,985.240	
	NATIONAL BANK OF CANADA	77,154	177.460	13,691,748.840	
	BCE INC	14,197	35.690	506,690.930	
	BROOKFIELD CORP	400,508	61.660	24,695,323.280	
	BOMBARDIER INC 'B'	17,199	272.640	4,689,135.360	
	SAPUTO INC	56,192	42.560	2,391,531.520	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	17,626	87.160	1,536,282.160	
	CGI INC	38,154	96.760	3,691,781.040	
	CCL INDUSTRIES INC	27,743	91.570	2,540,426.510	
	CAE INC	55,407	39.890	2,210,185.230	
	CAMECO CORP	85,939	165.910	14,258,139.490	
	ROGERS COMM-CL B	74,725	53.390	3,989,567.750	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	180,276	134.530	24,252,530.280	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	408,012	58.350	23,807,500.200	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	190.690	1,699,238.590	
	CANADIAN UTILITIES LTD	31,617	47.580	1,504,336.860	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	102,636	152.480	15,649,937.280	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,184	98.620	3,667,086.080	
	OPEN TEXT CORP	52,759	32.890	1,735,243.510	
	CELESTICA INC	21,879	406.340	8,890,312.860	
	EMPIRE CO LTD	20,608	49.270	1,015,356.160	
	KINROSS GOLD CORP	232,375	49.460	11,493,267.500	
	RB GLOBAL INC	35,429	132.780	4,704,262.620	
	FORTIS INC	94,197	77.850	7,333,236.450	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	135,943	40.240	5,470,346.320	
	TELUS CORP	31,890	18.570	592,197.300	
	GREAT WEST LIFECO INC	57,033	63.930	3,646,119.690	
	IMPERIAL OIL LTD	32,165	158.230	5,089,467.950	

ENBRIDGE INC	427,348	71.800	30,683,586.400	
IGM FINANCIAL INC	12,478	68.800	858,486.400	
MANULIFE FINANCIAL CORP	333,825	49.040	16,370,778.000	
LOBLAW CO LTD	110,360	67.520	7,451,507.200	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	141,962	84.360	11,975,914.320	
MAGNA INTERNATIONAL INC	54,200	89.070	4,827,594.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	107,376	88.960	9,552,168.960	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,961	2,322.870	9,200,888.070	
METRO INC	40,887	97.990	4,006,517.130	
EMERA INC	54,611	69.850	3,814,578.350	
PAN AMERICAN SILVER CORP	79,836	89.560	7,150,112.160	
POWER CORP OF CANADA	108,654	67.160	7,297,202.640	
ROYAL BANK OF CANADA	274,588	234.050	64,267,321.400	
ATKINSREALIS GROUP INC	32,972	94.230	3,106,951.560	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	178,430	118.220	21,093,994.600	
STANTEC INC	22,549	120.430	2,715,576.070	
SUNCOR ENERGY INC	231,435	76.700	17,751,064.500	
LUNDIN MINING CORP	138,909	44.410	6,168,948.690	
TECK RESOURCES LTD-CL B	96,471	81.950	7,905,798.450	
THOMSON REUTERS CORP	29,819	123.450	3,681,155.550	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,754	203.750	3,617,377.500	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	332,232	130.330	43,299,796.560	
TC ENERGY CORP	203,116	86.900	17,650,780.400	
WESTON (GEORGE) LTD	36,807	101.490	3,735,542.430	
INTACT FINANCIAL CORP	35,418	260.880	9,239,847.840	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	89,195	215.660	19,235,793.700	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,067	2,368.450	9,632,486.150	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	37,720	374.470	14,125,008.400	
TOURMALINE OIL CORP	72,309	62.760	4,538,112.840	
KEYERA CORP	39,997	52.080	2,083,043.760	
WHITECAP RESOURCES INC	216,946	13.590	2,948,296.140	
ALTAGAS LTD	59,998	45.660	2,739,508.680	
PEMBINA PIPELINE CORP	108,468	60.670	6,580,753.560	
DOLLARAMA INC	53,121	196.370	10,431,370.770	
CENOVUS ENERGY INC W/I	285,254	30.620	8,734,477.480	
ARC RESOURCES LTD	112,620	24.790	2,791,849.800	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	73,200	34.460	2,522,472.000	
TMX GROUP LTD	61,220	46.410	2,841,220.200	
IVANHOE MINES LTD	136,822	15.110	2,067,380.420	
NUTRIEN LTD	96,968	99.670	9,664,800.560	
TFI INTERNATIONAL INC	14,528	159.790	2,321,429.120	
WSP GLOBAL INC	25,071	217.990	5,465,227.290	

	IA FINANCIAL CORP INC	19,845	155.860	3,093,041.700	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	48,982	57.940	2,838,017.080	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	82,860	66.410	5,502,732.600	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	28,942	59.570	1,724,074.940	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	57,744	94.290	5,444,681.760	
	LUNDIN GOLD INC	22,677	118.970	2,697,882.690	
	SHOPIFY INC	239,174	160.460	38,377,860.040	
	FIRSTSERVICE CORP	7,857	212.730	1,671,419.610	
	HYDRO ONE LTD	68,595	57.940	3,974,394.300	
	ALAMOS GOLD INC	88,473	69.280	6,129,409.440	
カナダ・ドル 小計		8,420,241		800,235,733.770 (91,018,812,359)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	289,800	10.240	2,967,552.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	6.300	1,021,860.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	415,881	57.860	24,062,874.660	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	178,500	17.940	3,202,290.000	
	KEPPEL LTD	310,000	13.170	4,082,700.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	661,598	21.430	14,178,045.140	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,428,230	5.120	7,312,537.600	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	345,800	7.030	2,430,974.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	238,266	37.200	8,863,495.200	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	381,600	3.600	1,373,760.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	508,500	3.960	2,013,660.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	3.110	1,260,451.900	
シンガポール・ドル 小計		5,325,665		72,770,200.500 (8,950,006,959)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	30,835	70.500	2,173,867.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	503,103	82.940	41,727,362.820	
	CIE FINANC RICHEMONT	104,111	163.600	17,032,559.600	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	137,377	374.000	51,378,998.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,599	294.600	2,238,665.400	
	SIKA INHABER	30,549	158.200	4,832,851.800	
	SGS SA-REG	32,234	94.240	3,037,732.160	
	NOVARTIS AG-REG SHS	371,234	129.600	48,111,926.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	717	1,523.000	1,091,991.000	
	SWISSCOM AG-REG	5,126	716.000	3,670,216.000	
	ABB LTD	306,348	70.620	21,634,295.760	
	GEBERIT AG	6,586	654.200	4,308,561.200	
	LONZA GROUP AG-REG	13,662	523.800	7,156,155.600	

	LINDT & SPRUENGLI PART	184	12,880.000	2,369,920.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	20	128,600.000	2,572,000.000	
	GIVAUDAN-REG	1,826	3,115.000	5,687,990.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	28,607	576.400	16,489,074.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	6,123	382.200	2,340,210.600	
	HOLCIM LTD	99,934	74.300	7,425,096.200	
	SONOVA HOLDING AG	10,293	193.400	1,990,666.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	10,478	172.750	1,810,074.500	
	STRAUMANN HOLDING AG	22,266	90.860	2,023,088.760	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6,261	201.900	1,264,095.900	
	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	16,170	198.000	3,201,660.000	
	SCHINDLER NAMEN	5,064	282.000	1,428,048.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,442	868.000	4,723,656.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	114.600	561,883.800	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	639.500	796,177.500	
	SWISS PRIME SITE AG	15,640	139.900	2,188,036.000	
	AVOLTA AG	21,652	51.550	1,116,160.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,304	852.600	3,669,590.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	38,917	64.120	2,495,358.040	
	SWISS RE LTD	57,252	130.300	7,459,935.600	
	BKW AG	3,194	145.300	464,088.200	
	ALCON INC	99,146	64.260	6,371,121.960	
	SANDOZ GROUP AG	79,524	65.640	5,219,955.360	
	BELIMO HOLDING AG	1,988	813.000	1,616,244.000	
	GALDERMA GROUP AG	29,534	144.100	4,255,849.400	
	UBS GROUP AG	621,461	31.760	19,737,601.360	
	VAT GROUP AG	5,180	530.200	2,746,436.000	
スイス・フラン	小計	2,746,089		320,419,202.420 (64,551,652,520)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	528,528	196.250	103,723,620.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	297,619	170.150	50,639,872.850	
	ERICSSON LM-B SHS	553,049	99.860	55,227,473.140	
	LUNDBERGS B	14,872	575.000	8,551,400.000	
	SKF AB-B SHS	66,600	261.300	17,402,580.000	
	SANDVIK AB	207,436	391.100	81,128,219.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	300,082	193.300	58,005,850.600	
	SKANSKA AB-B SHS	62,329	273.800	17,065,680.200	
	SWEDBANK AB	163,144	346.000	56,447,824.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	138,616	122.300	16,952,736.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	288,078	143.550	41,353,596.900	
	TRELLEBORG AB-B SHS	37,154	404.400	15,025,077.600	
	VOLVO AB-B SHS	312,050	353.200	110,216,060.000	

HOLMEN AB-B SHS	10,846	358.800	3,891,544.800		
TELE2 AB-B SHS	100,027	189.600	18,965,119.200		
INDUSTRIVARDEN A	24,631	497.200	12,246,533.200		
INDUSTRIVARDEN C	31,300	495.800	15,518,540.000		
SAAB AB-B	63,945	657.900	42,069,415.500		
SECURITAS AB-B SHS	99,643	155.950	15,539,325.850		
INVESTOR AB-B SHS	349,728	370.700	129,644,169.600		
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	187.550	19,630,670.950		
ASSA ABLOY AB-B	191,457	385.800	73,864,110.600		
TELIA CO AB	468,019	46.020	21,538,234.380		
BOLIDEN AB	53,845	700.600	37,723,807.000		
ALFA LAVAL AB	58,487	535.000	31,290,545.000		
FASTIGHETS AB BALDER	117,966	65.660	7,745,647.560		
INDUTRADE AB	58,393	235.800	13,769,069.400		
NIBE INDUSTRIER AB	292,985	40.370	11,827,804.450		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	405.400	14,748,857.400		
HEXAGON AB-B SHS	404,109	99.220	40,095,694.980		
SAGAX AB	44,607	180.000	8,029,260.000		
EPIROC AB-A	125,482	266.700	33,466,049.400		
EPIROC AB-B	80,804	229.800	18,568,759.200		
ESSITY AB-B	115,540	289.300	33,425,722.000		
EQT AB	97,156	271.800	26,407,000.800		
ADDTECH AB	47,848	323.400	15,474,043.200		
BEIJER REF AB	71,081	138.000	9,809,178.000		
LIFCO AB	49,888	318.400	15,884,339.200		
EVOLUTION AB	26,852	527.200	14,156,374.400		
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	225.100	6,221,313.800		
スウェーデン・クローナ 小計	6,122,884		1,323,291,121.560 (22,800,306,024)		
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	18,112	991.200	17,952,614.400	
	A P MOLLER A/S	851	15,620.000	13,292,620.000	
	AP MOLLER MAERSK A	543	15,530.000	8,432,790.000	
	DANSKE BANK A/S	127,010	333.100	42,307,031.000	
	GENMAB A/S	12,165	1,851.500	22,523,497.500	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	67,444	385.500	25,999,662.000	
	ROCKWOOL AS	16,770	219.400	3,679,338.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	630,972	243.650	153,736,327.800	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	195,996	158.450	31,055,566.200	
	COLOPLAST-B	25,816	488.800	12,618,860.800	
	DSV A/S	39,312	1,607.000	63,174,384.000	
	DEMANT A/S	17,700	178.700	3,162,990.000	
	TRYG A/S	58,222	154.000	8,966,188.000	
	PANDORA A/S	14,742	526.000	7,754,292.000	
	ORSTED A/S	106,744	157.100	16,769,482.400	
デンマーク・クローネ 小計	1,332,399		431,425,644.100 (10,595,813,819)		

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	303,739	9.000	2,733,651.000	
	CONTACT ENERGY L	183,385	9.330	1,710,982.050	
	FISHER & PAYKEL	116,144	39.690	4,609,755.360	
	INFRATIL LTD	167,377	10.970	1,836,125.690	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.740	1,373,627.920	
ニュージーランド・ドル 小計		1,009,953		12,264,142.020 (1,140,687,849)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	102,370	230.600	23,606,522.000	
	NORSK HYDRO ASA	280,113	87.580	24,532,296.540	
	TELENOR ASA	119,422	173.900	20,767,485.800	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	89,335	387.600	34,626,246.000	
	ORKLA ASA	116,068	130.500	15,146,874.000	
	EQUINOR ASA	156,006	280.200	43,712,881.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	464.700	13,668,685.800	
	AKER BP ASA	55,995	284.100	15,908,179.500	
	SALMAR ASA	12,897	590.000	7,609,230.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	41,223	268.800	11,080,742.400	
	DNB BANK ASA	173,149	299.000	51,771,551.000	
ノルウェー・クローネ 小計		1,175,992		262,430,694.240 (4,272,371,702)	
ユーロ	RYANAIR HOLDINGS	167,053	27.020	4,513,772.060	
	KERRY GROUP PLC-A	31,648	74.550	2,359,358.400	
	KINGSPAN GROUP PLC	29,826	84.750	2,527,753.500	
	AIR LIQUIDE	111,354	177.300	19,743,064.200	
	AIRBUS SE	116,243	182.840	21,253,870.120	
	AXA SA	341,669	40.000	13,666,760.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	124,161	35.080	4,355,567.880	
	ADIDAS AG	32,915	160.200	5,272,983.000	
	GENERALI	167,223	35.840	5,993,272.320	
	DASSAULT AVIATION SA	4,132	346.400	1,431,324.800	
	DANONE	127,680	72.060	9,200,620.800	
	SAFRAN SA	69,526	340.600	23,680,555.600	
	INTESA SANPAOLO	2,776,298	5.761	15,994,252.770	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53,290	88.480	4,715,099.200	
	ACCOR SA	38,165	48.070	1,834,591.550	
	BOUYGUES	37,899	51.360	1,946,492.640	
	BPER BANCA SPA	289,858	12.090	3,504,383.220	
	BNP PARIBAS	194,820	94.480	18,406,593.600	
	THALES SA	18,414	251.200	4,625,596.800	
	CAPGEMINI SA	30,992	102.450	3,175,130.400	
	LOTUS BAKERIES NV	77	10,560.000	813,120.000	
	UNICREDIT SPA	274,324	72.720	19,948,841.280	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	15,271	192.300	2,936,613.300	
D'IETEREN TRDG	4,146	182.800	757,888.800		

COMMERZBANK AG	147,043	34.250	5,036,222.750	
EIFFAGE	12,706	143.150	1,818,863.900	
FRESENIUS SE & CO KGAA	84,108	50.360	4,235,678.880	
PUBLICIS GROUPE	44,953	72.720	3,268,982.160	
IBERDROLA SA	1,275,355	20.050	25,570,867.750	
ENI SPA	398,493	18.750	7,471,743.750	
JERONIMO MARTINS	45,606	22.080	1,006,980.480	
KESKO OYJ-B	56,685	20.980	1,189,251.300	
KBC GROUPE	44,218	113.650	5,025,375.700	
HANNOVER RUECK SE	11,943	252.600	3,016,801.800	
WARTSILA OYJ	93,067	37.230	3,464,884.410	
L'OREAL	47,010	403.100	18,949,731.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	48,964	561.800	27,507,975.200	
GEA GROUP AG	31,889	65.800	2,098,296.200	
BOLLORE	114,808	4.882	560,492.650	
MICHELIN(CGDE) -B	136,013	34.370	4,674,766.810	
CONTINENTAL AG	21,977	74.720	1,642,121.440	
DEUTSCHE POST AG-REG	188,184	49.110	9,241,716.240	
OMV AG	31,189	55.250	1,723,192.250	
VERBUND AG	10,663	59.150	630,716.450	
PERNOD-RICARD	42,072	84.220	3,543,303.840	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	33,246	36.230	1,204,502.580	
RENAULT SA	34,278	32.590	1,117,120.020	
REPSOL SA	209,345	18.670	3,908,471.150	
MERCK KGAA	25,862	125.500	3,245,681.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	88,333	87.900	7,764,470.700	
RWE AG	121,845	52.680	6,418,794.600	
SOCIETE GENERALE-A	136,355	73.900	10,076,634.500	
VINCI S.A.	98,299	141.750	13,933,883.250	
SODEXO	17,430	47.360	825,484.800	
SOFINA	3,443	248.000	853,864.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	107,314	262.550	28,175,290.700	
SAP SE	205,075	165.840	34,009,638.000	
TELEFONICA S.A	760,673	3.652	2,777,977.790	
TOTALENERGIES SE	388,008	66.720	25,887,893.760	
E.ON SE	430,233	18.740	8,062,566.420	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	77.100	1,379,010.600	
SIEMENS AG-REG	148,407	239.500	35,543,476.500	
UPM-KYMMENE OYJ	103,401	27.130	2,805,269.130	
ING GROEP NV-CVA	583,832	24.665	14,400,216.280	
BAYER AG	192,797	42.340	8,163,024.980	
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	11.370	1,091,292.600	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,704	83.980	2,494,541.920	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	141,935	58.930	8,364,229.550	
BASF SE	174,812	48.870	8,543,062.440	

