

DIAMバランス・ファンド<DC年金>

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

追加型投信／内外／資産複合（インデックス型）

■この目論見書により行う「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2024年11月26日に関東財務局長に提出しており、2024年11月27日にその効力が生じております。

■「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

アセットマネジメントOne株式会社

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

■委託会社への照会先

【コールセンター】 **0120-104-694** (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

【ホームページアドレス】 <https://www.am-one.co.jp/>

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

目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	5
第1【ファンドの状況】	5
第2【管理及び運営】	69
第3【ファンドの経理状況】	76
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	289
第三部【委託会社等の情報】	291
第1【委託会社等の概況】	291
約款	320

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

(以上を総称して、または個別に「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>」、「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、「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」を「バランス・ファンド<DC年金> 1」、「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」を「バランス・ファンド<DC年金> 2」、「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」を「バランス・ファンド<DC年金> 3」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、収益分配金の再投資を行う場合は、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。（但し、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）

※収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2024年11月27日から2025年5月23日まで

※お申込みの取扱いは、販売会社の毎営業日に行われます。

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

(10) 【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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】

お申込みの方法

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、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で全額再投資する「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」に従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、お申込みの受付に係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、お申込みの受付を行いません。

※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みに係る口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。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。委託会社は、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係る信託を設定した旨の通知を行います。

○振替受益権について

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

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

(参考)

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①当ファンドは、3本のファンドから構成され、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運用を行います。
- ②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^(注)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。

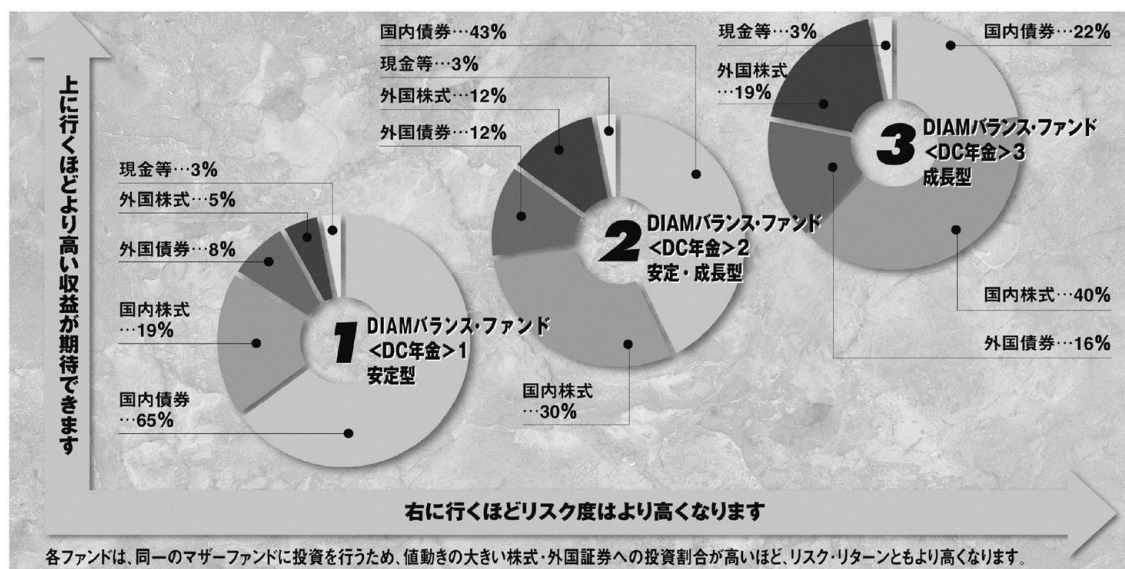
(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

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。



- DIAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型
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バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型
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バランス・ファンド<DC年金>3 成長型
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(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

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」

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
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」

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	年1回	グローバル (日本を含む)			
大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
債券 一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
公債 社債	年6回 (隔月)	欧州			
その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア オセアニア			TOPIX
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし	
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))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 (MSCIコク サイ・インデッ クス、NOMU RA-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)へ実質的に投資し、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。

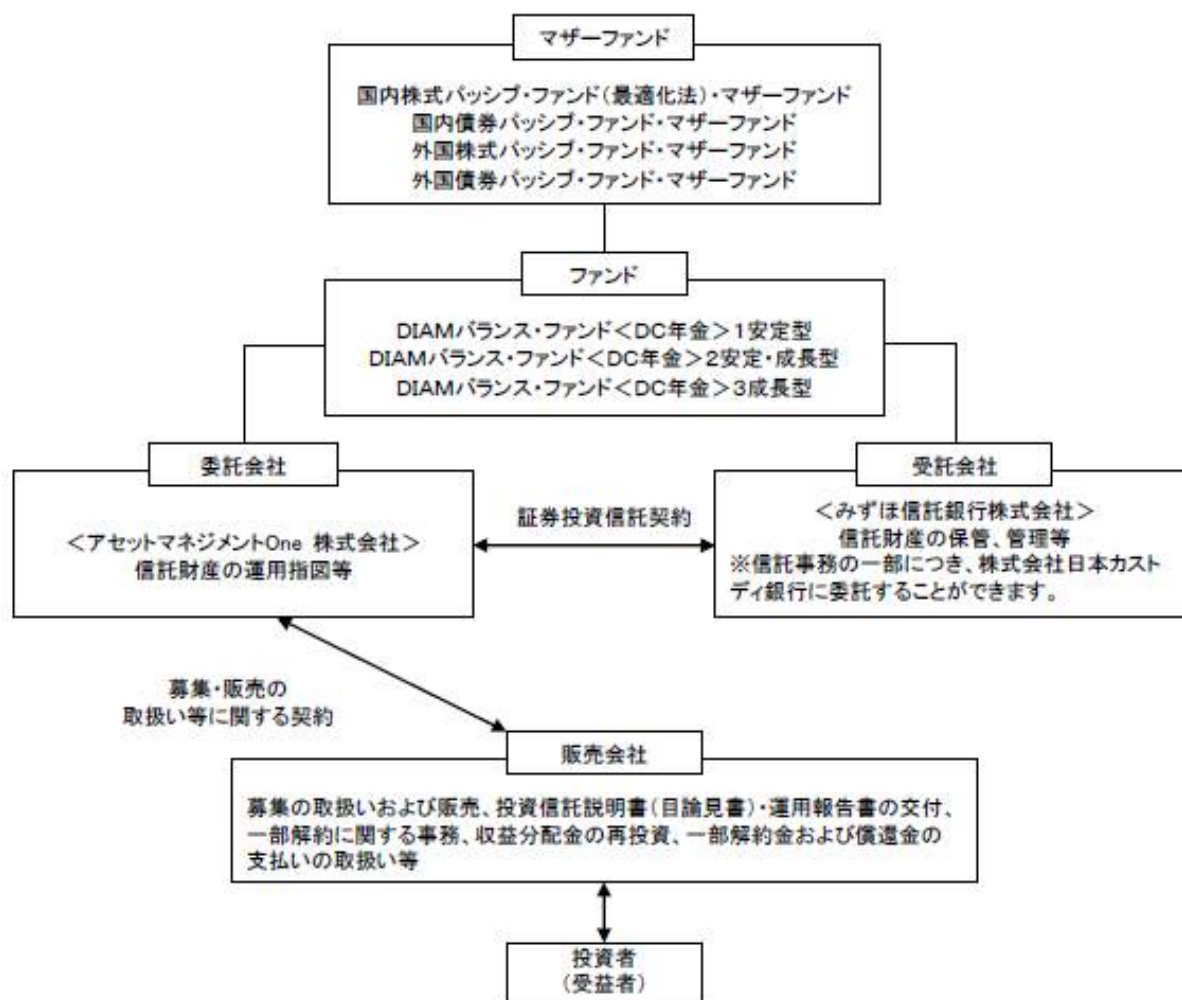
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

(2) 【ファンドの沿革】

- 2002年12月13日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
- 2005年10月 1日 信託報酬率の変更

(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

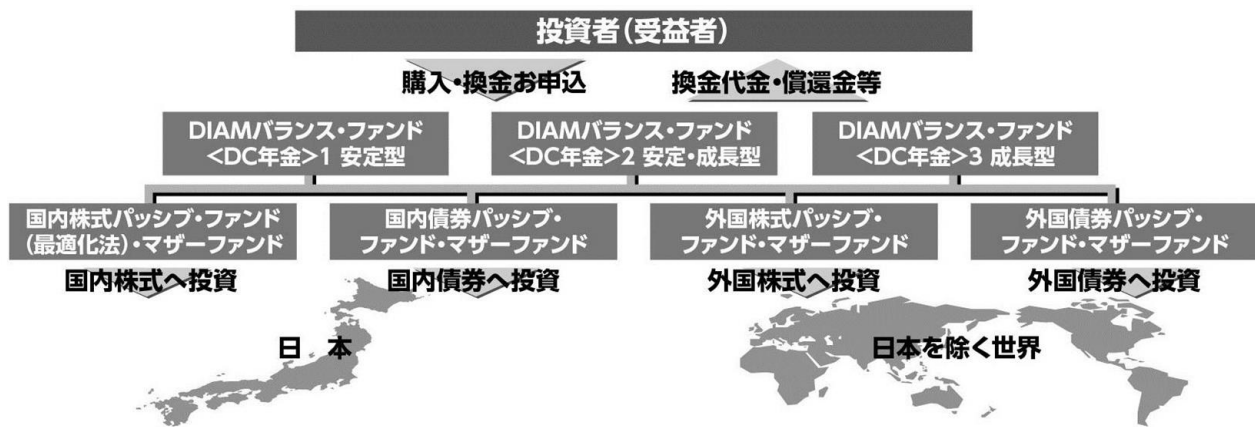
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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●

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○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（2024年8月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2024年8月30日現在)

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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、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への投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。

2) ①「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型」

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30%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します。

②「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型」

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します。

③「D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型」

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%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が55%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します。

※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(T O P I X)(配当込み)(注1)、国内債券についてはN O M U R A - B P I 総合(注2)、外国株式についてはM S C I コクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)(注3)、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)