BEIERSDORF AG	18,636	109.700	2,044,369.200	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	77,021	21.230	1,635,155.830	
HOCHTIEF AG	3,095	409.400	1,267,093.000	
HEIDELBERG MATERIALS AG	26,569	200.800	5,335,055.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	42,494	38.280	1,626,670.320	
ASM INTERNATIONAL NV	9,057	717.600	6,499,303.200	
ORANGE	371,642	18.035	6,702,563.470	
SAMPO OYJ-A SHS	484,110	9.220	4,463,494.200	
RANDSTAD NV	23,483	26.660	626,056.780	
ALLIANZ SE	75,424	378.500	28,547,984.000	
EDP SA	624,219	4.420	2,759,047.980	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	171,307	41.330	7,080,118.310	
HERMES INTL	6,229	2,080.000	12,956,320.000	
ENDESA S.A.	63,990	34.280	2,193,577.200	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	9.138	992,816.280	
ERSTE GROUP BANK AG	60,235	103.000	6,204,205.000	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	25,391	548.800	13,934,580.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	88,596	55.940	4,956,060.240	
DASSAULT SYSTEMES SA	134,189	17.430	2,338,914.270	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35,984	107.800	3,879,075.200	
RHEINMETALL STAMM	8,968	1,724.500	15,465,316.000	
HEINEKEN NV	57,687	78.040	4,501,893.480	
AKZO NOBEL	34,435	60.360	2,078,496.600	
ASML HOLDING NV	75,790	1,263.400	95,753,086.000	
AEGON LTD	232,433	6.322	1,469,441.420	
BANKINTER S.A.	139,390	14.415	2,009,306.850	
VOLKSWAGEN AG PFD	40,684	101.600	4,133,494.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,116,410	19.780	22,082,589.800	
KERING	14,490	285.100	4,131,099.000	
ACCIONA S.A.	5,005	202.600	1,014,013.000	
FORTUM OYJ	95,817	19.570	1,875,138.690	
AGEAS	31,169	63.000	1,963,647.000	
UCB SA	25,044	270.900	6,784,419.600	
NEMETSCHEK SE	10,222	64.550	659,830.100	
CARREFOUR SA	125,695	16.130	2,027,460.350	
NATURGY ENERGY GROUP SA	41,164	25.800	1,062,031.200	
NOKIA OYJ	1,020,239	6.324	6,451,991.430	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	158,010	26.600	4,203,066.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	47,174	62.200	2,934,222.800	
SANOFI	214,259	80.610	17,271,417.990	
STMICROELECTRONICS NV	125,261	28.805	3,608,143.100	
ELISA OYJ	23,678	42.900	1,015,786.200	
BANCO SANTANDER SA	2,914,699	10.652	31,047,373.740	

RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	85,537	16.190	1,384,844.030	
QIAGEN N.V.	41,781	41.120	1,718,034.720	
DEUTSCHE BANK AG-REG	360,338	30.140	10,860,587.320	
BMW VORZUG	12,776	88.100	1,125,565.600	
BUZZI UNICEM	14,138	48.900	691,348.200	
ENEL SPA	1,580,000	9.799	15,482,420.000	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,704,453	0.905	1,542,529.960	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	714,807	33.320	23,817,369.240	
SARTORIUS AG	4,533	233.300	1,057,548.900	
LEONARDO SPA	82,251	59.160	4,865,969.160	
CTS EVENTIM AG	11,578	64.700	749,096.600	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	256,474	46.680	11,972,206.320	
RATIONAL AG	860	732.500	629,950.000	
KONINKLIJKE KPN NV	794,750	4.727	3,756,783.250	
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	66.780	1,538,477.640	
DEUTSCHE BOERSE AG	37,265	220.300	8,209,479.500	
BANCO SABADELL	940,657	3.242	3,049,609.990	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15,900	84.050	1,336,395.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	25,531	72.850	1,859,933.350	
INDITEX	212,823	57.540	12,245,835.420	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA	369,259	8.472	3,128,362.240	
MAPFRE SA	164,994	3.930	648,426.420	
ESSILORLUXOTTICA	58,272	234.500	13,664,784.000	
SNAM SPA	390,173	6.400	2,497,107.200	
CREDIT AGRICOLE SA	210,264	18.505	3,890,935.320	
TENARIS SA	76,002	22.920	1,741,965.840	
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.650	1,280,835.400	
TERNA SPA	248,415	10.030	2,491,602.450	
BIOMERIEUX	6,736	95.500	643,288.000	
GRIFOLS SA	53,226	10.935	582,026.310	
NESTE OYJ	84,986	21.210	1,802,553.060	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	26,147	41.380	1,081,962.860	
RECORDATI SPA	23,751	48.080	1,141,948.080	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	103,040	6.614	681,506.560	
MTU AERO ENGINES AG	10,833	371.100	4,020,126.300	
KONE OYJ	67,111	63.900	4,288,392.900	
ELIA GROUP	10,817	136.000	1,471,112.000	
FINANCIERE DE TUBIZE SA	3,656	237.000	866,472.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,801	179.350	861,059.350	
ENGIE	356,385	26.980	9,615,267.300	
ALSTOM	68,028	29.360	1,997,302.080	
IPSEN SA	5,964	159.700	952,450.800	
LEGRAND SA	51,838	154.300	7,998,603.400	
ADP	6,104	123.400	753,233.600	

ORION OYJ	21,796	68.700	1,497,385.200	
METSO CORPORATION	133,678	17.635	2,357,411.530	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	18.420	1,465,955.700	
SYMRISE AG	26,736	78.040	2,086,477.440	
REXEL SA	53,432	36.660	1,958,817.120	
PRYSMIAN SPA	54,234	97.860	5,307,339.240	
CAIXABANK	769,967	10.660	8,207,848.220	
BUREAU VERITAS SA	72,096	27.580	1,988,407.680	
GETLINK	72,777	17.870	1,300,524.990	
EDP RENOVAVEIS SA	67,001	13.500	904,513.500	
AMADEUS IT GROUP SA	85,366	47.600	4,063,421.600	
BRENTAG SE	21,559	53.220	1,147,369.980	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	253,234	4.974	1,259,585.910	
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	15.090	646,395.240	
EDENRED	42,160	18.920	797,667.200	
TALANX AG	13,274	107.400	1,425,627.600	
LEG IMMOBILIEN SE	16,731	68.550	1,146,910.050	
VONOVIA SE	144,450	27.800	4,015,710.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	192,866	16.640	3,209,290.240	
KNORR-BREMSE AG	14,544	114.200	1,660,924.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	65,799	42.000	2,763,558.000	
FERRARI NV	24,750	316.500	7,833,375.000	
ASR NEDERLAND NV	34,744	61.760	2,145,789.440	
AIB GROUP PLC	407,379	8.780	3,576,787.620	
NORDEA BANK ABP	593,618	16.650	9,883,739.700	
FDJ UNITED	17,293	25.060	433,362.580	
MONCLER SPA	43,309	57.620	2,495,464.580	
NEXI SPA	83,576	3.163	264,350.880	
PROSUS NV	256,160	44.000	11,271,040.000	
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	41.550	763,315.050	
JDE PEET'S BV	26,480	31.700	839,416.000	
EXOR NV	16,552	74.700	1,236,434.400	
SIEMENS ENERGY AG	150,425	166.000	24,970,550.000	
HENSOLDT AG	13,720	79.500	1,090,740.000	
INPOST SA	36,721	15.160	556,690.360	
EURONEXT NV	14,077	130.900	1,842,679.300	
IMCD NV	12,321	80.460	991,347.660	
NN GROUP NV	51,556	69.560	3,586,235.360	
FINECOBANK SPA	124,605	19.715	2,456,587.570	
ARGENX SE	11,970	709.200	8,489,124.000	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	204,967	18.620	3,816,485.540	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	91,652	42.490	3,894,293.480	
DSM-FIRMENICH AG	36,128	60.400	2,182,131.200	
SYENQO SA	15,096	78.320	1,182,318.720	
ZALANDO SE	42,234	20.380	860,728.920	

	STELLANTIS NV	404,098	6.590	2,663,005.820	
	FERROVIAL SE	96,632	61.740	5,966,059.680	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	39,582	11.900	471,025.800	
	MAGNUM ICE CREAM CO NV/THE	91,000	13.802	1,255,982.000	
	CSG NV	39,041	30.120	1,175,914.920	
	AENA SME SA	149,081	27.450	4,092,273.450	
	CELLNEX TELECOM SAU	95,346	30.600	2,917,587.600	
	BANCO BPM SPA	232,070	12.655	2,936,845.850	
	ABN AMRO BANK NV	113,671	28.210	3,206,658.910	
	SCOUT24 SE	15,592	69.700	1,086,762.400	
	BANCA MEDIOLANUM SPA	55,270	17.680	977,173.600	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	189,003	68.300	12,908,904.900	
	POSTE ITALIANE SPA	86,197	22.870	1,971,325.390	
	AMUNDI SA	11,288	78.950	891,187.600	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	75,551	8.795	664,471.040	
	ADYEN NV	4,956	932.500	4,621,470.000	
	DELIVERY HERO SE	34,547	19.560	675,739.320	
ユーロ	小計	38,696,022		1,275,319,418.250 (233,970,100,472)	
香港・ドル	CLP HOLDINGS LTD	281,796	77.000	21,698,292.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	127,814	65.850	8,416,551.900	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	231,491	413.600	95,744,677.600	
	MTR CORP	241,941	37.540	9,082,465.140	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	35.320	10,524,371.040	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	257,320	62.450	16,069,634.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	26.280	5,308,560.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,947,406	7.690	14,975,552.140	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	431,904	42.820	18,494,129.280	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	43.340	29,492,653.300	
	SINO LAND CO	659,200	13.260	8,740,992.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	280,565	139.300	39,082,704.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	82.000	4,347,640.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	277,156	123.400	34,201,050.400	
	AIA GROUP LTD	2,054,916	84.850	174,359,622.600	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	12.270	9,780,858.720	
	SANDS CHINA LTD	588,200	18.100	10,646,420.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	276,000	32.980	9,102,480.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	351,135	28.780	10,105,665.300	

	WH GROUP LTD	1,550,000	10.390	16,104,500.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	536,445	62.550	33,554,634.750	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	379,695	47.520	18,043,106.400	
香港・ドル	小計	12,503,607		597,876,561.070 (11,909,701,097)	
合計		213,470,514		2,390,802,923,436 (2,390,802,923,436)	

(2) 株式以外の有価証券

2026年2月25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	11,633,008.310	
		SCENTRE GROUP	997,977.000	3,742,413.750	
		STOCKLAND	480,103.000	2,410,117.060	
		VICINITY CENTRES	815,965.000	2,007,273.900	
	オーストラリア・ドル	小計	2,702,364.000	19,792,813.020 (2,182,157,635)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	867,778.000	2,351,678.380	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,214,726.000	3,061,109.520	
シンガポール・ドル	小計	2,082,504.000	5,412,787.900 (665,718,784)		
投資信託受益証券 合計			4,784,868	2,847,876,419 (2,847,876,419)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,674.000	1,486,647.280	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	58,836.000	1,756,842.960	
		AMERICAN TOWER CORP	91,541.000	17,410,182.790	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	133,913.000	3,082,677.260	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,084.000	4,987,156.720	
		BXP INC	31,813.000	1,892,873.500	
		CROWN CASTLE INC	82,819.000	7,341,076.160	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	65,241.000	11,628,555.840	
		EQUINIX INC	19,041.000	18,125,127.900	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,125.000	2,331,420.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	71,367.000	4,536,086.520	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,115.000	3,388,916.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	42,248.000	6,323,680.640			

	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	57,433.000	2,775,736.890	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	146,637.000	2,529,488.250	
	INVITATION HOMES INC	109,646.000	2,814,612.820	
	IRON MOUNTAIN INC	56,400.000	6,386,736.000	
	KIMCO REALTY	136,267.000	3,175,021.100	
	MID AMERICA	23,159.000	3,105,390.310	
	PROLOGIS INC	180,299.000	25,295,949.700	
	PUBLIC STORAGE	30,383.000	9,239,774.130	
	REALTY INCOME CORP	180,095.000	11,979,919.400	
	REGENCY CENTERS CORP	33,164.000	2,562,582.280	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	22,004.000	4,436,006.400	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	63,655.000	12,691,533.900	
	SUN COMMUNITIES INC	25,617.000	3,364,024.440	
	UDR INC	67,232.000	2,523,889.280	
	VENTAS INC	89,929.000	7,772,563.470	
	VICI PROPERTIES INC	200,481.000	6,070,564.680	
	WELLTOWER INC	130,952.000	27,408,253.600	
	WEYERHAEUSER CO	143,943.000	3,582,741.270	
	WP CAREY INC	44,884.000	3,296,280.960	
	アメリカ・ドル 小計	2,441,997.000	225,302,312.450 (35,108,859,349)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	791,776.120	
	SEGRO PLC	250,449.000	2,030,640.490	
	イギリス・ポンド 小計	371,794.000	2,822,416.610 (593,836,455)	
ユーロ	COVIVIO	8,731.000	531,717.900	
	GECINA SA	8,697.000	663,146.250	
	KLEPIERRE	36,407.000	1,261,866.620	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,812.000	2,381,572.800	
	ユーロ 小計	76,647.000	4,838,303.570 (887,635,173)	
香港・ドル	LINK REIT	499,016.000	18,922,686.720	
	香港・ドル 小計	499,016.000	18,922,686.720 (376,939,919)	
投資証券 合計		3,389,454	36,967,270,896 (36,967,270,896)	
合計			39,815,147,315 (39,815,147,315)	

(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 526銘柄	72.66	-	-	-	75.32
	投資証券 32銘柄	-	-	-	1.42	
イギリス・ポンド	株式 69銘柄	4.00	-	-	-	4.10
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.02	
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.20	-	-	-	0.20
オーストラリア・ドル	株式 42銘柄	1.70	-	-	-	1.82
	投資信託受益証 券 4銘柄	-	-	0.09	-	
カナダ・ドル	株式 83銘柄	3.68	-	-	-	3.74
	新株予約権証券 1銘柄	-	0.00	-	-	
シンガポール・ドル	株式 12銘柄	0.36	-	-	-	0.40
	投資信託受益証 券 2銘柄	-	-	0.03	-	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.61	-	-	-	2.66
スウェーデン・クローナ	株式 40銘柄	0.92	-	-	-	0.94
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.43	-	-	-	0.44
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.17	-	-	-	0.18
ユーロ	株式 218銘柄	9.47	-	-	-	9.66
	投資証券 4銘柄	-	-	-	0.04	
香港・ドル	株式 22銘柄	0.48	-	-	-	0.51
	投資証券 1銘柄	-	-	-	0.02	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2026年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,138,744,521
国債証券	398,877,053,100
地方債証券	22,727,434,896
特殊債券	18,601,810,936
社債券	15,093,568,000
未収利息	1,391,239,116
前払費用	81,842,183
流動資産合計	457,911,692,752
資産合計	
457,911,692,752	
負債の部	
流動負債	
未払金	577,085,000
未払解約金	42,117,000
流動負債合計	619,202,000
負債合計	
619,202,000	
純資産の部	
元本等	
元本	403,416,112,603
剰余金	
剰余金又は欠損金()	53,876,378,149
元本等合計	457,292,490,752
純資産合計	457,292,490,752
負債純資産合計	457,911,692,752

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2月26日 至 2026年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年2月25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	405,709,777,585円
同期中追加設定元本額	225,278,497,623円
同期中一部解約元本額	227,572,162,605円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	35,690,760,880円
たわらノーロード 国内債券	21,399,075,689円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	12,741,994,746円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,177,945,924円
たわらノーロード バランス（標準型）	5,564,944,134円
たわらノーロード バランス（積極型）	980,108,473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）	207,238,313円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	3,109,294,702円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	4,019,134,714円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	1,039,191,897円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	70,111,212円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	31,750,271円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	284,843,246円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	29,713,467円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	17,119,374円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	25,806,163円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C年金>	11,809,977,558円
Oneグローバルバランス	460,327,421円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け）	4,978,688円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け）	2,458,540円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け）	723,294円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け）	666,437円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1988～1992年生まれ向け）	74,145円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1993～1997年生まれ向け）	74,146円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1998～2002年生まれ向け）	76,704円

未来のわたし(ターゲット・イヤー/2003~2007年生まれ向け)	112,403円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	14,203,585,532円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	22,529,995,412円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	11,559,508,822円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,930,276,093円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	3,208,301,507円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	742,300,799円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	83,548,503円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,566,349,905円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,475,193円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	6,531,532,697円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	3,374,183,806円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	774,976,222円
投資のソムリエ	34,419,561,162円
クルーズコントロール	470,165,195円
投資のソムリエ<DC年金>	6,840,760,565円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	9,576,548,612円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	4,614,328,717円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	12,663,394,117円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	22,726,986,902円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	610,453,248円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	336,033,539円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	156,127,792円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,097,886,353円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	9,495,708,931円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,673,422,191円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,832,972,237円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	789,809,968円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	369,966,405円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	216,451,900円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	6,143,639,331円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	84,697,753円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	120,147,677円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	2,903,558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)	197,203,786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)	487,583,501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)	441,681,180円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	1,261,831,511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)	722,454,169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)	545,919,849円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	983,356,487円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	1,324,690,368円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,740,296,804円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	892,585,947円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	443,616,366円

D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	242,503,395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)	863,897,742円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	23,942,182円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	92,421,116円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	106,728,585円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,896,835円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,302,824円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	30,114,923円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	502,151円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,875,055,268円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,150,879,047円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,707,688,243円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	50,142,544円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	130,335,363円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,047,285,109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)	76,593,490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)	705,124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)	991,276,326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)	28,862,571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)	151,273,769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)	232,277,642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)	352,740,023円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	177,019,061円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	49,787,741円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	456,244,779円
動的パッケージファンド<DC年金>	364,076,281円
コア資産形成ファンド	127,131,157円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	11,609,030,003円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	35,375,789,192円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	30,393,746,204円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	163,834,729円
計	403,416,112,603円
2. 受益権の総数	403,416,112,603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2月26日 至 2026年2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会はこれらの運用リスクの管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。またリスク管理担当部署等では、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2026年2月25日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,903,669,200	
地方債証券	103,318,136	
特殊債証券	101,040,253	
社債証券	62,432,000	
合計	3,170,459,589	

(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2月25日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2026年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1336円 (11,336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2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	470回 利付国庫債券(2年)	1,300,000,000	1,297,335,000	
	472回 利付国庫債券(2年)	1,800,000,000	1,792,674,000	
	473回 利付国庫債券(2年)	2,100,000,000	2,092,545,000	
	474回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,392,398,000	
	475回 利付国庫債券(2年)	2,200,000,000	2,193,026,000	
	476回 利付国庫債券(2年)	2,800,000,000	2,789,780,000	
	477回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	1,994,980,000	
	478回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,393,064,000	
	151回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,582,880,000	
	152回 利付国庫債券(5年)	1,290,000,000	1,277,474,100	
	153回 利付国庫債券(5年)	5,100,000,000	5,028,396,000	
	154回 利付国庫債券(5年)	2,700,000,000	2,656,206,000	
	155回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,476,285,000	
	156回 利付国庫債券(5年)	3,100,000,000	3,045,502,000	
	157回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,665,303,000	
	158回 利付国庫債券(5年)	3,600,000,000	3,519,288,000	
	159回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,851,094,000	
	160回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,464,765,000	

161回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,132,000,000	
162回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,048,886,000	
163回 利付国庫債券(5年)	4,850,000,000	4,744,027,500	
164回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,066,571,000	
165回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,166,940,000	
166回 利付国庫債券(5年)	2,850,000,000	2,779,234,500	
167回 利付国庫債券(5年)	1,800,000,000	1,749,222,000	
168回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,075,591,000	
169回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	2,924,610,000	
170回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,559,728,000	
172回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,040,171,000	
173回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,068,848,000	
174回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,145,154,000	
175回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,077,736,000	
176回 利付国庫債券(5年)	700,000,000	688,485,000	
177回 利付国庫債券(5年)	600,000,000	592,302,000	
178回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,139,360,000	
179回 利付国庫債券(5年)	2,300,000,000	2,250,228,000	
180回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,456,500,000	
181回 利付国庫債券(5年)	3,340,000,000	3,302,992,800	
182回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,092,729,000	
183回 利付国庫債券(5年)	300,000,000	300,267,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	97,236,700	
2回 利付国庫債券(40年)	330,000,000	276,490,500	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	445,111,200	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	583,732,800	
5回 利付国庫債券(40年)	710,000,000	540,182,200	
6回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	692,479,200	
7回 利付国庫債券(40年)	1,030,000,000	718,219,000	

8回 利付国庫債券(40年)	890,000,000	567,205,900	
9回 利付国庫債券(40年)	1,800,000,000	799,362,000	
10回 利付国庫債券(40年)	1,430,000,000	757,714,100	
11回 利付国庫債券(40年)	1,180,000,000	591,817,200	
12回 利付国庫債券(40年)	1,420,000,000	613,014,000	
13回 利付国庫債券(40年)	1,820,000,000	778,177,400	
14回 利付国庫債券(40年)	1,720,000,000	785,592,800	
15回 利付国庫債券(40年)	1,870,000,000	945,397,200	
16回 利付国庫債券(40年)	2,040,000,000	1,125,284,400	
17回 利付国庫債券(40年)	2,200,000,000	1,594,054,000	
18回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	913,640,000	
1回 CT利付国庫債券(10年)	500,000,000	455,765,000	
2回 CT利付国庫債券(10年)	500,000,000	464,805,000	
346回 利付国庫債券(10年)	2,140,000,000	2,119,220,600	
347回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,442,355,000	
348回 利付国庫債券(10年)	4,370,000,000	4,299,118,600	
349回 利付国庫債券(10年)	3,050,000,000	2,990,952,000	
350回 利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,030,498,000	
351回 利付国庫債券(10年)	4,400,000,000	4,286,744,000	
352回 利付国庫債券(10年)	3,370,000,000	3,271,259,000	
353回 利付国庫債券(10年)	3,690,000,000	3,567,861,000	
354回 利付国庫債券(10年)	2,660,000,000	2,561,127,800	
355回 利付国庫債券(10年)	3,340,000,000	3,202,024,600	
356回 利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,244,960,000	
357回 利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,135,594,000	
358回 利付国庫債券(10年)	3,750,000,000	3,546,337,500	

359回 利付国庫債券(10年)	3,850,000,000	3,622,850,000	
360回 利付国庫債券(10年)	3,800,000,000	3,559,042,000	
361回 利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	3,634,449,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,210,000,000	3,904,311,900	
363回 利付国庫債券(10年)	3,170,000,000	2,924,990,700	
364回 利付国庫債券(10年)	3,910,000,000	3,589,223,600	
365回 利付国庫債券(10年)	4,190,000,000	3,826,182,300	
366回 利付国庫債券(10年)	4,780,000,000	4,369,254,600	
367回 利付国庫債券(10年)	4,400,000,000	4,000,920,000	
368回 利付国庫債券(10年)	4,350,000,000	3,933,313,500	
369回 利付国庫債券(10年)	4,420,000,000	4,058,930,200	
370回 利付国庫債券(10年)	4,430,000,000	4,050,216,100	
371回 利付国庫債券(10年)	4,900,000,000	4,422,397,000	
372回 利付国庫債券(10年)	3,900,000,000	3,609,099,000	
373回 利付国庫債券(10年)	4,810,000,000	4,360,794,100	
374回 利付国庫債券(10年)	4,900,000,000	4,490,262,000	
375回 利付国庫債券(10年)	4,780,000,000	4,467,005,600	
376回 利付国庫債券(10年)	4,620,000,000	4,226,745,600	
377回 利付国庫債券(10年)	4,830,000,000	4,513,393,500	
378回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,545,936,000	
379回 利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,094,245,000	
380回 利付国庫債券(10年)	4,440,000,000	4,286,598,000	
381回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	598,296,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	115,266,800	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	103,597,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	212,088,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	208,016,000	

11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	247,822,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	233,891,600	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	151,174,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	352,005,400	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	270,808,200	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	249,777,600	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	278,405,100	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	408,420,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	285,471,200	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	341,328,900	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	314,532,200	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	298,763,800	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	359,884,000	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	331,577,400	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	627,402,800	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	630,174,200	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	779,016,700	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	855,863,400	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	861,396,800	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	692,157,600	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	937,621,400	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,090,792,000	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,130,304,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	965,458,600	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,238,959,500	

37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,201,764,000	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	733,652,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,110,000,000	969,207,600	
40回 利付国庫債券(30年)	530,000,000	453,446,800	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	887,654,600	
42回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	833,080,000	
43回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	588,724,900	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	933,142,700	
45回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	992,862,500	
46回 利付国庫債券(30年)	540,000,000	426,265,200	
47回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,071,933,000	
48回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,127,225,400	
49回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	991,601,000	
50回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	835,975,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	953,596,800	
52回 利付国庫債券(30年)	1,350,000,000	828,076,500	
53回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	698,196,800	
54回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	713,955,000	
55回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	696,006,000	
56回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	729,463,200	
57回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	717,538,700	
58回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	920,019,000	
59回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	438,573,600	
60回 利付国庫債券(30年)	930,000,000	591,582,300	
61回 利付国庫債券(30年)	960,000,000	575,577,600	

62回 利付国庫債券(30年)	920,000,000	517,297,600	
63回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	676,150,000	
64回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	482,112,000	
65回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	424,416,000	
66回 利付国庫債券(30年)	890,000,000	467,908,600	
67回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	752,936,800	
68回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	570,762,400	
69回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	706,557,600	
70回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	666,840,000	
71回 利付国庫債券(30年)	1,230,000,000	676,905,900	
72回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	703,475,700	
73回 利付国庫債券(30年)	1,390,000,000	751,600,800	
74回 利付国庫債券(30年)	1,170,000,000	688,743,900	
75回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,032,782,400	
76回 利付国庫債券(30年)	1,420,000,000	926,592,600	
77回 利付国庫債券(30年)	1,580,000,000	1,083,090,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	908,110,000	
79回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	886,501,000	
80回 利付国庫債券(30年)	1,280,000,000	916,825,600	
81回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	950,726,000	
82回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	934,527,800	
83回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,332,647,000	
84回 利付国庫債券(30年)	1,910,000,000	1,460,252,300	
85回 利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,120,406,000	
86回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	327,180,000	

87回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	534,588,000	
88回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,158,624,000	
89回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	100,296,000	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	373,799,900	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	677,584,400	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	558,679,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	121,582,800	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	670,698,600	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	162,347,200	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	762,315,000	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	846,766,000	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	235,570,600	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	513,265,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	163,884,800	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	112,163,700	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	653,433,600	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	511,735,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	613,194,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	701,329,800	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	355,813,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	449,961,600	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	472,171,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	757,116,200	
113回 利付国庫債券(20年)	2,270,000,000	2,323,549,300	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	544,924,800	

117回 利付国庫債券(20年)	1,870,000,000	1,915,497,100	
118回 利付国庫債券(20年)	955,000,000	974,138,200	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	475,517,800	
120回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	501,720,000	
121回 利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,055,964,000	
122回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	879,456,900	
123回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,484,713,000	
125回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	926,145,000	
126回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	927,690,400	
127回 利付国庫債券(20年)	840,000,000	852,188,400	
128回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	202,788,000	
130回 利付国庫債券(20年)	1,110,000,000	1,119,046,500	
131回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,103,080,000	
132回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	530,837,400	
133回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	130,929,500	
134回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	905,193,000	
135回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	130,000,000	
136回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	556,768,800	
137回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	479,452,800	
138回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,046,421,400	
139回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	675,348,800	
140回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	946,922,000	
141回 利付国庫債券(20年)	1,560,000,000	1,552,402,800	
142回 利付国庫債券(20年)	730,000,000	731,102,300	
143回 利付国庫債券(20年)	2,130,000,000	2,102,650,800	

144回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,029,294,000	
145回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,933,015,500	
146回 利付国庫債券(20年)	2,040,000,000	2,017,009,200	
147回 利付国庫債券(20年)	1,290,000,000	1,262,806,800	
148回 利付国庫債券(20年)	1,730,000,000	1,675,176,300	
149回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,209,964,500	
150回 利付国庫債券(20年)	2,230,000,000	2,127,486,900	
151回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	616,737,000	
152回 利付国庫債券(20年)	1,640,000,000	1,525,888,800	
153回 利付国庫債券(20年)	2,660,000,000	2,487,445,800	
154回 利付国庫債券(20年)	2,420,000,000	2,232,304,800	
155回 利付国庫債券(20年)	2,480,000,000	2,232,595,200	
156回 利付国庫債券(20年)	1,680,000,000	1,413,434,400	
157回 利付国庫債券(20年)	1,680,000,000	1,372,761,600	
158回 利付国庫債券(20年)	1,790,000,000	1,501,469,900	
159回 利付国庫債券(20年)	2,340,000,000	1,971,590,400	
160回 利付国庫債券(20年)	1,820,000,000	1,540,812,000	
161回 利付国庫債券(20年)	1,760,000,000	1,462,524,800	
162回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,592,462,300	
163回 利付国庫債券(20年)	1,930,000,000	1,581,133,200	
164回 利付国庫債券(20年)	2,270,000,000	1,823,105,100	
165回 利付国庫債券(20年)	1,670,000,000	1,331,106,900	
166回 利付国庫債券(20年)	1,660,000,000	1,348,517,600	
167回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,530,652,500	
168回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	1,535,820,000	

169回 利付国庫債券(20年)	1,820,000,000	1,366,164,800	
170回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,339,830,000	
171回 利付国庫債券(20年)	2,240,000,000	1,654,172,800	
172回 利付国庫債券(20年)	1,630,000,000	1,212,687,400	
173回 利付国庫債券(20年)	2,460,000,000	1,815,012,600	
174回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	1,676,302,900	
175回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	1,860,516,000	
176回 利付国庫債券(20年)	1,650,000,000	1,208,295,000	
177回 利付国庫債券(20年)	1,860,000,000	1,327,500,600	
178回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,369,140,000	
179回 利付国庫債券(20年)	1,810,000,000	1,294,131,900	
180回 利付国庫債券(20年)	1,940,000,000	1,452,225,800	
181回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,589,133,000	
182回 利付国庫債券(20年)	1,850,000,000	1,439,540,500	
183回 利付国庫債券(20年)	2,000,000,000	1,626,900,000	
184回 利付国庫債券(20年)	1,680,000,000	1,292,088,000	
185回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	1,605,114,000	
186回 利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	1,547,227,000	
187回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,407,960,000	
188回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,433,617,500	
189回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,371,712,000	
190回 利付国庫債券(20年)	1,630,000,000	1,369,020,700	
191回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,384,272,000	
192回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,471,088,000	
193回 利付国庫債券(20年)	1,630,000,000	1,518,263,500	

	194回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,312,843,600	
	195回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	102,997,000	
国債証券 合計		453,245,000,000	398,877,053,100	
地方債証券	783回 東京都公募公債	110,000,000	107,137,800	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	189,500,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	376,648,000	
	806回 東京都公募公債	100,000,000	93,568,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	278,754,000	
	816回 東京都公募公債	100,000,000	91,997,000	
	866回 東京都公募公債	300,000,000	287,052,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	202,944,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	87,200,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,238,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,248,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	185,792,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	388,828,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	386,264,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	92,425,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	232,482,500	
	237回 神奈川県公募公債	200,000,000	192,886,000	
	243回 神奈川県公募公債 10年	100,000,000	94,446,000	
	251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	185,142,000	
	258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	271,950,000	
	3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	101,740,000	
	11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	101,801,000	
	16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	305,088,000	
	19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	99,961,000	
	419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	98,855,000	
	464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	184,452,000	
	467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	184,394,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	183,410,000		

472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	182,072,000	
474回 大阪府公募公債 10年	300,000,000	272,439,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	197,776,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	90,907,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	82,813,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	106,817,596	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	376,208,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	185,382,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	189,264,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	92,260,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	95,263,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	299,670,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	98,340,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	99,267,000	
10回 兵庫県公募公債 20年	100,000,000	102,417,000	
令和元年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	189,568,000	
令和2年度10回 静岡県公募公債	100,000,000	93,207,000	
令和2年度14回 静岡県公募公債	200,000,000	184,594,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	100,237,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	99,928,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	193,198,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	307,035,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	305,133,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	89,191,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	191,540,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	116,001,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	191,830,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	151,935,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	97,134,000	
令和2年7回 広島県公募公債	200,000,000	185,288,000	