(注4)、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。

(注1) ①東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)のに関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

②JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(注3) 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。

(注4) 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いません。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及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変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

■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) 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15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

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16条第1項)

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる(1)から(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) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（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) 特定目的会社に係る優先出資証券（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、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
 - (17) 証券投資信託または外国証券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上記(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16条第2項）

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

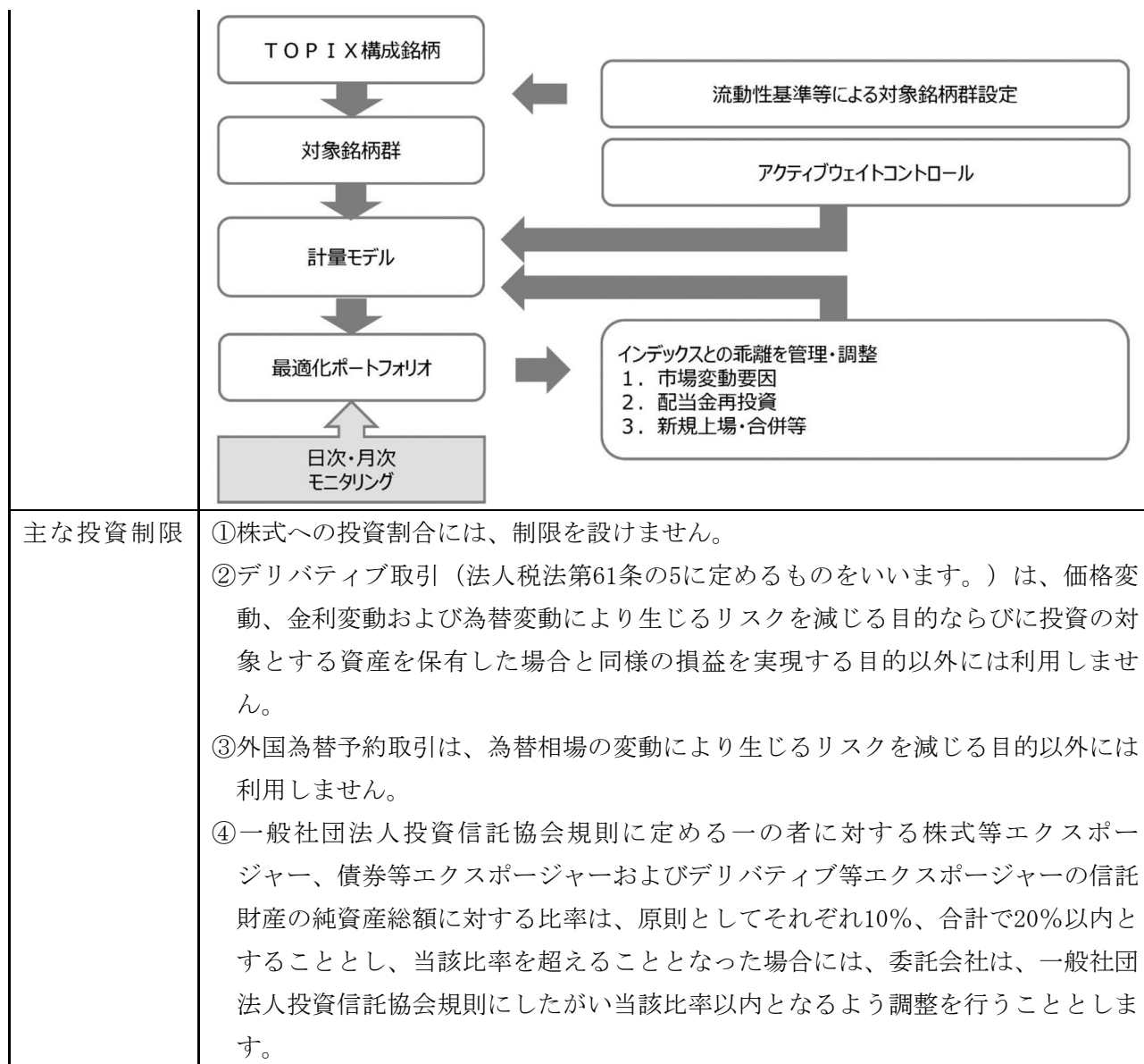
- (1) 預金
- (2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形
- (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、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16条第3項)

(参考) 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。
運用プロセス	<ol style="list-style-type: none"> 1)流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2)最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 <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>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-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
<p>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 NOMURA-BPI総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築</p>

- ①債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
 - ②金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
- ①、②が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

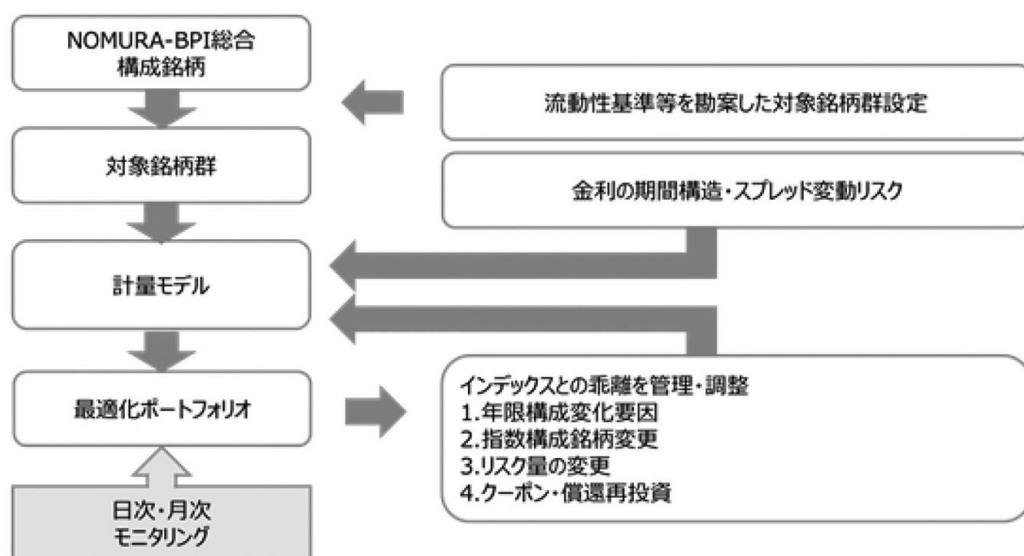
3) インデックスとの乖離を管理

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

組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

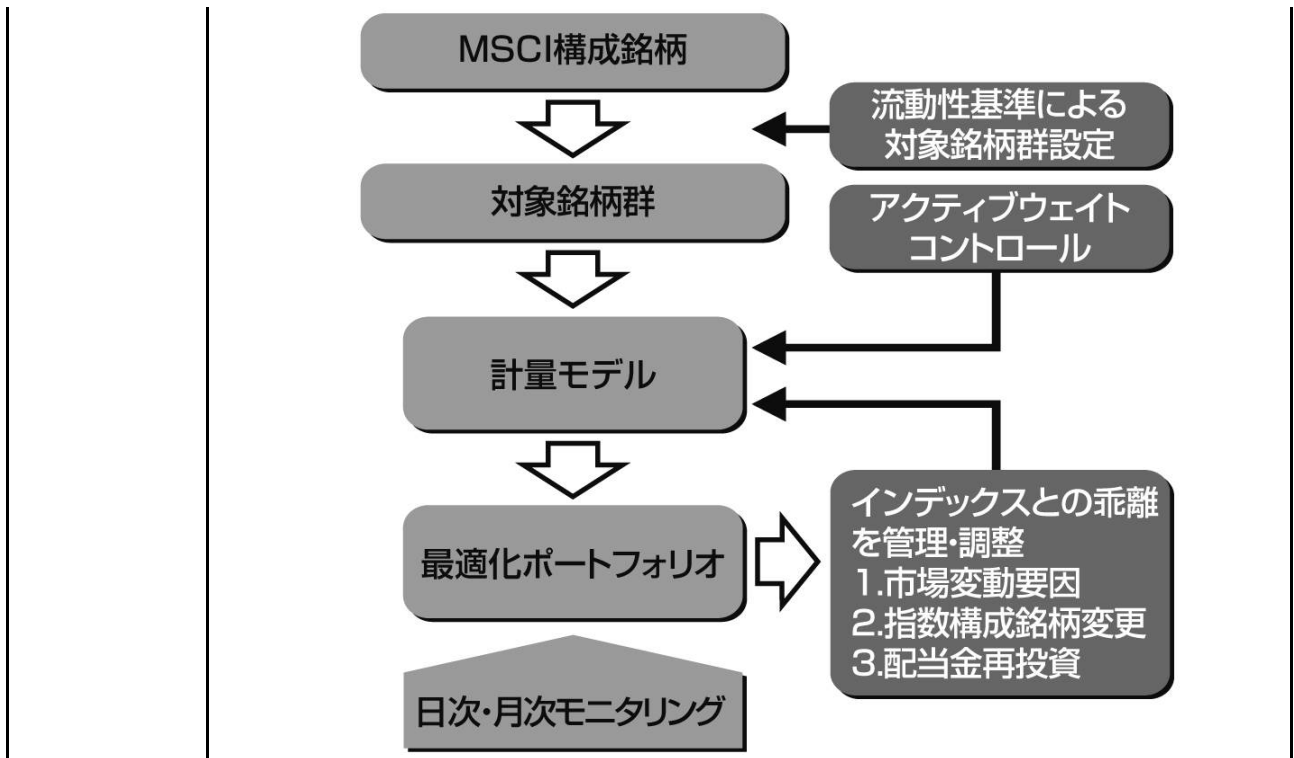


主な投資制限

- ①株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。
- 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。

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

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	<ol style="list-style-type: none"> 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。 <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 ・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