27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	63,142,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	72,153,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	188,890,000	
令和3年度第8回 埼玉県公募公債	100,000,000	91,023,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	129,592,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	153,912,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	102,065,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	97,438,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	287,427,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	91,643,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	193,230,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	190,398,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	93,031,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	100,048,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	103,302,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	101,706,000	
21年度2回 福岡県公募公債(20年)	100,000,000	102,380,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	295,365,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	182,202,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	94,465,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	91,162,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	81,619,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	184,772,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	95,526,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	494,410,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	393,800,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,235,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,944,000	

179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	489,280,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,617,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	286,785,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	475,595,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	94,147,000	
222回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	273,456,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	455,145,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	453,035,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	96,608,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	185,690,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	196,504,000	
令和2年2回 大阪市公募公債	300,000,000	281,472,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	204,278,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	187,806,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	95,474,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	91,485,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	203,930,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	197,242,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	291,447,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	104,296,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	378,632,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	102,318,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	101,760,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	95,621,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	90,177,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	243,204,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	193,956,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	204,418,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	89,562,000	

6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	101,652,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	303,867,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	95,519,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	93,742,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	158,998,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	73,099,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	162,918,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	293,508,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	79,835,000	
令和3年4回 千葉市公募公債	100,000,000	90,765,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	189,074,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	185,690,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	192,030,000	
地方債証券 合計	24,519,330,000	22,727,434,896	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	198,306,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	195,836,000	
78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	296,640,000	
125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	357,865,000	
131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	52,869,000	
156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	363,028,000	
64回 政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	93,595,000	
1回 高速道路機構債	300,000,000	289,608,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	135,291,000	
26回 高速道路機構債	200,000,000	202,328,000	
36回 高速道路機構債	300,000,000	270,564,000	
50回 高速道路機構債	300,000,000	227,496,000	
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,602,000	
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	95,754,000	
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	91,897,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	76,989,000	
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	66,804,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	70,266,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	161,392,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	78,902,000	

97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,971,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	88,698,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	502,635,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,027,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,360,000	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	275,115,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	92,131,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	149,498,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	449,455,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	72,572,000	
272回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	166,786,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	162,450,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	790,352,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	164,160,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	80,461,000	
387回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	189,900,000	
398回 政保道路債	300,000,000	151,608,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	83,672,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	101,004,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	102,054,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	527,360,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	203,246,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	306,705,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	306,786,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	101,682,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,738,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	98,533,000	

24回 地方公共団体金融機構債券20年	200,000,000	197,040,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,208,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	277,056,000	
36回 地方公共団体金融機構債券20年	100,000,000	95,764,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	470,475,000	
42回 地方公共団体金融機構債券20年	300,000,000	270,567,000	
44回 地方公共団体金融機構債券20年	200,000,000	183,796,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	250,791,000	
59回 地方公共団体金融機構債券20年	100,000,000	82,267,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	493,530,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,535,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,967,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,971,000	
77回 地方公共団体金融機構債券20年	300,000,000	213,594,000	
10回 地方公共団体金融機構債券30年	300,000,000	150,606,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	201,360,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	98,461,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	193,398,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	105,998,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	203,672,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	354,319,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,165,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,127,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	212,082,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	90,569,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	294,183,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	293,460,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	78,890,000	

27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,792,000	11,858,153	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,935,000	75,124,585	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	111,328,000	111,767,745	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,066,000	15,975,869	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,855,000	13,894,071	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,150,000	16,015,470	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,128,000	16,924,690	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,872,000	20,311,169	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,118,000	49,608,518	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,315,000	22,293,569	
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,348,000	26,467,677	
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,832,000	26,869,117	
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,266,000	29,642,451	
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,540,000	30,123,615	
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,600,000	33,466,200	
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,635,000	37,328,221	
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,741,000	39,049,944	
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,682,000	138,464,500	
117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,535,000	47,401,171	
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,015,000	47,109,904	
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,543,000	47,441,480	
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,789,000	146,455,651	
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,130,000	145,027,139	
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,304,000	99,360,772	
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,534,000	147,114,395	

	132回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	186,921,000	145,243,224	
	137回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	327,970,000	254,403,048	
	139回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	65,226,000	50,503,187	
	142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	67,327,000	51,340,203	
	154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	220,071,000	165,273,321	
	156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	291,976,000	219,811,211	
	160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	226,227,000	168,066,300	
	168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	229,710,000	170,545,892	
	170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	699,426,000	516,679,974	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	98,629,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	196,988,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	293,268,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	96,285,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	183,836,000	
	特殊債券 合計	21,311,907,000	18,601,810,936	
社債券	25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 017)	300,000,000	294,693,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	72,308,000	
	39回 成田国際空港社債	100,000,000	83,042,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	189,090,000	
	114回 中日本高速道路債券	200,000,000	196,060,000	
	103回 西日本高速道路債券	200,000,000	196,552,000	
	25回 アサヒグループホール ディングス社債	200,000,000	194,016,000	
	3回 ダイドーグループHD社 債	300,000,000	280,134,000	
	9回 野村不動産ホールディン グス社債	100,000,000	83,774,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	295,839,000	
	23回 三菱ケミカルホール ディングス社債	200,000,000	163,892,000	
	17回 ダイセル社債	300,000,000	278,334,000	
	16回 武田薬品工業社債	500,000,000	449,840,000	
	4回 ENEOSホールディン グス社債	300,000,000	274,362,000	
	14回 プリチストン社債	300,000,000	287,922,000	
	19回 パナソニック社債	100,000,000	93,846,000	
	23回 パナソニック社債	200,000,000	184,068,000	
	43回 ソニー社債	100,000,000	94,671,000	

58回 川崎重工業社債	300,000,000	272,082,000	
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	96,924,000	
18回 本田技研工業社債	100,000,000	100,132,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	79,643,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	381,992,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	101,135,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	100,667,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	293,316,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	372,268,000	
22回 NTTファイナンス社債	100,000,000	90,327,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,139,000	
115回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	97,908,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	188,936,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	277,128,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	95,914,000	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	186,734,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	293,940,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	197,720,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	98,665,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	77,113,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	101,607,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,337,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	202,188,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	73,949,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	64,036,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	79,508,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,025,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	45,783,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	141,804,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	103,126,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,918,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	187,562,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	54,229,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	46,632,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,903,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	141,618,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	101,417,000	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	45,098,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	283,353,000	

6回	横浜高速鉄道社債	200,000,000	186,508,000	
12回	ソフトバンク社債	400,000,000	387,064,000	
30回	光通信社債	200,000,000	183,728,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	79,645,000	
532回	中部電力社債	200,000,000	190,040,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	296,925,000	
530回	関西電力社債	400,000,000	383,020,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	147,008,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	272,781,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	182,260,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	93,523,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	99,045,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	376,368,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	195,874,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	271,377,000	
320回	四国電力社債	300,000,000	272,085,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	77,498,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	76,356,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	275,157,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	69,304,000	
507回	九州電力社債	200,000,000	182,018,000	
340回	北海道電力社債	300,000,000	296,976,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	154,714,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	98,118,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	181,142,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	162,560,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	74,182,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	71,109,000	
57回	東京瓦斯社債	300,000,000	129,288,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	195,182,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	159,494,000	
社債券 合計		16,900,000,000	15,093,568,000	
合計			455,299,866,932	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2026年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,145,712,281
コール・ローン	702,399,738
国債証券	307,367,995,487
派生商品評価勘定	6,854
未収利息	2,636,588,332
前払費用	207,034,854
流動資産合計	313,059,737,546
資産合計	313,059,737,546
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,580,825
未払金	1,057,269,077
未払解約金	15,266,000
流動負債合計	1,080,115,902
負債合計	1,080,115,902
純資産の部	
元本等	
元本	114,884,298,933
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	197,095,322,711
元本等合計	311,979,621,644
純資産合計	311,979,621,644
負債純資産合計	313,059,737,546

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2月26日 至 2026年2月25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2月25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	114,176,423,318円
同期中追加設定元本額	42,183,450,785円
同期中一部解約元本額	41,475,575,170円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	9,048,877,161円
たわらノーロード 先進国債券	26,659,842,697円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,561,344,333円
たわらノーロード バランス（堅実型）	77,435,739円
たわらノーロード バランス（標準型）	559,455,714円
たわらノーロード バランス（積極型）	163,037,912円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	16,906,619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）	930,565,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,739,667,151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）	950,048,699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）	623,786,001円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,771,340円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	12,464,393円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	146,923,029円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	40,922,803円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	29,274,840円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	54,857,394円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	12,725,900円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	447,717円
D I A M外国債券インデックスファンド< D C 年金 >	6,912,344,964円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	4,021,551,369円
O n e グローバルバランス	209,706,897円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型	772,521,481円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型	2,608,980,983円
D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型	3,504,958,590円

DIAM DC バランス30インデックスファンド	360,518,765円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	840,298,768円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	917,683,100円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,221,019円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	940,871,130円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,205,553円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	156,797,134円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	176,543,663円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	324,428,213円
クルーズコントロール	391,119,377円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,130,824円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,398,560,190円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,123,327,142円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	174,341,663円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,031,823,264円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	3,067,435円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	28,919,129円
Oneパッシブ資産分散ファンド	729,064,021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)	302,919,829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)	323,434,226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)	316,845,344円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	839,900,055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)	709,327,344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)	362,251,956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)	583,994,066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)	883,100,081円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,897,286,941円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,322,652,730円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	4,209,924,082円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	31,056,085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)	572,574,574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)	155,988,926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)	180,239,164円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	9,229,665円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	16,660,545円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,075,429円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	52,637円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	692,158,406円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	982,194,365円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,984,375,768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)	35,159,501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)	76,754,747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）	584,137,376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）	117,620,285円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	148,101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）	104,346,029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）	97,905,737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）	118,914,941円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	22,672,127円
動的パッケージファンド<DC年金>	59,600,973円
コア資産形成ファンド	20,800,921円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジなし）<ラップ専用>	2,417,364,711円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジあり）<ラップ専用>	6,858,958,723円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,789,966,672円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	5,660,366,594円
計	114,884,298,933円
2. 受益権の総数	114,884,298,933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2月26日 至 2026年2月25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2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2026年2月25日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	43,293,105	
合計	43,293,105	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2026年2月25日から2026年2月25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2月25日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	373,849,000	-	381,422,740	7,573,740
オフショア・人民元	373,849,000	-	381,422,740	7,573,740
買建	415,200,000	-	415,199,769	231
アメリカ・ドル	259,456,000	-	259,461,995	5,995
イギリス・ポンド	29,772,000	-	29,772,424	424
カナダ・ドル	24,757,000	-	24,757,435	435
スウェーデン・クローナ	15,882,000	-	15,878,590	3,410
ユーロ	85,333,000	-	85,329,325	3,675
合計	789,049,000	-	796,622,509	7,573,971

(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。

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。

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2026年2月25日現在
1口当たり純資産額	2.7156円
(1万口当たり純資産額)	(27,156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2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,617,135.140	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,628,280.860	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,970,000.000	2,867,790.240	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,870,112.500	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,680,000.000	2,575,312.500	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,926,901.960	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,484,076.930	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	3,101,062.490	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,350,000.000	4,740,810.520	
		US T N/B 0.625 08/15/30	3,836,000.000	3,372,683.120	
		US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,712,312.500	
		US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,818,057.790	
		US T N/B 0.75 01/31/28	5,678,000.000	5,394,100.000	
		US T N/B 0.875 11/15/30	5,000,000.000	4,416,015.600	
		US T N/B 1.0 07/31/28	5,270,000.000	4,971,503.930	
		US T N/B 1.125 02/15/31	267,000.000	237,348.390	
		US T N/B 1.125 02/29/28	6,000,000.000	5,730,468.720	
		US T N/B 1.125 05/15/40	1,000,000.000	651,347.660	
		US T N/B 1.125 08/15/40	2,460,000.000	1,586,796.070	
		US T N/B 1.125 08/31/28	4,230,000.000	3,995,119.350	
		US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,406,241.580	
		US T N/B 1.25 04/30/28	2,700,000.000	2,576,074.210	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,380,000.000	2,171,692.940	
		US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,943,350.000	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,500,000.000	3,328,144.540			
US T N/B 1.25 08/15/31	6,360,000.000	5,605,371.110			
US T N/B 1.25 09/30/28	1,413,000.000	1,336,168.120			

US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,461,345.100	
US T N/B 1.375 11/15/31	1,000,000.000	881,367.190	
US T N/B 1.375 11/15/40	2,000,000.000	1,332,968.760	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,342,507.810	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,330,000.000	4,008,209.930	
US T N/B 1.5 11/30/28	3,500,000.000	3,320,761.710	
US T N/B 1.625 05/15/31	6,340,000.000	5,738,938.250	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,460,000.000	3,251,521.460	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,832,000.000	3,168,188.420	
US T N/B 1.75 01/31/29	6,400,000.000	6,096,249.980	
US T N/B 1.75 11/15/29	4,250,000.000	3,992,758.790	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,080,000.000	7,287,939.090	
US T N/B 1.875 02/15/41	3,100,000.000	2,221,162.100	
US T N/B 1.875 02/15/51	3,068,000.000	1,772,728.750	
US T N/B 1.875 02/28/27	1,810,000.000	1,779,843.820	
US T N/B 1.875 02/28/29	3,700,000.000	3,532,416.000	
US T N/B 1.875 11/15/51	4,370,000.000	2,497,215.990	
US T N/B 2.0 02/15/50	2,800,000.000	1,695,968.730	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,440,155.470	
US T N/B 2.0 11/15/41	2,850,000.000	2,041,479.470	
US T N/B 2.25 02/15/52	1,000,000.000	626,406.250	
US T N/B 2.25 05/15/41	3,420,000.000	2,579,294.520	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	4,165,551.570	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,570,000.000	1,742,178.890	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,940,000.000	1,900,549.180	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,203,705.850	
US T N/B 2.375 02/15/42	1,700,000.000	1,283,234.360	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,871,640.640	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,830,000.000	3,778,085.530	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,644,161.480	
US T N/B 2.375 05/15/51	4,760,000.000	3,094,743.740	
US T N/B 2.375 11/15/49	1,490,000.000	986,542.960	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,200,000.000	873,890.620	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,170,000.000	2,271,503.120	
US T N/B 2.5 03/31/27	3,000,000.000	2,966,601.540	
US T N/B 2.5 05/15/46	384,000.000	274,229.990	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,200,000.000	5,077,109.380	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,856,105.080	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,984,675.570	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,478,993.750	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,500,000.000	2,477,929.700	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,225,685.540	
US T N/B 2.75 07/31/27	4,120,000.000	4,077,673.420	
US T N/B 2.75 08/15/32	6,340,000.000	5,973,221.100	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,000,000.000	1,583,750.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,639,572.650	
US T N/B 2.75 11/15/42	2,056,000.000	1,619,581.880	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,648,916.000	
US T N/B 2.875 04/30/29	4,000,000.000	3,927,734.340	

US T N/B 2.875 05/15/28	4,060,000.000	4,010,201.580	
US T N/B 2.875 05/15/32	6,050,000.000	5,760,498.060	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,890,000.000	2,300,936.720	
US T N/B 2.875 05/15/52	8,329,000.000	5,995,253.250	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,962,016.420	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,470,000.000	1,133,278.120	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,580,000.000	1,200,244.520	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,826,000.000	5,284,283.870	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,028,492.170	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,010,000.000	2,280,898.050	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,080,000.000	1,715,106.240	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,019,049.610	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,250,627.340	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,510,000.000	1,911,227.720	
US T N/B 3.0 08/15/52	5,240,000.000	3,865,318.740	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,800,000.000	1,430,156.250	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,000,000.000	785,039.060	
US T N/B 3.125 02/15/42	3,060,000.000	2,578,289.040	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,277,117.180	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,209,942.580	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,590,000.000	1,292,620.300	
US T N/B 3.125 08/31/27	4,540,000.000	4,515,703.910	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	3,071,003.520	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,180,000.000	4,144,078.120	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,020,000.000	2,555,792.950	
US T N/B 3.25 05/15/42	1,560,000.000	1,331,088.280	
US T N/B 3.25 06/30/27	2,700,000.000	2,691,140.620	
US T N/B 3.25 06/30/29	3,500,000.000	3,473,544.920	
US T N/B 3.375 05/15/33	8,700,000.000	8,453,953.110	
US T N/B 3.375 08/15/42	2,920,000.000	2,526,655.470	
US T N/B 3.375 09/15/27	4,000,000.000	3,993,046.880	
US T N/B 3.375 09/15/28	1,000,000.000	998,007.810	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,650,000.000	2,966,480.480	
US T N/B 3.5 01/15/29	2,600,000.000	2,602,742.190	
US T N/B 3.5 01/31/28	5,680,000.000	5,683,882.780	
US T N/B 3.5 01/31/30	2,700,000.000	2,696,835.920	
US T N/B 3.5 02/15/33	8,250,000.000	8,096,762.670	
US T N/B 3.5 02/15/39	700,000.000	649,660.150	
US T N/B 3.5 04/30/28	4,500,000.000	4,504,218.750	
US T N/B 3.5 04/30/30	3,500,000.000	3,492,958.980	
US T N/B 3.5 09/30/29	3,500,000.000	3,498,632.830	
US T N/B 3.5 10/15/28	3,000,000.000	3,002,871.090	
US T N/B 3.5 11/15/28	7,800,000.000	7,807,007.830	
US T N/B 3.5 11/30/30	2,500,000.000	2,490,234.370	
US T N/B 3.5 12/15/28	1,500,000.000	1,501,582.030	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,435,036.710	
US T N/B 3.625 02/15/53	5,857,000.000	4,873,893.400	
US T N/B 3.625 03/31/28	3,500,000.000	3,511,621.070	
US T N/B 3.625 03/31/30	2,500,000.000	2,507,275.400	

US T N/B 3.625 05/15/53	4,210,000.000	3,499,891.380	
US T N/B 3.625 05/31/28	3,500,000.000	3,512,919.930	
US T N/B 3.625 08/15/28	4,500,000.000	4,518,808.600	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,300,375.770	
US T N/B 3.625 08/31/29	5,000,000.000	5,019,238.300	
US T N/B 3.625 08/31/30	2,800,000.000	2,805,250.000	
US T N/B 3.625 09/30/30	3,000,000.000	3,005,507.820	
US T N/B 3.625 09/30/31	2,500,000.000	2,494,238.270	
US T N/B 3.625 10/31/30	6,700,000.000	6,710,599.600	
US T N/B 3.625 12/31/30	3,700,000.000	3,704,625.000	
US T N/B 3.75 04/15/28	9,000,000.000	9,053,085.960	
US T N/B 3.75 05/15/28	1,000,000.000	1,006,191.410	
US T N/B 3.75 05/31/30	3,500,000.000	3,526,181.640	
US T N/B 3.75 06/30/30	3,200,000.000	3,223,812.510	
US T N/B 3.75 08/15/27	7,200,000.000	7,226,015.610	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,720,000.000	3,427,195.290	
US T N/B 3.75 08/31/31	2,000,000.000	2,008,437.500	
US T N/B 3.75 10/31/32	2,500,000.000	2,495,605.470	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,460,000.000	1,310,692.180	
US T N/B 3.75 12/31/28	4,000,000.000	4,031,171.870	
US T N/B 3.75 12/31/30	2,600,000.000	2,616,910.160	
US T N/B 3.875 02/15/43	2,000,000.000	1,840,390.610	
US T N/B 3.875 03/15/28	6,000,000.000	6,049,453.140	
US T N/B 3.875 04/30/30	2,500,000.000	2,531,054.700	
US T N/B 3.875 05/15/43	1,800,000.000	1,652,589.830	
US T N/B 3.875 06/15/28	3,000,000.000	3,028,417.980	
US T N/B 3.875 06/30/30	2,000,000.000	2,024,921.880	
US T N/B 3.875 07/15/28	6,000,000.000	6,057,304.680	
US T N/B 3.875 07/31/30	2,200,000.000	2,227,671.860	
US T N/B 3.875 08/15/33	7,900,000.000	7,916,509.730	
US T N/B 3.875 08/15/34	7,000,000.000	6,971,152.350	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,600,000.000	1,512,500.000	
US T N/B 3.875 08/31/32	6,500,000.000	6,541,386.730	
US T N/B 3.875 09/30/29	1,950,000.000	1,973,613.290	
US T N/B 3.875 09/30/32	2,000,000.000	2,012,148.440	
US T N/B 3.875 10/15/27	4,000,000.000	4,024,843.760	
US T N/B 3.875 11/30/27	4,300,000.000	4,329,226.580	
US T N/B 3.875 11/30/29	5,800,000.000	5,871,140.590	
US T N/B 3.875 12/31/27	4,600,000.000	4,633,242.170	
US T N/B 3.875 12/31/29	2,800,000.000	2,834,617.180	
US T N/B 3.875 12/31/32	1,700,000.000	1,708,500.000	
US T N/B 4.0 01/31/29	1,949,000.000	1,977,816.270	
US T N/B 4.0 01/31/31	2,000,000.000	2,035,273.440	
US T N/B 4.0 02/15/34	7,500,000.000	7,557,128.910	
US T N/B 4.0 02/29/28	4,700,000.000	4,748,468.750	
US T N/B 4.0 03/31/30	4,000,000.000	4,068,671.880	
US T N/B 4.0 04/30/32	6,000,000.000	6,089,296.860	
US T N/B 4.0 05/31/30	3,000,000.000	3,051,914.070	
US T N/B 4.0 06/30/28	3,500,000.000	3,543,750.000	

US T N/B 4.0 06/30/32	3,000,000.000	3,043,183.590	
US T N/B 4.0 07/31/29	2,400,000.000	2,438,859.380	
US T N/B 4.0 07/31/30	3,500,000.000	3,561,386.710	
US T N/B 4.0 07/31/32	5,000,000.000	5,069,921.900	
US T N/B 4.0 10/31/29	2,800,000.000	2,845,718.730	
US T N/B 4.0 11/15/35	4,015,000.000	4,006,217.180	
US T N/B 4.0 11/15/42	2,300,000.000	2,154,408.200	
US T N/B 4.0 11/15/52	4,760,000.000	4,240,769.510	
US T N/B 4.0 12/15/27	4,400,000.000	4,440,218.720	
US T N/B 4.125 02/29/32	3,000,000.000	3,066,093.750	
US T N/B 4.125 03/31/29	3,800,000.000	3,871,843.740	
US T N/B 4.125 03/31/31	2,200,000.000	2,251,003.890	
US T N/B 4.125 03/31/32	3,500,000.000	3,576,699.210	
US T N/B 4.125 05/31/32	4,800,000.000	4,903,218.760	
US T N/B 4.125 07/31/28	2,500,000.000	2,539,355.470	
US T N/B 4.125 07/31/31	8,500,000.000	8,696,894.510	
US T N/B 4.125 08/15/44	2,000,000.000	1,880,468.760	
US T N/B 4.125 08/31/30	4,000,000.000	4,090,000.000	
US T N/B 4.125 09/30/27	4,000,000.000	4,039,453.120	
US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,374,835.150	
US T N/B 4.125 10/31/29	4,000,000.000	4,083,046.880	
US T N/B 4.125 10/31/31	2,500,000.000	2,556,298.820	
US T N/B 4.125 11/15/27	8,000,000.000	8,085,468.720	
US T N/B 4.125 11/15/32	4,000,000.000	4,080,703.110	
US T N/B 4.125 11/30/29	4,000,000.000	4,083,671.880	
US T N/B 4.125 11/30/31	3,000,000.000	3,067,382.820	
US T N/B 4.25 01/15/28	5,500,000.000	5,577,880.880	
US T N/B 4.25 01/31/30	3,000,000.000	3,078,105.480	
US T N/B 4.25 02/15/28	4,300,000.000	4,363,996.080	
US T N/B 4.25 02/15/54	4,200,000.000	3,898,945.300	
US T N/B 4.25 02/28/29	3,930,000.000	4,016,813.070	
US T N/B 4.25 02/28/31	2,334,000.000	2,401,740.700	
US T N/B 4.25 03/15/27	3,850,000.000	3,878,183.840	
US T N/B 4.25 05/15/35	8,000,000.000	8,158,749.990	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	948,255.840	
US T N/B 4.25 06/30/29	4,200,000.000	4,300,078.100	
US T N/B 4.25 06/30/31	2,800,000.000	2,881,812.500	
US T N/B 4.25 08/15/35	9,500,000.000	9,681,093.750	
US T N/B 4.25 08/15/54	5,000,000.000	4,641,308.600	
US T N/B 4.25 11/15/34	3,100,000.000	3,167,025.360	
US T N/B 4.375 01/31/32	4,548,000.000	4,709,045.400	
US T N/B 4.375 02/15/38	500,000.000	512,324.220	
US T N/B 4.375 05/15/34	7,000,000.000	7,228,183.620	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,430,000.000	3,410,170.300	
US T N/B 4.375 07/15/27	3,500,000.000	3,541,152.330	
US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,953,828.120	
US T N/B 4.375 08/31/28	3,500,000.000	3,576,562.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	500,000.000	502,558.590	
US T N/B 4.375 11/30/28	4,690,000.000	4,801,937.110	

US T N/B 4.375 11/30/30	3,000,000.000	3,101,542.980	
US T N/B 4.375 12/31/29	3,800,000.000	3,914,890.640	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,102,000.000	2,194,126.700	
US T N/B 4.5 02/15/44	1,300,000.000	1,286,898.440	
US T N/B 4.5 04/15/27	4,300,000.000	4,346,023.410	
US T N/B 4.5 05/15/27	9,672,000.000	9,782,887.930	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,137,769.530	
US T N/B 4.5 05/31/29	2,700,000.000	2,783,847.660	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	999,753.110	
US T N/B 4.5 11/15/33	1,100,000.000	1,146,578.120	
US T N/B 4.5 11/15/54	4,500,000.000	4,356,035.140	
US T N/B 4.5 12/31/31	2,000,000.000	2,084,023.440	
US T N/B 4.625 02/15/35	8,200,000.000	8,602,792.930	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,390,000.000	1,430,994.130	
US T N/B 4.625 02/15/55	4,300,000.000	4,249,357.430	
US T N/B 4.625 04/30/29	3,000,000.000	3,102,187.500	
US T N/B 4.625 04/30/31	3,000,000.000	3,140,097.660	
US T N/B 4.625 05/15/44	2,000,000.000	2,008,437.500	
US T N/B 4.625 05/15/54	4,600,000.000	4,545,285.160	
US T N/B 4.625 05/31/31	2,000,000.000	2,093,945.320	
US T N/B 4.625 06/15/27	4,500,000.000	4,563,105.480	
US T N/B 4.625 09/30/28	4,300,000.000	4,423,876.930	
US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,131,367.180	
US T N/B 4.625 11/15/44	2,000,000.000	2,003,984.380	
US T N/B 4.625 11/15/45	700,000.000	699,398.430	
US T N/B 4.625 11/15/55	1,700,000.000	1,681,539.050	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,230,000.000	2,313,799.190	
US T N/B 4.75 02/15/45	2,000,000.000	2,034,843.760	
US T N/B 4.75 05/15/55	4,000,000.000	4,033,750.000	
US T N/B 4.75 08/15/55	6,100,000.000	6,154,804.710	
US T N/B 4.75 11/15/43	2,020,000.000	2,065,607.800	
US T N/B 4.75 11/15/53	4,100,000.000	4,131,230.460	
US T N/B 4.875 08/15/45	2,000,000.000	2,064,687.500	
US T N/B 4.875 10/31/28	4,000,000.000	4,143,203.120	
US T N/B 4.875 10/31/30	2,500,000.000	2,637,695.300	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	867,687.500	
US T N/B 5.0 05/15/45	1,000,000.000	1,049,316.410	
US T N/B 5.25 11/15/28	562,000.000	587,860.770	
US T N/B 5.375 02/15/31	5,860,000.000	6,328,571.100	
US T N/B 6.125 11/15/27	3,200,000.000	3,341,124.990	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,559,000.000	2,827,095.220	
アメリカ・ドル 小計	942,257,000.000 (146,831,908,310)	896,106,241.450 (139,640,235,604)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/31/28	2,190,000.000	2,059,685.180
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,690,000.000	2,228,820.110
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,990,000.000	1,710,497.690

UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,680,000.000	1,539,398.660	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,160,000.000	570,090.600	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,500,000.000	1,791,461.640	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,340,000.000	507,183.860	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,250,000.000	602,125.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,935,000.000	1,537,706.380	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,030,000.000	1,842,558.820	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,370,000.000	2,007,517.030	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	250,000.000	165,442.890	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	1,336,000.000	435,669.600	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,900,000.000	1,842,102.520	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,430,000.000	647,541.130	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,350,000.000	1,439,737.680	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,200,000.000	645,280.260	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	662,401.030	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,330,000.000	2,219,953.520	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	608,498.150	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	341,634.220	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,100,000.000	608,691.390	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,562,000.000	748,406.260	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,790,000.000	1,347,925.150	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	350,000.000	198,310.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,660,000.000	1,324,335.930	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,300,000.000	2,186,849.040	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,450,000.000	1,187,840.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	880,000.000	645,304.000	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	2,250,000.000	2,077,393.590	
UK TREASURY 3.75 03/07/27	1,700,000.000	1,703,349.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,370,000.000	1,105,453.000	

UK TREASURY 3.75 10/22/53	1,800,000.000	1,438,274.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,300,000.000	1,075,360.000	
UK TREASURY 4.0 05/22/29	800,000.000	807,740.400	
UK TREASURY 4.0 10/22/31	2,200,000.000	2,209,992.620	
UK TREASURY 4.0 10/22/63	1,720,000.000	1,409,196.000	
UK TREASURY 4.125 03/07/31	200,000.000	202,424.560	
UK TREASURY 4.125 07/22/29	2,100,000.000	2,129,579.340	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,561,000.000	2,528,988.930	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,470,000.000	2,516,656.810	
UK TREASURY 4.25 07/31/34	2,180,000.000	2,181,801.330	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,160,000.000	1,110,432.270	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,210,000.000	2,238,333.300	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,401,000.000	2,270,933.360	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,153,798.160	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,147,000.000	1,019,847.590	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	563,000.000	490,980.720	
UK TREASURY 4.375 01/31/40	1,300,000.000	1,254,405.030	
UK TREASURY 4.375 03/07/28	1,550,000.000	1,574,108.390	
UK TREASURY 4.375 03/07/30	1,900,000.000	1,944,409.460	
UK TREASURY 4.375 07/31/54	1,180,000.000	1,050,370.010	
UK TREASURY 4.5 03/07/35	1,227,000.000	1,244,822.050	
UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,850,000.000	1,886,626.300	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,050,000.000	2,090,349.530	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,245,000.000	1,191,525.140	
UK TREASURY 4.625 01/31/34	2,200,000.000	2,265,119.330	
UK TREASURY 4.75 10/22/35	1,100,000.000	1,132,317.120	
UK TREASURY 4.75 10/22/43	1,350,000.000	1,319,254.300	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,595,000.000	1,666,038.110	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,430,000.000	1,448,742.000	

	UK TREASURY 5.25 01/31/41	250,000.000	262,257.770	
	UK TREASURY 5.375 01/31/56	700,000.000	730,478.140	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,180,000.000	1,257,101.430	
イギリス・ボンド 小計		101,052,000.000 (21,261,340,800)	85,641,426.830 (18,018,956,205)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 02/28/29	1,700,000.000	1,713,962.100	
	ISRAEL FIXED BOND 03/30/35	2,600,000.000	2,654,433.600	
	ISRAEL FIXED BOND 07/31/28	400,000.000	405,869.200	
	ISRAEL FIXED BOND 08/31/29	700,000.000	725,984.700	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,410,000.000	2,187,879.940	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	3,230,000.000	2,830,365.020	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,440,000.000	2,705,876.480	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	1,580,000.000	1,198,823.420	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,510,000.000	2,472,093.980	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	3,810,000.000	3,699,186.150	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,705,454.400	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27	300,000.000	301,413.600	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,874,000.000	2,197,997.730	
	イスラエル・シュケル 小計		26,364,000.000 (1,321,484,954)	24,799,340.320 (1,243,057,014)
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,500,000.000	1,245,075.000	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,370,000.000	1,174,336.600	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,950,000.000	2,444,517.500	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	360,000.000	311,821.200	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,490,000.000	768,020.500	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	3,828,000.000	3,227,004.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,080,000.000	1,035,406.800	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,060,000.000	1,919,384.400	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	737,337.600	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,350,000.000	1,155,843.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	830,000.000	810,262.600	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,600,000.000	1,540,080.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,750,000.000	2,607,962.500	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	792,920.500	