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

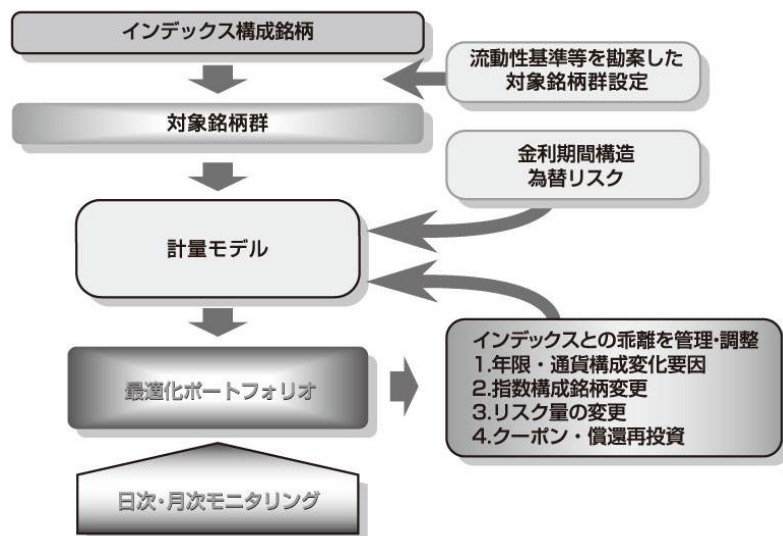
<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除</p>

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

- ① 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。
株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ② 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③ 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ⑤ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対

象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

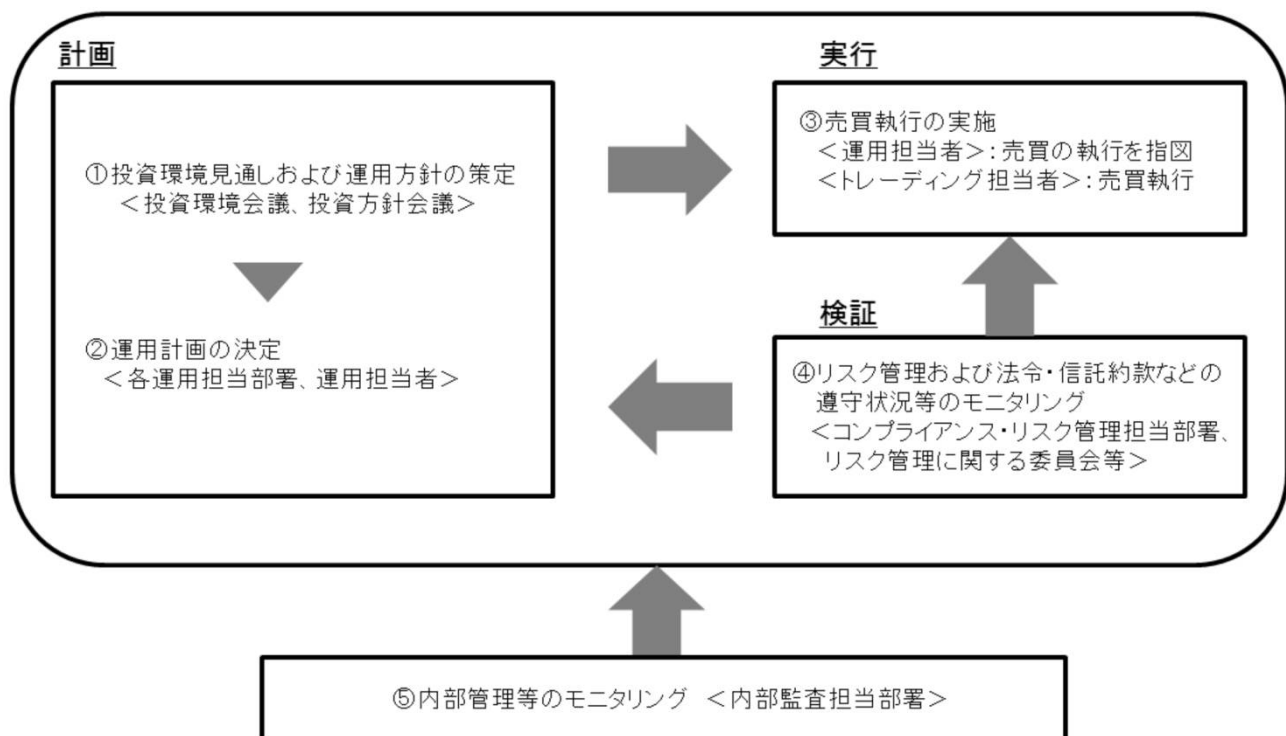
⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

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

③ 売買執行の実施

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

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b. ファンドの関係法人に関する管理

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2024年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則2月25日。ただし、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。

②収益の分配方式

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

1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

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てします。）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】

① 「D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 1 安定型」

(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30%以下とします。

② 「D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 2 安定・成長型」

(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50%以下とします。

③ 「D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 3 成長型」

(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%未満とします。

(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55%以下とします。

①②③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) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款 運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

(6) 投資する株式等の範囲 (約款第18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実質投資制限 (約款第19条)

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。

(8) 同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第20条）

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。

(9) 信用取引の指図範囲（約款第21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せん。）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（上記5)に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(10) 先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第22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係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係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係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係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係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および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係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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係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(以下2)において「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係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係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23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、当該信託財産に係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係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。以下(c)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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係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係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を要求され委託会社はその必要性を認めたときあるいは担保の受入れが必要と委託会社が認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(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24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、当該信託期間に係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係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）が、信託財産に係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係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係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係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係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係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、当該信託財産に係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係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下(e)において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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係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係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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (13) デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）
デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (14) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25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26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、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

(16) 公社債の借入れ（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、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、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

(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29条）

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

(18) 外国為替予約の指図（約款第30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、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- (c) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (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37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を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (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 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

(1) 株式投資リスク

当ファンド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、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

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。

当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

当ファンドは実質的に公社債に投資します。公社債では、一般的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、当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。

当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。

当ファンド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、一般的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、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。従いまして、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。当ファンドでは、為替変動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。

当ファンドの各資産（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。

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

(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、基準価額が予想外に下落する場合があります。

※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>

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

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

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

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

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

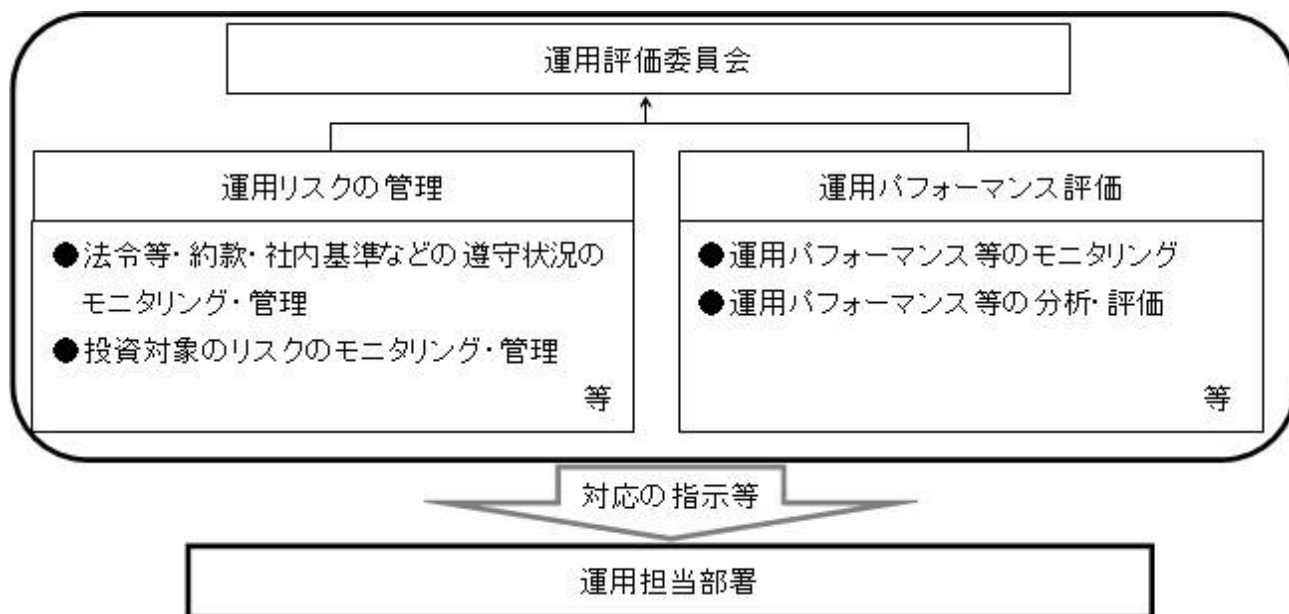
○注意事項

- イ. 当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（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、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ます、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

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



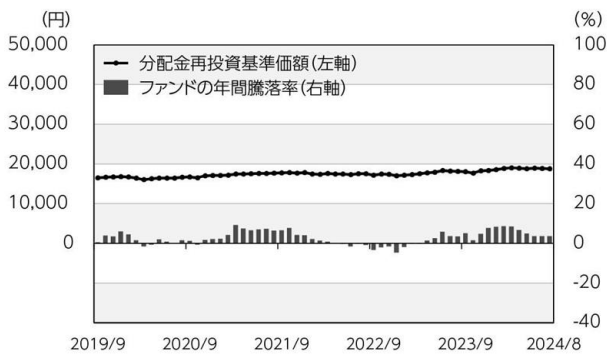
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2024年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

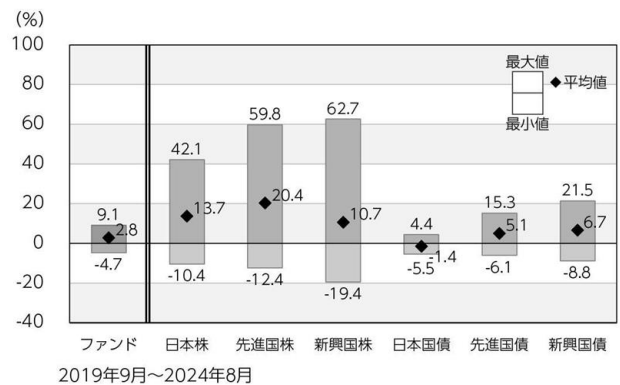
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