	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	120,000.000	107,970.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,400,000.000	2,330,496.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	550,000.000	464,073.500	
	AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,820,000.000	1,672,489.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	880,000.000	804,540.000	
	AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,940,000.000	1,829,109.600	
	AUSTRALIAN 4.25 03/21/36	2,700,000.000	2,604,825.000	
	AUSTRALIAN 4.25 06/21/34	1,950,000.000	1,904,331.000	
	AUSTRALIAN 4.25 10/21/36	200,000.000	192,130.000	
	AUSTRALIAN 4.25 12/21/35	1,427,000.000	1,378,795.940	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,660,116.200	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,240,000.000	1,248,184.000	
	AUSTRALIAN 4.75 06/21/54	800,000.000	747,624.000	
	オーストラリア・ドル 小計	40,905,000.000 (4,509,776,250)	36,714,656.440 (4,047,790,873)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28	9,000,000.000	9,010,360.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27	47,000,000.000	47,091,598.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30	46,000,000.000	45,954,894.240	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28	79,000,000.000	79,210,321.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28	57,000,000.000	57,181,020.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.49 12/25/31	14,000,000.000	13,915,180.440	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.55 07/25/30	10,000,000.000	10,039,356.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35	25,000,000.000	24,708,902.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27	47,440,000.000	47,651,103.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30	8,000,000.000	8,029,908.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.65 05/15/35	12,000,000.000	11,891,526.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 05/25/35	34,050,000.000	33,838,498.080	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.74 10/15/29	27,000,000.000	27,307,764.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32	8,000,000.000	8,065,121.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 11/15/35	6,000,000.000	5,990,510.640	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32	35,000,000.000	35,363,685.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 1.83 08/25/35	21,000,000.000	21,095,795.700	

CHINA GOVERNMENT BOND 1.85 05/15/27	10,000,000.000	10,065,638.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31	21,000,000.000	21,321,661.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29	36,000,000.000	36,590,299.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.92 01/15/55	8,510,000.000	7,885,483.690	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 11/25/34	8,000,000.000	8,191,696.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29	20,040,000.000	20,458,324.980	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34	31,000,000.000	31,954,614.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31	17,410,000.000	17,920,469.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34	31,590,000.000	32,932,205.390	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31	30,000,000.000	31,103,424.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34	26,000,000.000	27,269,216.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29	29,000,000.000	29,847,910.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	34,650,000.000	35,533,204.240	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,360,108.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	31,410,000.000	31,884,064.840	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33	25,000,000.000	26,503,500.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	17,000,000.000	17,828,523.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28	27,000,000.000	27,859,526.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	19,300,000.000	20,484,927.360	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	28,000,000.000	29,392,274.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28	24,000,000.000	24,689,544.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	31,000,000.000	32,516,882.700	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,775,719.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	19,500,000.000	20,867,250.300	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33	23,850,000.000	25,583,389.380	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	7,600,000.000	7,969,626.760	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	16,000,000.000	17,019,750.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,500,000.000	21,897,478.850	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	7,000,000.000	7,316,712.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,634,670.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	23,145,317.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,492,859.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,556,032.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	19,300,000.000	20,769,818.520	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	28,000,000.000	28,608,459.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	4,200,000.000	4,557,677.460	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	11,100,000.000	11,947,055.430	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	27,100,000.000	28,267,462.580	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53	20,400,000.000	23,433,800.280	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	22,000,000.000	22,875,564.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	28,000,000.000	30,255,139.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,545,003.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	10,800,000.000	12,759,338.160	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 11/22/28	37,000,000.000	39,107,249.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	9,000,000.000	9,813,294.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,224,447.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	25,000,000.000	26,676,610.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	15,820,000.000	19,016,304.440	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	16,100,000.000	19,326,464.150	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	10,450,000.000	12,978,988.820	

	CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,189,598.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	9,662,443.160	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	21,000,000.000	26,898,690.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	16,300,000.000	20,910,893.470	
	CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,300,000.000	13,550,385.420	
	オフショア・人民元 小計	1,547,820,000.000 (35,047,133,478)	1,618,572,544.030 (36,649,176,257)	
カナダ・ドル	CANADA 0.5 12/01/30	3,550,000.000	3,196,386.080	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,150,000.000	1,131,147.240	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,910,000.000	1,890,121.090	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,940,000.000	1,827,652.180	
	CANADA 1.5 06/01/31	3,070,000.000	2,874,756.830	
	CANADA 1.5 12/01/31	1,840,000.000	1,707,843.120	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,780,000.000	1,851,242.060	
	CANADA 2.0 06/01/28	3,030,000.000	2,998,690.400	
	CANADA 2.0 06/01/32	2,390,000.000	2,266,157.860	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,760,000.000	1,271,584.730	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,300,000.000	1,286,719.420	
	CANADA 2.25 12/01/29	900,000.000	887,925.250	
	CANADA 2.5 12/01/32	400,000.000	389,058.210	
	CANADA 2.75 03/01/30	1,750,000.000	1,755,019.250	
	CANADA 2.75 05/01/27	1,400,000.000	1,406,842.650	
	CANADA 2.75 06/01/33	500,000.000	492,327.320	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,055,798.880	
	CANADA 2.75 09/01/30	1,650,000.000	1,651,752.750	
	CANADA 2.75 12/01/48	500,000.000	432,667.650	
	CANADA 2.75 12/01/55	1,450,000.000	1,207,550.060	
	CANADA 2.75 12/01/64	480,000.000	388,915.350	
	CANADA 3.0 03/01/32	900,000.000	906,376.350	
	CANADA 3.0 06/01/34	2,749,000.000	2,736,792.140	
	CANADA 3.25 06/01/35	1,950,000.000	1,967,152.790	
	CANADA 3.25 09/01/28	500,000.000	508,968.590	
	CANADA 3.25 12/01/33	2,020,000.000	2,051,666.220	
	CANADA 3.25 12/01/34	1,070,000.000	1,082,252.540	
	CANADA 3.25 12/01/35	2,110,000.000	2,121,852.150	
	CANADA 3.5 03/01/28	3,130,000.000	3,194,032.090	
	CANADA 3.5 03/01/34	1,450,000.000	1,497,012.210	
	CANADA 3.5 09/01/29	1,300,000.000	1,338,038.890	
	CANADA 3.5 12/01/45	900,000.000	893,725.240	
	CANADA 3.5 12/01/57	1,150,000.000	1,111,878.700	
	CANADA 4.0 03/01/29	1,700,000.000	1,769,964.180	
	CANADA 4.0 06/01/41	197,000.000	210,090.630	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,650,000.000	1,916,783.350	
	CANADA 5.75 06/01/29	640,000.000	702,646.250	

	CANADA 5.75 06/01/33	1,010,000.000	1,190,780.650	
カナダ・ドル 小計		59,226,000.000 (6,736,365,240)	57,170,171.350 (6,502,535,289)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.625 07/01/31	1,360,000.000	1,360,679.850	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	710,000.000	683,730.020	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	540,000.000	516,240.030	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	630,000.000	648,666.900	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	600,000.000	623,999.920	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	240,000.000	246,359.970	
	SINGAPORE 2.625 08/01/32	550,000.000	580,634.940	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	470,000.000	522,557.750	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	830,680.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	648,209.910	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	204,641.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	520,000.000	550,022.200	
	SINGAPORE 3.0 04/01/29	320,000.000	334,719.960	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	153,000.000	186,507.030	
	SINGAPORE 3.25 06/01/54	160,000.000	197,516.800	
SINGAPORE 3.375 05/01/34	550,000.000	613,634.940		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	817,520.000		
シンガポール・ドル 小計		9,183,000.000 (1,129,417,170)	9,566,321.220 (1,176,561,847)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,220,000.000	3,791,991.760	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,090,000.000	3,990,474.410	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	6,160,000.000	5,876,476.750	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	5,150,000.000	4,898,830.500	
	SWEDEN 2.25 05/11/35	1,100,000.000	1,069,973.990	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,030,000.000	4,013,618.050	
	SWEDEN 2.5 10/15/36	3,300,000.000	3,243,619.500	
SWEDEN 3.5 03/30/39	4,050,000.000	4,359,237.750		
スウェーデン・クローナ 小計		32,100,000.000 (553,083,000)	31,244,222.710 (538,337,957)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	3,480,000.000	3,071,971.740	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,520,000.000	2,222,375.520	
	DENMARK 0.5 11/15/27	2,850,000.000	2,790,753.480	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,040,000.000	3,822,116.120	
	DENMARK 2.25 11/15/33	3,340,000.000	3,305,185.170	
	DENMARK 2.25 11/15/35	3,200,000.000	3,108,800.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	6,009,000.000	7,183,382.110	
デンマーク・クローネ 小計		27,439,000.000 (673,901,840)	25,504,584.140 (626,392,586)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	1,050,000.000	986,553.230	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	1,960,000.000	1,746,654.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	271,210.210	

	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,410,000.000	1,259,246.000	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	510,000.000	433,923.870	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	810,000.000	552,563.100	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	742,143.250	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	1,080,000.000	1,042,860.150	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	470,000.000	472,900.920	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/36	730,000.000	723,065.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	700,000.000	714,405.220	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/30	500,000.000	517,773.050	
	NEW ZEALAND 4.5 05/15/35	450,000.000	458,074.530	
	NEW ZEALAND 5.0 05/15/54	200,000.000	200,563.660	
	ニュージーランド・ドル 小計	11,020,000.000 (1,024,970,200)	10,121,936.190 (941,441,285)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,850,000.000	2,465,758.720	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,610,000.000	4,124,163.620	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,700,000.000	4,601,139.010	
	NORWAY 1.75 09/06/29	5,120,000.000	4,750,770.040	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,526,000.000	2,440,747.500	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,230,000.000	1,103,023.660	
	NORWAY 3.0 08/15/33	5,000,000.000	4,658,287.500	
	NORWAY 3.5 10/06/42	3,210,000.000	2,947,913.130	
	NORWAY 3.625 04/13/34	1,570,000.000	1,519,081.760	
	NORWAY 3.625 05/31/39	1,950,000.000	1,836,061.500	
	NORWAY 3.75 06/12/35	1,810,000.000	1,755,645.250	
	ノルウェー・クローネ 小計	34,576,000.000 (562,897,280)	32,202,591.690 (524,258,193)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 1.25 10/25/30	6,420,000.000	5,645,813.710	
	POLAND 1.75 04/25/32	3,250,000.000	2,789,101.390	
	POLAND 2.5 07/25/27	5,060,000.000	5,010,462.980	
	POLAND 2.75 04/25/28	4,760,000.000	4,695,592.020	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,925,549.330	
	POLAND 3.75 05/25/27	1,420,000.000	1,430,679.530	
	POLAND 4.5 01/25/31	2,200,000.000	2,226,847.700	
	POLAND 4.5 07/25/30	3,300,000.000	3,351,904.710	
	POLAND 4.75 07/25/29	3,220,000.000	3,312,270.380	
	POLAND 5.0 01/25/30	5,153,000.000	5,338,432.240	
	POLAND 5.0 10/25/34	3,250,000.000	3,292,442.400	
	POLAND 5.0 10/25/35	2,400,000.000	2,414,166.240	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,990,000.000	2,105,329.050	
	POLAND 6.0 10/25/33	4,862,000.000	5,278,986.990	
	POLAND 7.5 07/25/28	2,400,000.000	2,618,367.360	
	ポーランド・ズロチ 小計	51,685,000.000 (2,248,442,218)	51,435,946.030 (2,237,607,673)	

マレーシア・リングット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,000,000.000	1,929,555.550	
	MALAYSIA 3.476 07/02/35	900,000.000	897,550.570	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,250,000.000	1,258,570.000	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	3,100,000.000	3,126,731.300	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,029,738.200	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,400,000.000	1,389,714.500	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	2,270,000.000	2,319,828.530	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,698,446.260	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,100,000.000	1,125,168.880	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	661,000.000	670,896.620	
	MALAYSIA 4.054 04/18/39	1,050,000.000	1,080,047.430	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,480,000.000	1,495,482.720	
	MALAYSIA 4.18 05/16/44	700,000.000	722,120.700	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,070,000.000	2,155,982.820	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	900,000.000	949,945.950	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	1,720,000.000	1,848,435.660	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,256,401.080	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,590,000.000	1,654,384.180	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,900,000.000	2,044,751.120	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,160,000.000	1,277,314.280	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	800,000.000	885,321.920		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,500,000.000	3,850,501.200		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	500,000.000	556,753.450		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,240,000.000	1,412,586.670		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,805,979.520		
マレーシア・リングット 小計		37,751,000.000 (1,509,345,382)	39,442,209.110 (1,576,962,628)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 02/28/30	4,000,000.000	4,071,881.880	
	MEXICAN BONDS 03/01/29	41,823,000.000	42,796,175.610	
	MEXICAN BONDS 03/02/28	7,000,000.000	7,167,370.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	28,080,000.000	27,696,081.520	
	MEXICAN BONDS 04/15/32	4,000,000.000	3,914,078.280	
	MEXICAN BONDS 05/24/35	20,500,000.000	19,518,801.730	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,790,000.000	18,773,849.790	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	38,290,000.000	33,605,620.150	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	12,805,000.000	13,924,899.170	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	19,146,000.000	19,272,246.410	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	44,648,000.000	43,835,876.520	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	29,993,000.000	26,193,514.920	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	20,035,000.000	18,994,417.750	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	8,461,000.000	7,472,587.160	

	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	15,419,000.000	15,749,914.240	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	12,442,000.000	11,928,157.960	
メキシコ・ペソ	小計	326,432,000.000 (2,959,465,155)	314,915,473.090 (2,855,055,171)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,280,000.000	1,166,939.950	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,360,000.000	1,204,443.200	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	770,000.000	473,935.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	1,060,000.000	791,502.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,445,458.430	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	390,000.000	383,299.800	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	131,063.400	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,355,000.000	1,320,634.130	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	312,376.100	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	97,183.140	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,400,000.000	1,270,275.100	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	650,000.000	453,672.370	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	92,131.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	460,000.000	335,066.110	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	234,050.870	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,260,000.000	1,223,337.150	
	AUSTRIA 2.8 09/20/32	500,000.000	504,400.000	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,150,000.000	1,164,863.170	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34	450,000.000	453,420.000	
	AUSTRIA 2.9 05/23/29	400,000.000	408,376.800	
	AUSTRIA 2.95 02/20/35	200,000.000	200,660.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	526,189.120	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	420,000.000	381,885.000	
	AUSTRIA 3.2 02/20/36	600,000.000	609,780.000	
	AUSTRIA 3.2 07/15/39	700,000.000	695,730.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	480,000.000	490,428.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,113,077.360	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,115,000.000	1,178,427.320	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,030,000.000	996,179.690	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	740,000.000	640,651.650	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	1,600,000.000	1,449,760.000	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	908,460.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	681,000.000	438,757.390	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	470,000.000	147,308.570	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	260,000.000	255,975.420	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	909,074.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,240,000.000	1,186,595.960	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,440,000.000	1,330,596.090	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	1,260,000.000	1,138,193.910	
	BELGIUM 1.4 06/22/53	1,540,000.000	864,340.400	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	460,000.000	380,006.930	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	612,831.320	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	1,020,000.000	655,898.240	

BELGIUM 1.9 06/22/38	400,000.000	339,799.200	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	273,645.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	260,074.420	
BELGIUM 2.6 10/22/30	500,000.000	502,911.500	
BELGIUM 2.7 10/22/29	850,000.000	861,098.450	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	296,141.440	
BELGIUM 2.85 10/22/34	1,320,000.000	1,305,272.100	
BELGIUM 3.0 06/22/33	800,000.000	809,550.960	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,180,000.000	1,185,520.390	
BELGIUM 3.1 06/22/35	600,000.000	600,707.940	
BELGIUM 3.3 06/22/54	620,000.000	537,233.400	
BELGIUM 3.4 06/22/36	700,000.000	711,940.250	
BELGIUM 3.45 06/22/42	560,000.000	542,723.940	
BELGIUM 3.45 06/22/43	640,000.000	615,992.790	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	633,080.630	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,140,000.000	1,227,161.430	
BELGIUM 4.25 03/28/41	880,000.000	945,084.960	
BELGIUM 5.0 03/28/35	270,000.000	311,717.290	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,709,551.670	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	460,000.000	449,842.280	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,580,000.000	2,551,362.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,050,000.000	2,027,573.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,300,000.000	1,298,843.000	
BUNDESOBL 2.1 04/12/29	1,200,000.000	1,198,968.000	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,200,000.000	2,207,150.000	
BUNDESOBL 2.2 10/10/30	800,000.000	797,632.000	
BUNDESOBL 2.4 04/18/30	1,900,000.000	1,912,844.000	
BUNDESOBL 2.4 10/19/28	2,000,000.000	2,016,300.000	
BUNDESOBL 2.5 10/11/29	1,500,000.000	1,516,635.000	
BUNDESSCHAT 1.7 06/10/27	1,457,000.000	1,451,026.300	
BUNDESSCHAT 2.0 12/16/27	300,000.000	299,805.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,020,000.000	1,853,632.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,340,000.000	1,198,817.600	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,150,000.000	1,869,705.570	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,060,000.000	830,785.600	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,441,000.000	1,845,957.430	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,230,000.000	2,021,762.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,390,000.000	1,260,160.100	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	50,000.000	44,112.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,100,000.000	1,853,960.850	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,540,000.000	1,127,648.240	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,140,000.000	508,371.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,927,000.000	798,240.480	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,566,199.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	852,000.000	806,454.210	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	470,000.000	462,141.600	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,630,000.000	1,545,024.840	

DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	57,000.000	54,574.650	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	2,058,774.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	3,110,000.000	3,043,383.000	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,390,000.000	2,221,748.800	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	2,160,000.000	1,737,201.600	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,420,000.000	1,634,262.300	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,980,000.000	1,896,741.000	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	2,367,000.000	1,706,678.010	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	900,000.000	650,619.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	1,700,000.000	1,694,475.000	
DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34	1,500,000.000	1,460,955.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,150,000.000	3,115,381.500	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	1,927,000.000	1,904,955.120	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	2,100,000.000	2,111,802.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	1,000,000.000	989,470.000	
DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35	2,300,000.000	2,276,126.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,320,000.000	2,096,700.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	1,990,929.330	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54	1,860,000.000	1,566,306.000	
DEUTSCHLAND 2.5 11/15/32	1,600,000.000	1,603,824.000	
DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41	1,000,000.000	941,320.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33	900,000.000	904,797.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34	1,100,000.000	1,100,000.000	
DEUTSCHLAND 2.6 08/15/35	602,000.000	598,388.000	
DEUTSCHLAND 2.9 02/15/36	2,352,000.000	2,390,737.440	
DEUTSCHLAND 2.9 08/15/56	800,000.000	727,760.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,480,000.000	1,503,058.400	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,230,000.000	1,369,648.050	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,080,000.000	1,232,658.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,055,000.000	1,120,093.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,320,000.000	1,534,632.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	1,932,805.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,720,000.000	1,968,935.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,140,000.000	2,278,993.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,640,000.000	1,881,621.200	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,250,000.000	1,324,312.500	
FINLAND 0.0 09/15/30	110,000.000	98,675.500	
FINLAND 0.125 04/15/36	816,000.000	609,671.610	
FINLAND 0.125 04/15/52	660,000.000	268,877.400	
FINLAND 0.125 09/15/31	1,100,000.000	963,985.000	

FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	186,658.850	
FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	233,985.450	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	390,620.310	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	623,519.000	
FINLAND 0.5 09/15/29	715,000.000	671,835.130	
FINLAND 0.75 04/15/31	700,000.000	642,285.000	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	187,990.040	
FINLAND 1.5 09/15/32	750,000.000	698,733.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	400,000.000	360,108.120	
FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	353,646.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	324,868.480	
FINLAND 2.875 04/15/29	400,000.000	407,480.000	
FINLAND 2.95 04/15/55	91,000.000	77,914.200	
FINLAND 3.0 09/15/33	1,100,000.000	1,118,911.750	
FINLAND 3.0 09/15/35	400,000.000	401,280.000	
FINLAND 3.2 04/15/45	200,000.000	190,620.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	700,000.000	685,749.750	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,590,000.000	3,022,959.500	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,610,000.000	3,302,934.390	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,980,000.000	3,532,294.750	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,870,000.000	1,604,359.020	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,386,820.360	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,550,000.000	1,006,539.770	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	1,790,000.000	483,975.720	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	3,990,000.000	2,234,361.080	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	5,680,000.000	5,525,084.540	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,543,423.430	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,000,000.000	459,910.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,156,000.000	516,021.060	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,000,000.000	3,840,520.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	860,000.000	848,622.630	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,010,000.000	1,744,258.900	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,590,000.000	2,946,313.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	3,700,000.000	2,863,430.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,280,000.000	4,047,250.370	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,620,000.000	1,579,511.540	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,240,000.000	1,175,046.870	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	3,050,000.000	2,458,803.990	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,369,360.670	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	2,650,000.000	2,511,807.800	
FRANCE OAT 2.4 09/24/28	1,500,000.000	1,505,812.500	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,650,000.000	3,654,515.050	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	2,150,000.000	1,787,828.200	
FRANCE OAT 2.5 09/24/27	4,300,000.000	4,324,501.830	
FRANCE OAT 2.7 02/25/31	4,200,000.000	4,220,259.540	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,710,000.000	3,758,137.250	
FRANCE OAT 2.75 02/25/30	4,300,000.000	4,348,984.310	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,840,000.000	4,888,914.000	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,400,000.000	3,414,186.500	

FRANCE OAT 3.0 05/25/54	1,550,000.000	1,243,612.270	
FRANCE OAT 3.0 06/25/49	500,000.000	420,778.120	
FRANCE OAT 3.0 11/25/34	3,200,000.000	3,165,640.000	
FRANCE OAT 3.2 05/25/35	2,600,000.000	2,599,005.500	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	996,000.000	907,699.120	
FRANCE OAT 3.25 05/25/55	1,300,000.000	1,089,333.370	
FRANCE OAT 3.5 11/25/33	4,300,000.000	4,444,069.350	
FRANCE OAT 3.5 11/25/35	600,000.000	611,340.000	
FRANCE OAT 3.6 05/25/42	1,300,000.000	1,268,540.000	
FRANCE OAT 3.75 05/25/56	1,600,000.000	1,466,105.600	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,479,515.350	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,060,000.000	1,964,987.770	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,340,000.000	1,403,928.720	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,190,000.000	1,299,714.430	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,968,000.000	3,334,441.150	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	3,835,970.940	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,110,000.000	3,657,294.690	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	410,975.880	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	317,343.600	
IRISH 0.4 05/15/35	520,000.000	416,919.720	
IRISH 0.55 04/22/41	390,000.000	264,762.600	
IRISH 0.9 05/15/28	810,000.000	789,879.600	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	705,574.200	
IRISH 1.3 05/15/33	190,000.000	173,617.820	
IRISH 1.35 03/18/31	540,000.000	514,865.700	
IRISH 1.5 05/15/50	550,000.000	371,979.010	
IRISH 1.7 05/15/37	780,000.000	681,982.240	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	680,098.830	
IRISH 2.4 05/15/30	970,000.000	973,412.830	
IRISH 2.6 10/18/34	671,000.000	661,087.480	
IRISH 3.0 10/18/43	280,000.000	267,874.600	
IRISH 3.15 10/18/55	200,000.000	183,080.500	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,404,812.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,900,000.000	1,800,060.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,520,000.000	1,361,897.580	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,510,000.000	1,387,002.950	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	2,986,000.000	2,319,524.800	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	900,000.000	805,320.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,261,980.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,880,000.000	1,847,476.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	2,000,000.000	1,812,370.000	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,900,000.000	1,880,050.000	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,850,000.000	1,771,380.550	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	923,000.000	779,196.600	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,210,000.000	818,807.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,990,000.000	1,868,800.510	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	940,000.000	901,664.600	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,170,000.000	726,894.090	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	896,540.000	

ITALY BTPS 2.0 02/01/28	960,000.000	957,937.200	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,699,778.150	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	860,000.000	527,524.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,060,000.000	724,192.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,590,000.000	2,595,957.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	750,000.000	679,500.000	
ITALY BTPS 2.35 01/15/29	200,000.000	200,300.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	980,000.000	946,946.060	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,180,000.000	883,820.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	800,000.000	782,400.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,520,000.000	1,533,680.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	550,000.000	450,615.000	
ITALY BTPS 2.7 10/01/30	600,000.000	603,660.000	
ITALY BTPS 2.7 10/15/27	1,500,000.000	1,513,650.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	500,000.000	368,100.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,800,000.000	1,825,380.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,970,253.710	
ITALY BTPS 2.85 02/01/31	300,000.000	303,180.000	
ITALY BTPS 2.95 02/15/27	453,000.000	456,701.010	
ITALY BTPS 2.95 07/01/30	1,200,000.000	1,221,240.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	720,000.000	676,440.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,710,000.000	1,746,965.920	
ITALY BTPS 3.0 10/01/29	1,000,000.000	1,019,800.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,560,000.000	1,469,598.000	
ITALY BTPS 3.15 11/15/31	1,400,000.000	1,430,940.000	
ITALY BTPS 3.25 07/15/32	1,600,000.000	1,638,080.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,242,952.530	
ITALY BTPS 3.25 11/15/32	1,800,000.000	1,839,420.000	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	2,020,000.000	2,052,502.810	
ITALY BTPS 3.35 07/01/29	1,400,000.000	1,443,540.000	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	2,050,000.000	2,101,455.000	
ITALY BTPS 3.45 02/01/36	500,000.000	506,850.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,140,000.000	1,048,568.580	
ITALY BTPS 3.45 07/15/27	1,200,000.000	1,221,600.000	
ITALY BTPS 3.45 07/15/31	1,600,000.000	1,660,960.000	
ITALY BTPS 3.5 02/15/31	1,400,000.000	1,457,260.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,300,000.000	2,393,457.050	
ITALY BTPS 3.6 10/01/35	2,000,000.000	2,058,000.000	
ITALY BTPS 3.65 08/01/35	1,900,000.000	1,964,600.000	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,700,000.000	1,781,940.000	
ITALY BTPS 3.8 08/01/28	300,000.000	311,190.000	
ITALY BTPS 3.85 02/01/35	1,000,000.000	1,052,800.000	
ITALY BTPS 3.85 07/01/34	1,280,000.000	1,350,400.000	
ITALY BTPS 3.85 10/01/40	1,600,000.000	1,627,840.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	2,300,000.000	2,417,530.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,240,000.000	1,314,400.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,400,000.000	1,492,820.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,400,000.000	1,496,460.000	
ITALY BTPS 4.0 11/15/30	1,000,000.000	1,062,600.000	

ITALY BTPS 4.05 10/30/37	900,000.000	952,830.000	
ITALY BTPS 4.1 02/01/29	800,000.000	840,560.000	
ITALY BTPS 4.1 04/30/46	1,000,000.000	1,021,500.000	
ITALY BTPS 4.15 10/01/39	1,260,000.000	1,331,946.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	1,720,000.000	1,859,148.000	
ITALY BTPS 4.3 10/01/54	900,000.000	918,360.000	
ITALY BTPS 4.35 11/01/33	1,400,000.000	1,527,820.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,800,000.000	1,970,460.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	700,000.000	753,130.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	1,270,000.000	1,338,834.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,480,000.000	1,570,684.780	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,460,000.000	1,631,021.040	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	860,000.000	980,916.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,590,000.000	1,831,362.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,050,000.000	1,209,180.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,860,000.000	2,191,638.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,560,000.000	1,814,748.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,153,916.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,240,000.000	1,166,489.080	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	240,000.000	168,405.480	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,646,000.000	692,880.980	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,200,000.000	1,086,096.590	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,300,000.000	1,142,905.070	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,160,000.000	1,087,093.700	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,160,000.000	821,865.800	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	1,800,000.000	1,588,680.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,300,000.000	1,278,049.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	630,000.000	610,747.830	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	790,000.000	591,463.520	
NETHERLANDS 2.5 01/15/30	380,000.000	383,413.340	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,106,947.500	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	250,000.000	248,214.000	
NETHERLANDS 2.5 07/15/34	1,700,000.000	1,675,010.000	
NETHERLANDS 2.5 07/15/35	900,000.000	879,480.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,351,000.000	1,236,715.510	
NETHERLANDS 3.25 01/15/44	590,000.000	590,767.590	
NETHERLANDS 3.5 01/15/56	350,000.000	355,250.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	990,000.000	1,060,128.120	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,820,000.000	2,007,460.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	490,000.000	521,164.000	
PORTUGUESE 0.3 10/17/31	900,000.000	798,419.250	
PORTUGUESE 1.0 04/12/52	400,000.000	219,558.000	
PORTUGUESE 1.15 04/11/42	600,000.000	429,072.000	

PORTUGUESE 1.95 06/15/29	300,000.000	297,825.000	
PORTUGUESE 2.125 10/17/28	1,900,000.000	1,903,113.150	
PORTUGUESE 2.25 04/18/34	2,000,000.000	1,921,338.730	
PORTUGUESE 3.375 06/15/40	400,000.000	399,816.000	
PORTUGUESE 3.625 06/12/54	50,000.000	48,250.000	
PORTUGUESE 3.875 02/15/30	98,000.000	103,948.600	
PORTUGUESE 4.1 02/15/45	400,000.000	427,560.000	
PORTUGUESE 4.1 04/15/37	2,300,000.000	2,514,797.000	
PORTUGUESE 4.125 04/14/27	900,000.000	921,324.330	
SPAIN 0.0 01/31/28	2,880,000.000	2,768,256.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,700,000.000	2,501,734.950	
SPAIN 0.5 10/31/31	2,340,000.000	2,087,475.970	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,830,000.000	1,721,014.350	
SPAIN 0.7 04/30/32	2,150,000.000	1,915,225.370	
SPAIN 0.8 07/30/27	2,400,000.000	2,356,392.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,615,340.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,234,831.190	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,640,000.000	1,118,972.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,499,000.000	827,176.980	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,420,000.000	1,050,258.610	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,000,000.000	1,895,600.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,470,000.000	1,448,100.670	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,470,000.000	1,443,687.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,150,000.000	1,122,789.850	
SPAIN 1.45 10/31/27	842,000.000	833,521.900	
SPAIN 1.45 10/31/71	660,000.000	317,459.660	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,060,000.000	2,046,404.000	
SPAIN 1.85 07/30/35	2,091,000.000	1,891,888.700	
SPAIN 1.9 10/31/52	470,000.000	316,892.670	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,070,000.000	1,050,395.460	
SPAIN 2.35 07/30/33	2,070,000.000	2,007,072.000	
SPAIN 2.4 05/31/28	1,500,000.000	1,507,800.000	
SPAIN 2.5 05/31/27	400,000.000	402,000.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,704,095.160	
SPAIN 2.7 01/31/30	1,300,000.000	1,315,925.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,160,000.000	971,867.420	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,600,000.000	1,411,817.600	
SPAIN 3.1 07/30/31	2,000,000.000	2,054,413.400	
SPAIN 3.15 04/30/33	1,676,000.000	1,716,299.420	
SPAIN 3.15 04/30/35	1,800,000.000	1,819,325.700	
SPAIN 3.2 10/31/35	1,000,000.000	1,010,800.000	
SPAIN 3.25 04/30/34	1,720,000.000	1,761,971.780	
SPAIN 3.3 04/30/36	700,000.000	711,105.500	
SPAIN 3.45 07/30/43	1,440,000.000	1,406,100.580	

	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	999,687.070	
	SPAIN 3.45 10/31/34	2,150,000.000	2,229,588.700	
	SPAIN 3.5 01/31/41	800,000.000	797,732.000	
	SPAIN 3.5 05/31/29	2,600,000.000	2,700,027.200	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,620,000.000	1,697,274.000	
	SPAIN 3.9 07/30/39	260,000.000	273,608.400	
	SPAIN 4.0 10/31/54	900,000.000	911,083.500	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,360,000.000	1,485,392.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,080,000.000	1,230,925.890	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,217,319.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,660,000.000	1,786,990.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,110,000.000	1,334,446.660	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,135,000.000	2,522,603.910	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,170,021.440	
	ユーロ 小計	527,271,000.000 (96,733,137,660)	494,874,233.650 (90,789,626,905)	
国債証券 合計		323,102,668,937.200 (323,102,668,937)	307,367,995,487 (307,367,995,487)	
合計			307,367,995,487 (307,367,995,487)	

(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 264銘柄	44.76	45.43
イギリス・ポンド	国債証券 64銘柄	5.78	5.86
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.40	0.40
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.30	1.32
オフショア・人民元	国債証券 72銘柄	11.75	11.92
カナダ・ドル	国債証券 38銘柄	2.08	2.12
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	0.38	0.38
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.17	0.18
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.20	0.20
ニュージーランド・ドル	国債証券 14銘柄	0.30	0.31
ノルウェー・クローネ	国債証券 11銘柄	0.17	0.17
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	0.72	0.73
マレーシア・リンギット	国債証券 25銘柄	0.51	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.92	0.93
ユーロ	国債証券 378銘柄	29.10	29.54