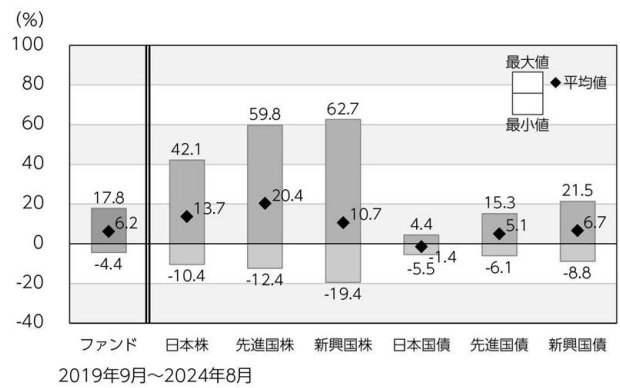
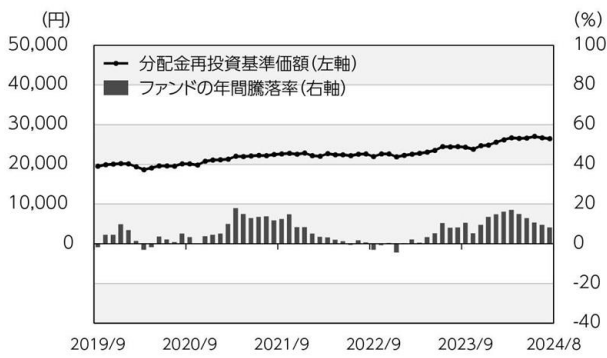
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型



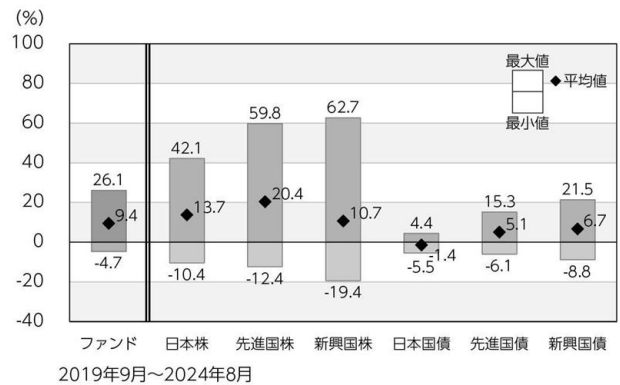
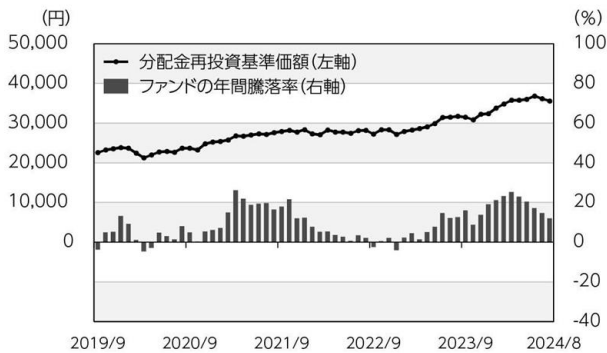
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型



DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

各ファンドの信託報酬およびその配分は、日々の純資産総額に対して以下の通りとします。

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）			
D I A Mバランス・ファンド <DC年金> 1 安定型 年率0.286%（税抜0.26%）	0.100%	0.130%	0.030%
D I A Mバランス・ファンド <DC年金> 2 安定・成長型 年率0.319%（税抜0.29%）	0.115%	0.145%	0.030%
D I A Mバランス・ファンド <DC年金> 3 成長型 年率0.352%（税抜0.32%）	0.130%	0.160%	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

※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。

- ①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年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。
- ③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・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

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

○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、2024年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

<個別元本について>

- ①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。
- ③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の<収益分配金の課税について>を参照。）

<収益分配金の課税について>

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

… (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バランス・ファンド<DC年金> 1安定型	0.29%	0.29%	0.01%
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	0.33%	0.32%	0.01%
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	0.36%	0.35%	0.01%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年2月28日~2024年2月26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】

D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	21,311,409,551	97.00
内 日本	21,311,409,551	97.00
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	658,106,454	3.00
純資産総額	21,969,516,005	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。

D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	48,965,675,272	97.01
内 日本	48,965,675,272	97.01
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	1,510,016,725	2.99
純資産総額	50,475,691,997	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。

D I A M バランス・ファンド<DC年金>3 成長型

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	44,305,810,783	97.01
内 日本	44,305,810,783	97.01
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	1,364,529,428	2.99
純資産総額	45,670,340,211	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

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	572,747,197,440	97.59
内 日本	572,747,197,440	97.59
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	14,153,268,339	2.41
純資産総額	586,900,465,779	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	13,740,430,000	2.34
内 日本	13,740,430,000	2.34

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

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

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

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	1,489,047,882,419	95.85
内 アメリカ	1,086,780,746,942	69.95
内 イギリス	58,267,660,788	3.75
内 カナダ	50,174,432,185	3.23
内 スイス	46,950,416,724	3.02
内 フランス	42,719,354,949	2.75
内 ドイツ	35,759,332,561	2.30
内 オランダ	28,341,584,789	1.82
内 オーストラリア	28,221,099,421	1.82
内 アイルランド	27,587,081,122	1.78
内 デンマーク	15,334,066,552	0.99
内 スウェーデン	13,186,406,430	0.85
内 スペイン	10,764,301,342	0.69
内 イタリア	8,598,007,410	0.55
内 香港	5,615,450,342	0.36
内 シンガポール	4,372,622,127	0.28
内 フィンランド	4,129,433,036	0.27
内 ジャージー	3,420,570,256	0.22
内 ベルギー	3,206,552,132	0.21
内 イスラエル	3,118,681,323	0.20
内 ノルウェー	2,387,477,143	0.15
内 ケイマン諸島	1,958,336,095	0.13
内 バミューダ	1,875,686,880	0.12
内 オランダ領キュラソー	1,502,231,121	0.10
内 ニュージーランド	1,062,290,341	0.07
内 リベリア	956,770,540	0.06
内 オーストリア	785,603,386	0.05
内 ルクセンブルグ	783,663,075	0.05
内 ポルトガル	668,452,053	0.04
内 パナマ	402,756,224	0.03
内 マン島	116,815,130	0.01
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	2,261,601,799	0.15
内 オーストラリア	1,881,845,287	0.12
内 シンガポール	379,756,512	0.02
投資証券	27,646,290,280	1.78
内 アメリカ	26,053,480,278	1.68
内 フランス	545,164,720	0.04
内 イギリス	483,448,832	0.03
内 香港	280,263,431	0.02
内 カナダ	165,097,361	0.01
内 ベルギー	118,835,658	0.01
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	34,619,594,240	2.23
純資産総額	1,553,575,368,738	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	35,713,306,318	2.30
内 アメリカ	27,497,302,800	1.77
内 ドイツ	4,900,880,460	0.32
内 イギリス	1,457,971,105	0.09
内 カナダ	1,167,296,738	0.08
内 オーストラリア	689,855,215	0.04

(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

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	456,590,910,050	101.45
内 日本	456,590,910,050	101.45
地方債証券	26,376,570,287	5.86
内 日本	26,376,570,287	5.86
特殊債券	26,145,020,969	5.81
内 日本	26,145,020,969	5.81
社債券	21,788,921,400	4.84
内 日本	21,393,793,400	4.75
内 フランス	395,128,000	0.09
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	△80,857,180,729	△17.97
純資産総額	450,044,241,977	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

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	250,398,670,376	98.29
内 アメリカ	118,057,462,062	46.34
内 中国	26,078,090,086	10.24
内 フランス	19,089,570,888	7.49
内 イタリア	17,447,421,859	6.85
内 ドイツ	15,371,398,321	6.03
内 イギリス	13,465,056,580	5.29
内 スペイン	11,323,272,665	4.44
内 カナダ	5,053,308,029	1.98
内 ベルギー	4,065,456,699	1.60
内 オランダ	3,416,820,660	1.34
内 オーストラリア	3,327,207,704	1.31
内 オーストリア	2,875,192,597	1.13
内 メキシコ	1,769,657,411	0.69
内 ポーランド	1,311,799,200	0.51
内 マレーシア	1,297,415,506	0.51

	内 フィンランド	1,254,861,401	0.49
	内 アイルランド	1,230,577,192	0.48
	内 シンガポール	1,022,794,989	0.40
	内 イスラエル	792,057,147	0.31
	内 ニュージーランド	669,422,708	0.26
	内 デンマーク	663,248,324	0.26
	内 スウェーデン	416,967,017	0.16
	内 ノルウェー	399,611,331	0.16
	コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,346,702,616	1.71
	純資産総額	254,745,372,992	100.00

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

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

D I A M バランス・ファンド<DC年金>1 安定型

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	11,730,189,186	1.2409 14,556,656,919	1.2192 14,301,446,655	— —	65.10
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	874,072,025	4.6695 4,081,483,209	4.7905 4,187,242,035	— —	19.06
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	741,755,187	2.3301 1,728,432,653	2.3482 1,741,789,530	— —	7.93
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	119,388,477	8.5547 1,021,336,208	9.0539 1,080,931,331	— —	4.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.00
合計	97.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内債券パッシブ・ファン	親投資	17,711,430,368	1.2396	1.2192	—	42.78

	ド・マザーファンド 日本	信託受 益証券		21,955,486,637	21,593,775,904	—	
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	3,209,720,073	4.6597	4.7905	—	30.46
				14,956,509,966	15,376,164,009	—	
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	2,555,949,610	2.3321	2.3482	—	11.89
				5,960,915,881	6,001,880,874	—	
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	662,019,073	8.5369	9.0539	—	11.87
				5,651,598,956	5,993,854,485	—	

(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

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.01
合計	97.01

(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。

D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,889,269,523	4.6601	4.7905	—	40.80
				18,124,713,372	18,631,545,649	—	
2	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	8,107,607,908	1.2397	1.2192	—	21.64
				10,051,374,471	9,884,795,561	—	
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	953,681,426	8.5273	9.0539	—	18.91
				8,132,327,638	8,634,536,262	—	
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,046,986,335	2.3300	2.3482	—	15.67
				7,099,758,878	7,154,933,311	—	

(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

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.01
合計	97.01

(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

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,971,700	3,243.28 25,854,489,189	2,759.50 21,997,906,150	— —	3.75
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,050,200	14,155.09 14,865,684,032	14,200.00 14,912,840,000	— —	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,994,900	1,415.86 12,735,586,906	1,528.00 13,744,207,200	— —	2.34
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,639,500	2,419.85 8,807,052,562	3,572.00 13,000,294,000	— —	2.22
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	150,100	64,310.37 9,652,987,618	69,610.00 10,448,461,000	— —	1.78
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,110,300	5,949.27 6,605,482,998	9,047.00 10,044,884,100	— —	1.71
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,034,300	7,848.15 8,117,349,236	9,550.00 9,877,565,000	— —	1.68
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,046,700	2,823.87 8,603,509,587	3,013.00 9,179,707,100	— —	1.56
9	信越化学工業 日本	株式 化学	1,347,000	5,852.78 7,883,697,696	6,422.00 8,650,434,000	— —	1.47
10	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,066,700	6,757.19 7,207,902,143	7,706.00 8,219,990,200	— —	1.40
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	317,500	28,784.84 9,139,189,430	25,805.00 8,193,087,500	— —	1.40
12	第一三共 日本	株式 医薬品	1,310,300	4,592.51 6,017,574,938	6,108.00 8,003,312,400	— —	1.36
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,442,100	3,992.45 5,757,516,467	5,506.00 7,940,202,600	— —	1.35
14	任天堂 日本	株式 その他製品	946,900	8,317.19 7,875,556,230	7,902.00 7,482,403,800	— —	1.27
15	三井物産 日本	株式 卸売業	2,376,700	2,959.63 7,034,166,158	3,123.00 7,422,434,100	— —	1.26
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,739,500	181.05 8,100,392,860	155.70 6,965,940,150	— —	1.19
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	741,900	6,779.22 5,029,503,785	8,405.00 6,235,669,500	— —	1.06

18	HOYA 日本	株式 精密機器	295,200	18,437.71 5,442,813,054	20,595.00 6,079,644,000	— —	1.04
19	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,993,700	2,749.39 5,481,460,844	3,009.00 5,999,043,300	— —	1.02
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,331,300	4,219.12 5,616,917,124	4,333.00 5,768,522,900	— —	0.98
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,553,300	1,706.46 6,063,598,483	1,588.00 5,642,640,400	— —	0.96
22	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,106,200	4,588.91 5,076,252,298	4,911.00 5,432,548,200	— —	0.93
23	三菱重工業 日本	株式 機械	2,648,800	1,098.05 2,908,516,431	1,942.50 5,145,294,000	— —	0.88
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,403,100	1,940.54 4,663,330,366	2,038.00 4,897,517,800	— —	0.83
25	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	89,200	39,554.79 3,528,287,556	46,650.00 4,161,180,000	— —	0.71
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,339,500	2,975.12 3,985,184,728	3,033.00 4,062,703,500	— —	0.69
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,659,100	2,048.69 3,398,987,768	2,441.00 4,049,863,100	— —	0.69
28	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	897,300	3,958.43 3,551,899,614	4,203.00 3,771,351,900	— —	0.64
29	キャノン 日本	株式 電気機器	748,000	4,131.27 3,090,190,539	5,017.00 3,752,716,000	— —	0.64
30	富士通 日本	株式 電気機器	1,393,800	2,314.72 3,226,263,512	2,677.50 3,731,899,500	— —	0.64

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.59
合計	97.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年8月30日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	17.13
銀行業		7.39
輸送用機器		7.33
情報・通信業		7.28
卸売業		7.14
化学		5.56
機械		5.22
医薬品		4.98
サービス業		4.66

小売業	4.20
食料品	3.08
保険業	3.05
その他製品	2.41
精密機器	2.36
陸運業	2.27
建設業	2.10
不動産業	2.00
電気・ガス業	1.40
その他金融業	1.18
証券、商品先物取引業	0.85
鉄鋼	0.84
海運業	0.79
非鉄金属	0.75
ガラス・土石製品	0.65
ゴム製品	0.59
石油・石炭製品	0.54
金属製品	0.48
繊維製品	0.36
空運業	0.36
鉱業	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	97.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,385,957	26,992.81 64,403,692,122	33,273.59 79,389,359,747	— —	5.11
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	4,066,555	11,271.34 45,835,536,568	17,027.03 69,241,362,114	— —	4.46
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	1,147,934	59,515.47 68,319,838,161	59,819.77 68,669,154,742	— —	4.42
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,522,990	24,891.08 37,908,866,600	24,922.97 37,957,443,218	— —	2.44
5	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ	356,566	68,948.61 24,584,732,115	75,038.25 26,756,090,788	— —	1.72

		ディアお よびサー ビス					
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	961,480	21,417.93 20,592,919,611	23,425.74 22,523,384,341	— —	1.45
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	828,146	21,550.15 17,846,672,036	23,660.31 19,594,199,366	— —	1.26
8	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	131,495	111,152.43 14,615,990,034	136,140.95 17,901,855,535	— —	1.15
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	716,762	18,644.67 13,363,797,995	22,723.46 16,287,315,503	— —	1.05
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	466,960	25,814.90 12,054,527,335	32,176.00 15,024,908,695	— —	0.97
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	212,800	58,009.67 12,344,459,590	67,819.97 14,432,090,892	— —	0.93
12	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	466,694	27,494.31 12,831,430,896	29,869.34 13,939,843,628	— —	0.90
13	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイダー ／ヘルス ケア・ サービス	150,045	75,033.27 11,258,367,007	85,659.33 12,852,755,070	— —	0.83
14	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	729,803	14,713.44 10,737,919,172	17,105.22 12,483,443,790	— —	0.80
15	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	531,207	18,363.23 9,754,677,410	19,836.52 10,537,299,342	— —	0.68
16	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	257,370	40,095.60 10,319,406,289	39,721.53 10,223,131,720	— —	0.66
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	135,459	67,272.06 9,112,606,884	69,619.83 9,430,633,906	— —	0.61
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	382,974	22,671.98 8,682,781,877	24,620.34 9,428,951,623	— —	0.61

19	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	392,305	22,518.28 8,834,035,649	23,780.50 9,329,210,621	— —	0.60
20	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・ 小売り	72,195	106,080.61 7,658,490,107	128,384.02 9,268,684,612	— —	0.60
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製造装置	65,122	137,192.85 8,934,273,274	132,042.11 8,598,846,938	— —	0.55
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	161,438	51,765.86 8,356,977,740	53,150.28 8,580,476,194	— —	0.55
23	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	288,444	25,288.80 7,294,405,352	28,262.06 8,152,022,788	— —	0.52
24	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・ 小売り	721,139	8,278.24 5,969,765,799	11,065.61 7,979,847,256	— —	0.51
25	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	70,518	84,808.60 5,980,533,341	100,271.10 7,070,917,711	— —	0.46
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	412,715	18,172.51 7,500,070,475	17,008.20 7,019,542,564	— —	0.45
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	667,450	8,655.44 5,777,075,591	10,432.84 6,963,399,058	— —	0.45
28	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	435,406	16,469.42 7,170,888,017	15,563.52 6,776,451,730	— —	0.44
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	1,156,533	4,872.44 5,635,142,729	5,816.61 6,727,108,352	— —	0.43
30	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品	252,768	19,002.52 4,803,230,820	25,313.51 6,398,447,317	— —	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	95.85
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.78
合計	97.77

(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

2024年8月30日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
半導体・半導体製造装置	外国	8.73
ソフトウェア		8.20
銀行		5.55

コンピュータ・周辺機器	5.42
医薬品	5.15
インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.55
石油・ガス・消耗燃料	4.05
資本市場	3.19
保険	3.08
金融サービス	3.03
大規模小売り	2.89
ヘルスケア機器・用品	2.13
航空宇宙・防衛	2.04
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	1.94
バイオテクノロジー	1.82
ホテル・レストラン・レジャー	1.81
生活必需品流通・小売り	1.76
機械	1.75
化学	1.72
電力	1.61
専門小売り	1.57
自動車	1.43
飲料	1.38
金属・鉱業	1.25
情報技術サービス	1.20
食品	1.20
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.15
電気設備	1.03
娯楽	1.02
家庭用品	1.00
陸上運輸	0.99
専門サービス	0.97
繊維・アパレル・贅沢品	0.96
各種電気通信サービス	0.90
総合公益事業	0.72
通信機器	0.66
建設関連製品	0.64
コングロマリット	0.62
商業サービス・用品	0.62
タバコ	0.58
パーソナルケア用品	0.57
メディア	0.54
電子装置・機器・部品	0.48
商社・流通業	0.45
消費者金融	0.41
航空貨物・物流サービス	0.41
家庭用耐久財	0.33
建設・土木	0.33
建設資材	0.31
不動産管理・開発	0.28
無線通信サービス	0.23
容器・包装	0.21
エネルギー設備・サービス	0.20

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.14
自動車用部品	0.10
運送インフラ	0.09
水道	0.08
ガス	0.08
販売	0.08
紙製品・林産品	0.07
ヘルスケア・テクノロジー	0.06
海上運輸	0.04
旅客航空輸送	0.04
各種消費者サービス	0.01
レジャー用品	0.00
合計	95.85

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	12,370,000,000	99.21 12,273,372,000	99.17 12,268,442,300	0.005 2026/12/20	2.73
2	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	9,600,000,000	99.02 9,506,304,000	98.95 9,499,296,000	0.1 2028/3/20	2.11
3	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	8,350,000,000	99.12 8,276,809,000	99.05 8,271,092,500	0.1 2027/12/20	1.84
4	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,250,000,000	97.91 6,119,505,000	97.95 6,122,062,500	0.5 2033/3/20	1.36
5	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,950,000,000	97.78 5,817,924,000	97.78 5,818,386,000	0.1 2030/3/20	1.29
6	368回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,950,000,000	96.06 5,715,849,000	96.08 5,716,760,000	0.2 2032/9/20	1.27
7	371回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,700,000,000	96.81 5,518,612,000	96.83 5,519,367,000	0.4 2033/6/20	1.23
8	372回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,400,000,000	100.02 5,401,324,000	100.00 5,400,000,000	0.8 2033/9/20	1.20
9	367回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,470,000,000	96.38 5,272,163,000	96.37 5,271,657,800	0.2 2032/6/20	1.17
10	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,210,000,000	99.41 5,179,677,800	98.97 5,156,597,500	0.005 2027/6/20	1.15
11	357回 利付国庫債券	国債証券	5,200,000,000	97.91	97.93	0.1	1.13