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

DIAM DC バランス30インデックスファンド

2026年2月27日現在

資産総額	6,586,227,187円
負債総額	3,932,376円
純資産総額(-)	6,582,294,811円
発行済数量	3,505,412,352口
1口当たり純資産額(/)	1.8778円

DIAM DC バランス50インデックスファンド

2026年2月27日現在

資産総額	13,937,081,432円
負債総額	15,475,844円
純資産総額(-)	13,921,605,588円
発行済数量	5,558,539,915口
1口当たり純資産額(/)	2.5045円

DIAM DC バランス70インデックスファンド

2026年2月27日現在

資産総額	13,152,383,921円
負債総額	3,762,847円
純資産総額(-)	13,148,621,074円
発行済数量	4,129,514,433口
1口当たり純資産額(/)	3.1841円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産総額	881,118,875,430円
負債総額	660,142,220円
純資産総額(-)	880,458,733,210円
発行済数量	122,070,916,355口
1口当たり純資産額(/)	7.2127円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産総額	2,486,616,331,094円
負債総額	1,011,692,819円
純資産総額(-)	2,485,604,638,275円
発行済数量	199,660,232,582口
1口当たり純資産額(/)	12.4492円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産総額	472,066,834,893円
負債総額	12,913,654,000円
純資産総額(-)	459,153,180,893円
発行済数量	404,230,820,719口
1口当たり純資産額(/)	1.1359円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年2月27日現在

資産総額	313,514,593,366円
負債総額	1,528,141,947円
純資産総額(-)	311,986,451,419円
発行済数量	114,653,945,274口
1口当たり純資産額(/)	2.7211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。

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。

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2026年2月27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2月27日現在)

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。

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2月27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	1,674,779,246,265
追加型株式投資信託	755	20,846,042,583,266
単位型公社債投資信託	18	27,312,712,884
単位型株式投資信託	154	814,662,257,193
合計	953	23,362,796,799,608

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「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282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第40期事業年度（自2024年4月1日至2025年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第41期中間会計期間（自2025年4月1日至2025年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,183	40,201
有価証券	-	0
金銭の信託	28,143	31,340
未収委託者報酬	19,018	19,595
未収運用受託報酬	3,577	4,015
未収投資助言報酬	315	359
未収収益	6	11
前払費用	1,510	1,758
その他	2,088	2,106
流動資産計	95,843	99,390
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 918	1 841
器具備品	1 130	1 352
リース資産	1 5	1 3
建設仮勘定	39	163
無形固定資産		
ソフトウェア	2,951	2,740
ソフトウェア仮勘定	1,543	1,030
電話加入権	0	0
投資その他の資産		
投資有価証券	184	183
関係会社株式	4,447	4,037
長期差入保証金	768	760
繰延税金資産	3,406	3,842
その他	128	215
固定資産計	14,524	14,172
資産合計	110,368	113,562

（単位：百万円）

	第39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,982	227
リース債務	1	1
未払金	8,970	8,823
未払収益分配金	1	1
未払償還金	0	0
未払手数料	8,246	8,596
その他未払金	721	225
未払費用	8,616	9,265
未払法人税等	3,676	4,277
未払消費税等	1,497	1,606
賞与引当金	1,927	2,198
役員賞与引当金	52	60
流動負債計	26,725	26,462
固定負債		
リース債務	4	2
退職給付引当金	2,719	2,715
時効後支払損引当金	73	64
固定負債計	2,796	2,781
負債合計	29,521	29,244
(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	59,294	62,765
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	59,170	62,642
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	27,490	30,962
株主資本計	80,846	84,318
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	80,846	84,318
負債・純資産合計	110,368	113,562

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）		第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	
	営業収益			
委託者報酬	102,113		112,281	
運用受託報酬	17,155		17,981	
投資助言報酬	2,211		2,374	
その他営業収益	26		30	
営業収益計		121,507		132,668
営業費用				
支払手数料	44,366		49,384	
広告宣伝費	329		401	
公告費	0		0	
調査費	35,468		39,013	
調査費	13,277		14,703	
委託調査費	22,190		24,309	
委託計算費	558		522	
営業雑経費	823		774	
通信費	36		38	
印刷費	598		538	
協会費	65		67	
諸会費	44		47	
支払販売手数料	78		81	
営業費用計		81,545		90,097
一般管理費				
給料	10,763		11,477	
役員報酬	164		181	
給料・手当	9,425		10,148	
賞与	1,173		1,147	
交際費	34		59	
寄付金	15		12	
旅費交通費	162		246	
租税公課	489		668	
不動産賃借料	1,030		1,085	
退職給付費用	412		421	
固定資産減価償却費	1,567		1,457	
福利厚生費	46		57	
修繕費	1		0	
賞与引当金繰入額	1,927		2,198	
役員賞与引当金繰入額	52		60	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,379		3,261	
事務用消耗品費	46		43	
器具備品費	3		2	
諸経費	240		313	
一般管理費計		20,172		21,366
営業利益		19,788		21,204

（単位：百万円）

	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）		第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		4		12
受取配当金	1	899	1	450
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		18		11
時効後支払損引当金戻入額		35		7
営業外収益計		959		482
営業外費用				
為替差損		19		39
金銭の信託運用損		1,008		329
早期割増退職金		6		6
雑損失		0		-
営業外費用計		1,034		374
経常利益		19,712		21,312
特別利益				
固定資産売却益		-	2	6
特別利益計		-		6
特別損失				
固定資産除却損		6		13
関係会社株式評価損		1,362		31
減損損失	3	231		-
関係会社清算損		-		25
特別損失計		1,601		70
税引前当期純利益		18,111		21,247
法人税、住民税及び事業税		5,769		7,356
法人税等調整額		510		435
法人税等合計		5,258		6,920
当期純利益		12,852		14,326

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							11,040	11,040	11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	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	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			11,040
当期純利益			12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	0	0	0
当期変動額合計	0	0	1,812
当期末残高	0	0	80,846

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 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8～18年 器具備品 ... 3～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

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

(未適用の会計基準等)

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

	第39期 （2024年3月31日現在）	第40期 （2025年3月31日現在）
建物	630	740
器具備品	769	662
リース資産	3	5

（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39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）	第40期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）
受取配当金	895	438

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39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）	第40期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）
ソフトウェア	-	6

3. 減損損失

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当社は、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

当社は、キャッシュ・フローを生み出す最小単位として、主として事業別に資産をグルーピングしております。当社の資産運用業に係るソフトウェア開発計画の大幅な延期に伴い、当該計画に係るソフトウェア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当事業年度については、該当事項ありません。

（株主資本等変動計算書関係）

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類 株式				

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

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生(予定)日
2024年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種 類株式					

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					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

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。

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39期(2024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	28,143	28,143	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,145	28,145	-

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 其他有価証券	0	0	-
資産計	31,342	31,342	-

(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39期(2024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	41,183	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,143	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	19,018	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,577	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	91,923	1	-	-

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	-	-

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39期（2024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	-	28,143	-	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,145	-	28,145

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

(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39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	182	182
関係会社株式		
非上場株式	4,447	4,037

（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39期の貸借対照表計上額4,447百万円、第40期の貸借対照表計上額4,037百万円）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39期（2024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。

3. 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1,362百万円（関係会社株式1,362百万円）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。

(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

	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,698	2,760
勤務費用	296	299
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	9	18
退職給付の支払額	246	321
退職給付債務の期末残高	2,760	2,759

(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

	第39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,760	2,759
未積立退職給付債務	2,760	2,759
未認識数理計算上の差異	40	44
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,719	2,715
退職給付引当金	2,719	2,715
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,719	2,715

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
勤務費用	296	299
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	13	14
過去勤務費用の費用処理額	0	0
その他	4	4
確定給付制度に係る退職給付費用	307	312

(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6百万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39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
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104百万円、当事業年度108百万円であります。

（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39期	第40期
	(2024年3月31日現在)	(2025年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	195	259
未払事業所税	9	10
賞与引当金	590	673
未払法定福利費	98	106
運用受託報酬	351	555
資産除去債務	17	20
減価償却超過額（一括償却資産）	12	5
減価償却超過額	91	66
繰延資産償却超過額（税法上）	331	407
退職給付引当金	832	855
時効後支払損引当金	22	20
ゴルフ会員権評価損	6	2
関係会社株式評価損	761	774
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	70	73
その他	8	6
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	<u>3,406</u>	<u>3,842</u>
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	<u>-</u>	<u>-</u>
繰延税金資産の純額	<u>3,406</u>	<u>3,842</u>

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

	第39期	第40期
	(2024年3月31日現在)	(2025年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	30.62 %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.44 %	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	0.14 %	0.79 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.04 %</u>	<u>32.57 %</u>

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

税法の改正に伴い、2026年4月1日以後開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等に係る繰延税金資産については、法定実効税率を30.62%から31.52%に変更し計算しております。

この変更により、当事業年度の繰延税金資産が37百万円増加し、法人税等調整額が37百万円減少しております。

(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

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、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39期 (2024年3月31日現在)	第40期 (2025年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	60,761百万円	53,066百万円
資産合計	60,761百万円	53,066百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	1,957百万円	561百万円
負債合計	1,957百万円	561百万円
純資産	58,804百万円	52,505百万円

(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	47,640百万円	43,829百万円
顧客関連資産	17,109百万円	13,661百万円

(2) 損益計算書項目

	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	7,649百万円	7,259百万円
経常利益	7,649百万円	7,259百万円
税引前当期純利益	7,649百万円	7,259百万円
当期純利益	6,474百万円	6,298百万円
1株当たり当期純利益	161,850円28銭	157,468円47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	3,837百万円	3,447百万円

(共通支配下の取引等)

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。

(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39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
委託者報酬	102,113百万円	111,988百万円
運用受託報酬	15,156百万円	16,520百万円
投資助言報酬	2,211百万円	2,374百万円
成功報酬(注)	1,999百万円	1,754百万円
その他営業収益	26百万円	30百万円
合計	121,507百万円	132,668百万円

(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39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)及び第40期(自 2024年4月1日 至 2025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

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。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

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。

(2) 子会社及び関連会社等

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

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。

(3) 兄弟会社等

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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	8,140	未払 手数料	1,870
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券 業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,655	未払 手数料	3,137

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40期(自2024年4月1日至2025年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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39期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)	第40期 (自2024年4月1日 至2025年3月31日)
1株当たり純資産額	2,021,173円74銭	2,107,956円73銭
1株当たり当期純利益金額	321,310円79銭	358,173円51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39期 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)	第40期 (自2024年4月1日 至2025年3月31日)
当期純利益金額	12,852百万円	14,326百万円
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	12,852百万円	14,326百万円
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種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

(注1) A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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第41期中間会計期間末 (2025年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		35,621
金銭の信託		31,531
未収委託者報酬		20,567
未収運用受託報酬		4,102
未収投資助言報酬		366
未収収益		15
前払費用		1,636
その他		2,150
	流動資産計	95,993
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	787
器具備品	1	437
リース資産	1	2
建設仮勘定		22
無形固定資産		
ソフトウェア		2,417
ソフトウェア仮勘定		1,173
電話加入権		0
投資その他の資産		
投資有価証券		183
関係会社株式		3,514
長期差入保証金		778
繰延税金資産		3,037
その他		233
	固定資産計	12,588
資産合計		108,581

（単位：百万円）

	第41期中間会計期間末 (2025年9月30日現在)	
(負債の部)		
流動負債		
預り金		314
リース債務		1
未払金		9,144
未払収益分配金		1
未払償還金		0
未払手数料		9,070
その他未払金		72
未払費用		11,298
未払法人税等		2,382
未払消費税等	2	1,043
契約負債		1
賞与引当金		943
役員賞与引当金		28
	流動負債計	25,158
固定負債		
リース債務		1
退職給付引当金		2,775
時効後支払損引当金		53
	固定負債計	2,830
	負債合計	27,988
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		19,552
資本準備金		2,428
その他資本剰余金		17,124
利益剰余金		59,040
利益準備金		123
その他利益剰余金		58,917
別途積立金		31,680
繰越利益剰余金		27,237
	株主資本計	80,593
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		0
	評価・換算差額等計	0
	純資産合計	80,593
	負債・純資産合計	108,581

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第41期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	57,558	
運用受託報酬	8,464	
投資助言報酬	1,065	
その他営業収益	12	
	営業収益計	67,100
営業費用		
支払手数料	25,227	
広告宣伝費	116	
調査費	20,339	
調査費	7,529	
委託調査費	12,810	
委託計算費	155	
営業雑経費	343	
通信費	18	
印刷費	219	
協会費	33	
諸会費	28	
支払販売手数料	42	
	営業費用計	46,182
一般管理費		
給料	5,333	
役員報酬	92	
給料・手当	5,213	
賞与	27	
交際費	35	
寄付金	11	
旅費交通費	143	
租税公課	312	
不動産賃借料	600	
退職給付費用	216	
固定資産減価償却費	1	688
福利厚生費	29	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	943	
役員賞与引当金繰入額	28	
機器リース料	0	
事務委託費	1,793	
事務用消耗品費	29	
器具備品費	0	
諸経費	92	
	一般管理費計	10,260
営業利益		10,657

(単位:百万円)

	第41期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	25	
受取配当金	323	
時効成立分配金・償還金	0	
為替差益	2	
金銭の信託運用益	318	
雑収入	2	
時効後支払損引当金戻入額	9	
	営業外収益計	681
営業外費用		
投資信託償還損	0	
	営業外費用計	0
経常利益		11,339
特別利益		
固定資産売却益	0	
	特別利益計	0
特別損失		
固定資産除却損	0	
関係会社株式評価損	523	
	特別損失計	524
税引前中間純利益		10,815
法人税、住民税及び事業税		2,296
法人税等調整額		804
法人税等合計		3,100
中間純利益		7,715

(3) 中間株主資本等変動計算書

第41期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	30,962
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,440
中間純利益							7,715
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	3,724
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,237

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	62,765	84,318	0	0	84,318
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,440	11,440			11,440
中間純利益	7,715	7,715			7,715
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)			0	0	0
当中間期変動額 合計	3,724	3,724	0	0	3,724
当中間期末残高	59,040	80,593	0	0	80,593

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="587 734 943 808"> <tr> <td>建物</td> <td>...</td> <td>8～18年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>3～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>	建物	...	8～18年	器具備品	...	3～20年
建物	...	8～18年					
器具備品	...	3～20年					
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、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>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。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>						

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第41期中間会計期間末 (2025年9月30日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 ... 794百万円 器具備品 ... 763百万円 リース資産 ... 6百万円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第41期中間会計期間 (自2025年4月1日至2025年9月30日)
1.減価償却実施額	有形固定資産 ... 161百万円 無形固定資産 ... 526百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第41期中間会計期間(自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
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) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

（金融商品関係）

第41期中間会計期間末（2025年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2025年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	31,531	31,531	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	0	0	-
資産計	31,532	31,532	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	31,531	-	31,531
投資有価証券				
其他有価証券	-	0	-	0
資産計	-	31,532	-	31,532

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（銀行預金・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、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	3,514

（有価証券関係）

第41期中間会計期間末

（2025年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額3,514百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

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

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

（持分法損益等）

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2025年4月1日から2025年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	50,436百万円
資産合計	50,436百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	897百万円
負債合計	897百万円
純資産	49,539百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額41,923百万円及び顧客関連資産の金額12,132百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	3,434百万円
経常利益	3,434百万円
税引前中間純利益	3,434百万円
中間純利益	2,966百万円
1株当たり中間純利益	74,157円45銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,528百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第41期中間会計期間
(自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)

委託者報酬	56,524百万円
運用受託報酬	8,464百万円
投資助言報酬	1,065百万円
成功報酬（注）	1,034百万円
その他営業収益	12百万円
合計	67,100百万円

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第41期中間会計期間(自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

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。

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第41期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,014,834円17銭
1株当たり中間純利益金額	192,877円36銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第41期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)
中間純利益金額	7,715百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,715百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって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（2025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
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。

(注)資本金の額は2025年3月末日現在

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)信託契約の一部解約事務
- (3)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (4)受益者に対する収益分配金の再投資
- (5)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付
- (6)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2025年5月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第40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2025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（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4月24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DIAM DC バランス30インデックスファンドの2025年2月26日から2026年2月25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、DIAM DC バランス30インデックスファンドの2026年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2026年4月24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DIAM DC バランス50インデックスファンドの2025年2月26日から2026年2月25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、DIAM DC バランス50インデックスファンドの2026年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2026年4月24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DIAM DC バランス70インデックスファンドの2025年2月26日から2026年2月25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、DIAM DC バランス70インデックスファンドの2026年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年11月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2025年4月1日から2026年3月31日までの第41期事業年度の中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2025年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

（注1）上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

（注2）X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。