	(10年)	日本	券		5,091,651,000	5,092,620,000	2029/12/20	
12	345回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	5,060,000,000	99.61 5,040,302,000	99.39 5,029,387,000	0.1 2026/12/20	1.12
13	146回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	4,700,000,000	99.99 4,699,530,000	99.75 4,688,438,000	0.1 2025/12/20	1.04
14	346回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,540,000,000	99.84 4,533,008,400	99.31 4,509,082,600	0.1 2027/3/20	1.00
15	374回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,500,000,000	99.35 4,471,092,000	99.42 4,474,170,000	0.8 2034/3/20	0.99
16	347回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,500,000,000	99.73 4,488,030,000	99.23 4,465,710,000	0.1 2027/6/20	0.99
17	373回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,350,000,000	97.86 4,257,053,000	97.93 4,259,955,000	0.6 2033/12/20	0.95
18	364回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,410,000,000	96.54 4,257,426,000	96.48 4,255,076,700	0.1 2031/9/20	0.95
19	366回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,240,000,000	97.01 4,113,396,000	96.69 4,099,783,200	0.2 2032/3/20	0.91
20	362回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,210,000,000	97.30 4,096,510,000	97.03 4,085,131,400	0.1 2031/3/20	0.91
21	359回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,150,000,000	98.04 4,068,766,500	97.63 4,051,894,000	0.1 2030/6/20	0.90
22	360回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,100,000,000	97.82 4,010,661,000	97.45 3,995,491,000	0.1 2030/9/20	0.89
23	361回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	4,100,000,000	97.57 4,000,370,000	97.26 3,987,660,000	0.1 2030/12/20	0.89
24	154回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	4,000,000,000	99.29 3,971,826,000	99.15 3,966,200,000	0.1 2027/9/20	0.88
25	363回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,970,000,000	96.86 3,845,665,000	96.76 3,841,610,200	0.1 2031/6/20	0.85
26	348回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証 券	3,770,000,000	99.62 3,755,674,000	99.15 3,738,143,500	0.1 2027/9/20	0.83
27	170回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証 券	3,700,000,000	100.48 3,718,056,000	100.51 3,719,055,000	0.6 2029/6/20	0.83
28	355回 利付国庫債券		国債証	3,730,000,000	98.61	98.17	0.1	0.81

	(10年)	日本	債券		3,678,170,000	3,661,815,600	2029/6/20	
29	163回 利付国庫債券 (5年)	日本	国債証券	3,650,000,000	99.88	99.86	0.4	0.81
					3,645,810,000	3,644,890,000	2028/9/20	
30	353回 利付国庫債券 (10年)	日本	国債証券	3,690,000,000	98.83	98.52	0.1	0.81
					3,646,900,800	3,635,535,600	2028/12/20	

(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

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	101.45
地方債証券	5.86
特殊債券	5.81
社債券	4.84
合計	117.97

(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

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,424,832,000	89.70 1,278,162,103	92.78 1,322,032,592	2.75 2032/8/15	0.52
2	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,245,280,000	98.75 1,229,780,487	102.19 1,272,666,429	4.125 2032/11/15	0.50
3	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	1,294,512,000	92.01 1,191,158,004	94.67 1,225,538,781	1.5 2027/1/31	0.48
4	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,165,640,000	90.24 1,051,921,803	93.86 1,094,085,183	2.875 2032/5/15	0.43
5	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,258,312,000	81.48 1,025,376,667	85.24 1,072,612,678	1.125 2031/2/15	0.42
6	US T N/B 4.5 11/15/33 アメリカ	国債証券	1,013,600,000	100.86 1,022,347,142	104.92 1,063,547,511	4.5 2033/11/15	0.42
7	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,256,864,000	80.42 1,010,866,425	84.27 1,059,202,499	0.875 2030/11/15	0.42
8	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 中国	国債証券	1,019,825,000	100.02 1,020,078,815	101.11 1,031,200,535	2.18 2026/8/15	0.40
9	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,210,528,000	80.82 978,405,701	84.65 1,024,811,250	1.25 2031/8/15	0.40
10	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	1,049,800,000	94.12 988,146,452	97.61 1,024,723,718	3.5 2033/2/15	0.40
11	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	999,428,500	101.94	102.31	3.03	0.40

	中国			1,018,877,649	1,022,592,054	2026/3/11	
12	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26 中国	国債証 券	1,009,626,750	100.31 1,012,794,327	101.22 1,022,017,192	2.3 2026/5/15	0.40
13	US T N/B 3.875 08/15/33 アメリカ	国債証 券	1,013,600,000	96.78 980,974,388	100.14 1,015,104,567	3.875 2033/8/15	0.40
14	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,155,504,000	83.41 963,887,659	87.61 1,012,442,677	1.875 2032/2/15	0.40
15	US T N/B 4.375 05/15/34 アメリカ	国債証 券	941,200,000	101.65 956,810,602	104.03 979,142,125	4.375 2034/5/15	0.38
16	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 中国	国債証 券	950,476,900	101.31 962,998,193	102.10 970,488,620	2.69 2026/8/12	0.38
17	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	1,062,832,000	83.71 889,768,501	87.38 928,774,009	1.625 2031/5/15	0.36
18	US T N/B 4.0 02/29/28 アメリカ	国債証 券	897,760,000	98.88 887,791,542	100.85 905,475,125	4 2028/2/29	0.36
19	US T N/B 4.375 11/30/28 アメリカ	国債証 券	868,800,000	102.35 889,278,415	102.56 891,096,935	4.375 2028/11/30	0.35
20	US T N/B 4.0 02/15/34 アメリカ	国債証 券	868,800,000	97.56 847,613,889	101.00 877,555,870	4 2034/2/15	0.34
21	US T N/B 3.375 05/15/33 アメリカ	国債証 券	897,760,000	93.72 841,408,816	96.56 866,899,500	3.375 2033/5/15	0.34
22	US T N/B 3.75 04/15/26 アメリカ	国債証 券	868,800,000	98.40 854,953,500	99.54 864,863,250	3.75 2026/4/15	0.34
23	US T N/B 6.25 05/15/30 アメリカ	国債証 券	761,503,200	111.82 851,573,798	112.85 859,368,255	6.25 2030/5/15	0.34
24	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 中国	国債証 券	795,463,500	103.05 819,801,233	104.36 830,221,993	3.01 2028/5/13	0.33
25	US T N/B 0.75 04/30/26 アメリカ	国債証 券	868,800,000	92.22 801,230,433	94.76 823,289,813	0.75 2026/4/30	0.32
26	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	975,952,000	79.50 775,881,840	83.48 814,786,485	0.625 2030/8/15	0.32
27	US T N/B 2.875 05/15/52 アメリカ	国債証 券	1,015,048,000	73.04 741,450,696	78.07 792,490,798	2.875 2052/5/15	0.31
28	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	828,256,000	92.49 766,104,447	94.96 786,552,017	0.75 2026/3/31	0.31
29	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証 券	825,360,000	92.22 761,185,030	94.87 783,028,060	0.375 2026/1/31	0.31
30	US T N/B 0.75 05/31/26 アメリカ	国債証 券	815,224,000	91.97 749,767,242	94.55 770,816,578	0.75 2026/5/31	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

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.29
合計	98.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

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【その他投資資産の主要なもの】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

該当事項はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2024年8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0609月	買建	506	13,178,606,980	13,740,430,000	2.34

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)

株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep24	買建	677	27,201,901,750	27,497,302,800	1.77
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	614	4,751,220,423	4,900,880,460	0.32
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	91	1,441,659,581	1,457,971,105	0.09
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	39	1,151,204,325	1,167,296,738	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep24	買建	35	678,667,509	689,855,215	0.04

(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】

① 【純資産の推移】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

直近日(2024年8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12計算期間末 (2015年2月25日)	8,185	8,185	1.5056	1.5056
第13計算期間末 (2016年2月25日)	8,608	8,608	1.4954	1.4954
第14計算期間末 (2017年2月27日)	9,711	9,711	1.5586	1.5586
第15計算期間末 (2018年2月26日)	10,879	10,879	1.6264	1.6264
第16計算期間末 (2019年2月25日)	12,140	12,140	1.6261	1.6261
第17計算期間末 (2020年2月25日)	14,046	14,046	1.6706	1.6706
第18計算期間末 (2021年2月25日)	16,105	16,105	1.7306	1.7306
第19計算期間末 (2022年2月25日)	17,694	17,694	1.7336	1.7336
第20計算期間末 (2023年2月27日)	18,732	18,732	1.7299	1.7299
第21計算期間末 (2024年2月26日)	21,531	21,531	1.8898	1.8898
2023年8月末日	20,228	—	1.8172	—
9月末日	20,095	—	1.8059	—

10月末日	19,844	—	1.7733	—
11月末日	20,548	—	1.8274	—
12月末日	20,672	—	1.8330	—
2024年1月末日	21,020	—	1.8589	—
2月末日	21,544	—	1.8862	—
3月末日	21,944	—	1.9064	—
4月末日	21,804	—	1.8927	—
5月末日	21,778	—	1.8798	—
6月末日	21,945	—	1.8989	—
7月末日	21,919	—	1.8847	—
8月末日	21,969	—	1.8830	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

直近日（2024年8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12計算期間末 (2015年2月25日)	19,545	19,545	1.7503	1.7503
第13計算期間末 (2016年2月25日)	18,932	18,932	1.6738	1.6738
第14計算期間末 (2017年2月27日)	21,334	21,334	1.8059	1.8059
第15計算期間末 (2018年2月26日)	23,907	23,907	1.9363	1.9363
第16計算期間末 (2019年2月25日)	25,795	25,795	1.9233	1.9233
第17計算期間末 (2020年2月25日)	28,999	28,999	1.9981	1.9981
第18計算期間末 (2021年2月25日)	33,402	33,402	2.1637	2.1637
第19計算期間末 (2022年2月25日)	36,908	36,908	2.1956	2.1956
第20計算期間末 (2023年2月27日)	40,248	40,248	2.2470	2.2470
第21計算期間末 (2024年2月26日)	49,296	49,296	2.6188	2.6188
2023年8月末日	45,132	—	2.4466	—
9月末日	44,985	—	2.4310	—
10月末日	44,409	—	2.3810	—
11月末日	46,297	—	2.4737	—
12月末日	46,541	—	2.4815	—
2024年1月末日	47,996	—	2.5551	—
2月末日	49,337	—	2.6157	—
3月末日	50,354	—	2.6676	—
4月末日	50,199	—	2.6572	—
5月末日	50,395	—	2.6585	—
6月末日	51,253	—	2.7047	—
7月末日	50,727	—	2.6696	—

8月末日	50,475	—	2.6472	—
------	--------	---	--------	---

D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型

直近日（2024年8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12計算期間末 (2015年2月25日)	15,889	15,889	2.0030	2.0030
第13計算期間末 (2016年2月25日)	14,524	14,524	1.8463	1.8463
第14計算期間末 (2017年2月27日)	16,465	16,465	2.0530	2.0530
第15計算期間末 (2018年2月26日)	18,810	18,810	2.2555	2.2555
第16計算期間末 (2019年2月25日)	20,092	20,092	2.2234	2.2234
第17計算期間末 (2020年2月25日)	22,391	22,391	2.3353	2.3353
第18計算期間末 (2021年2月25日)	26,255	26,255	2.6198	2.6198
第19計算期間末 (2022年2月25日)	29,757	29,757	2.6891	2.6891
第20計算期間末 (2023年2月27日)	33,467	33,467	2.8200	2.8200
第21計算期間末 (2024年2月26日)	44,118	44,118	3.4833	3.4833
2023年8月末日	38,800	—	3.1717	—
9月末日	38,721	—	3.1507	—
10月末日	38,177	—	3.0798	—
11月末日	40,156	—	3.2232	—
12月末日	40,527	—	3.2339	—
2024年1月末日	42,378	—	3.3753	—
2月末日	44,168	—	3.4815	—
3月末日	45,501	—	3.5772	—
4月末日	45,462	—	3.5740	—
5月末日	45,987	—	3.5967	—
6月末日	47,079	—	3.6810	—
7月末日	46,374	—	3.6100	—
8月末日	45,670	—	3.5522	—

②【分配の推移】

D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型

	1口当たりの分配金 (円)
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
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
2024年2月27日～2024年8月26日	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	1口当たりの分配金 (円)
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
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
2024年2月27日～2024年8月26日	—

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

	1口当たりの分配金 (円)
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
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
2024年2月27日～2024年8月26日	—

③【収益率の推移】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

	収益率 (%)
第12計算期間	8.5
第13計算期間	△0.7
第14計算期間	4.2
第15計算期間	4.4
第16計算期間	△0.0
第17計算期間	2.7
第18計算期間	3.6
第19計算期間	0.2
第20計算期間	△0.2
第21計算期間	9.2
2024年2月27日～2024年8月26日	△0.7

(注) 収益率は期間騰落率です。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	収益率 (%)
第12計算期間	13.0
第13計算期間	△4.4
第14計算期間	7.9
第15計算期間	7.2
第16計算期間	△0.7
第17計算期間	3.9
第18計算期間	8.3
第19計算期間	1.5
第20計算期間	2.3
第21計算期間	16.5
2024年2月27日～2024年8月26日	0.5

(注) 収益率は期間騰落率です。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

	収益率 (%)
第12計算期間	17.3
第13計算期間	△7.8
第14計算期間	11.2
第15計算期間	9.9
第16計算期間	△1.4
第17計算期間	5.0
第18計算期間	12.2
第19計算期間	2.6
第20計算期間	4.9
第21計算期間	23.5
2024年2月27日～2024年8月26日	1.1

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

	設定口数	解約口数
第12計算期間	1,286,101,728	748,268,806
第13計算期間	1,428,568,208	1,108,983,410
第14計算期間	1,177,511,256	702,902,178
第15計算期間	1,447,662,999	989,556,322
第16計算期間	1,628,738,236	851,823,010
第17計算期間	1,933,987,415	992,137,886
第18計算期間	2,435,613,354	1,537,362,088
第19計算期間	2,220,967,739	1,320,382,866
第20計算期間	1,748,111,899	1,126,760,085
第21計算期間	1,999,883,214	1,434,801,822
2024年2月27日～ 2024年8月26日	1,060,692,700	842,078,569

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

	設定口数	解約口数

第12計算期間	1,739,079,770	1,190,841,426
第13計算期間	1,697,863,637	1,553,640,036
第14計算期間	1,423,621,400	920,758,675
第15計算期間	1,657,767,778	1,125,122,159
第16計算期間	1,981,921,051	916,350,971
第17計算期間	2,437,684,904	1,336,440,297
第18計算期間	2,967,927,595	2,044,238,507
第19計算期間	2,931,027,984	1,557,985,089
第20計算期間	2,453,637,662	1,352,278,614
第21計算期間	2,686,742,128	1,774,203,861
2024年2月27日～ 2024年8月26日	1,209,267,830	1,020,877,593

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

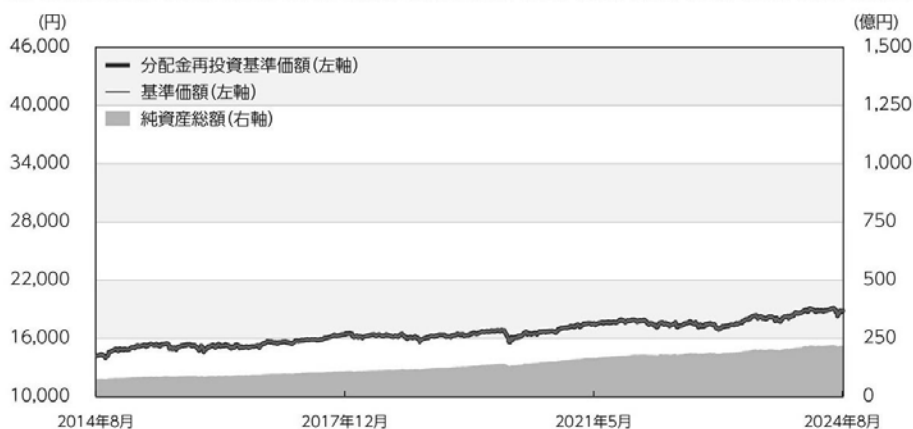
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型

	設定口数	解約口数
第12計算期間	1,448,206,115	1,263,916,173
第13計算期間	1,425,335,822	1,490,982,099
第14計算期間	1,086,201,353	932,940,956
第15計算期間	1,357,837,135	1,038,315,671
第16計算期間	1,485,604,296	788,709,795
第17計算期間	1,754,564,428	1,202,899,164
第18計算期間	2,137,759,735	1,703,975,804
第19計算期間	2,436,219,650	1,392,409,226
第20計算期間	1,879,201,334	1,076,988,091
第21計算期間	2,230,886,992	1,433,224,319
2024年2月27日～ 2024年8月26日	1,000,146,961	855,581,143

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

基準価額・純資産の推移 (2014年8月29日~2024年8月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、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:2002年12月13日)

分配の推移(税引前)

2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
設定来累計	0円

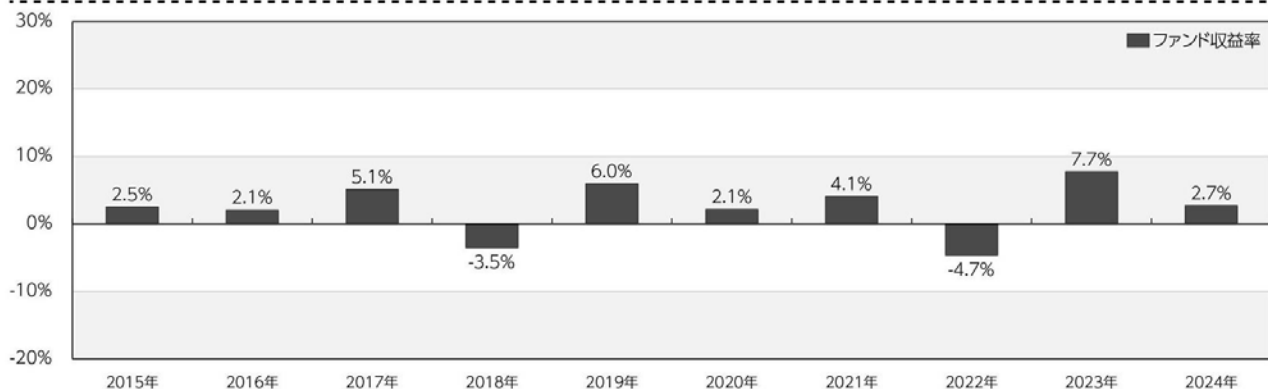
※分配金は1万口当たりです。

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	65.10
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	19.06
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.93
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.92

年間収益率の推移(暦年ベース)

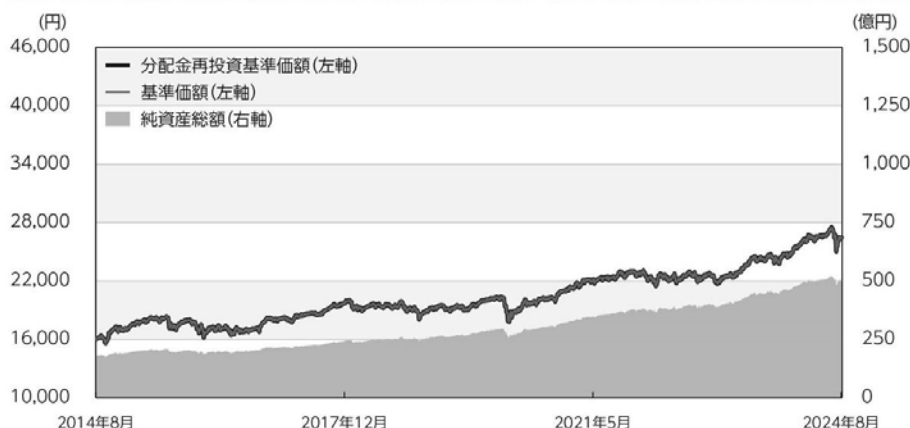


※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

基準価額・純資産の推移 (2014年8月29日～2024年8月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、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:2002年12月13日)

分配の推移 (税引前)

2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
設定来累計	0円

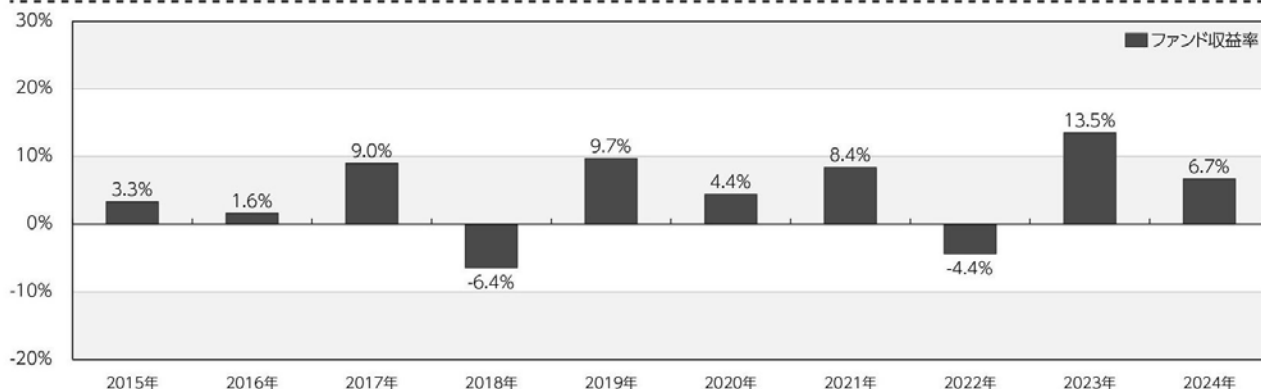
※分配金は1万口当たりです。

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	42.78
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30.46
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.89
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.87

年間収益率の推移 (暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

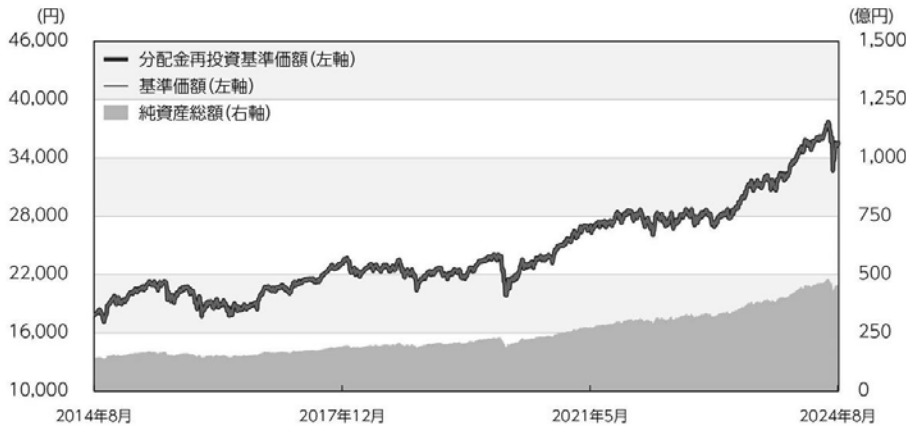
※2024年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

基準価額・純資産の推移 (2014年8月29日～2024年8月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、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:2002年12月13日)

分配の推移(税引前)

2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
設定来累計	0円

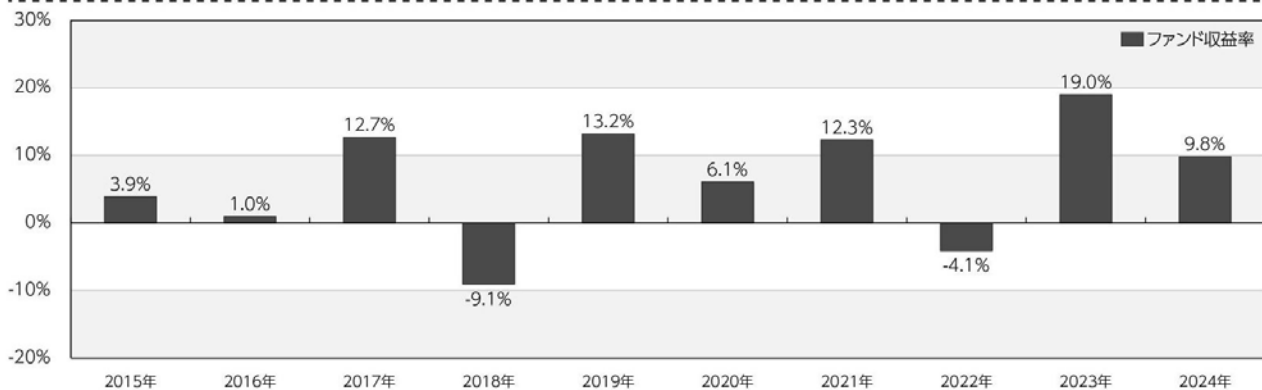
※分配金は1万口当たりです。

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	40.80
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.64
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	18.91
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.67

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2024年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。

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	3.75
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.34
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.22
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.11
2	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	4.46
3	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.42
4	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.44
5	META PLATFORMS INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.72

■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	150回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2026/12/20	2.73
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	2.11
3	349回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/12/20	1.84
4	370回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2033/3/20	1.36
5	358回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2030/3/20	1.29

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	アメリカ	2.75	2032/8/15	0.52
2	US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	アメリカ	4.125	2032/11/15	0.50
3	US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	アメリカ	1.5	2027/1/31	0.48
4	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.43
5	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.42

○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取得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、収益の分配が行われた場合、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」に従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、お申込みの受付に係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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。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。委託会社は、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係る信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額（発行価格）はお申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

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

<基準価額の照会方法等>

基準価額は、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

1円以上1円単位（当初元本1口=1円）とします。

※収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

・お申込手数料はありません。

- ・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、解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求
をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、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、解約の受付に係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
係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、当該一部解約に係る受益権の口
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。

- ・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

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）

- ・換金（解約）単位は1口単位とします。

3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）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において、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/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は2002年12月13日から無期限です。

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

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとします。

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

(5) 【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は各ファンドについて受益権の口数が10億口を下回る事となった場合には、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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る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。
- b. 委託会社は、信託終了前に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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る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. の規定に従います。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年

毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年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】

①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。

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2023年2月28日から2024年2月26日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年4月26日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛
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D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型の2023年2月28日から2024年2月26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、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型の2024年2月26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。

1【財務諸表】

【D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	593,875,850	705,733,434
親投資信託受益証券	18,173,224,490	20,890,798,864
未収入金	19,310,000	54,224,000
流動資産合計	18,786,410,340	21,650,756,298
資産合計	18,786,410,340	21,650,756,298
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,884,355	89,567,208
未払受託者報酬	3,116,009	3,425,027
未払委託者報酬	23,889,786	26,258,846
その他未払費用	369,672	401,475
流動負債合計	54,259,822	119,652,556
負債合計	54,259,822	119,652,556
純資産の部		
元本等		
元本	10,828,169,759	11,393,251,151
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	7,903,980,759	10,137,852,591
(分配準備積立金)	1,443,630,756	2,852,178,127
元本等合計	18,732,150,518	21,531,103,742
純資産合計	18,732,150,518	21,531,103,742
負債純資産合計	18,786,410,340	21,650,756,298

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期 自 2022年2月26日 至 2023年2月27日	第21期 自 2023年2月28日 至 2024年2月26日
営業収益		
受取利息	4,370	5,689
有価証券売買等損益	9,429,537	1,831,217,374
営業収益合計	9,433,907	1,831,223,063
営業費用		
支払利息	215,216	240,046
受託者報酬	6,074,251	6,590,825
委託者報酬	46,569,934	50,530,253
その他費用	720,624	776,777
営業費用合計	53,580,025	58,137,901
営業利益又は営業損失(△)	△44,146,118	1,773,085,162
経常利益又は経常損失(△)	△44,146,118	1,773,085,162
当期純利益又は当期純損失(△)	△44,146,118	1,773,085,162
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(△)	4,483,775	112,276,267
期首剰余金又は期首欠損金(△)	7,488,086,363	7,903,980,759
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,292,011,001	1,628,422,078
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	1,292,011,001	1,628,422,078
剰余金減少額又は欠損金増加額	827,486,712	1,055,359,141
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	827,486,712	1,055,359,141
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(△)	7,903,980,759	10,137,852,591

(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21期	
	自 2023年2月28日	至 2024年2月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2023年2月27日、当計算期間末日を2024年2月26日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期
	2023年2月27日現在	2024年2月26日現在
1. 期首元本額	10,206,817,945円	10,828,169,759円
期中追加設定元本額	1,748,111,899円	1,999,883,214円
期中一部解約元本額	1,126,760,085円	1,434,801,822円
2. 受益権の総数	10,828,169,759口	11,393,251,151口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2022年2月26日 至 2023年2月27日	自 2023年2月28日 至 2024年2月26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(0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(6,460,552,654円)及び分配準備積立金(1,443,630,756円)より分配対象収益は7,904,183,410円(1万口当たり7,299.64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(0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(1,583,750,848円)、信託約款に規定される収益調整金(7,285,891,288円)及び分配準備積立金(1,268,427,279円)より分配対象収益は10,138,069,415円(1万口当たり8,898.31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20期	第21期
	自 2022年2月26日 至 2023年2月27日	自 2023年2月28日 至 2024年2月26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	同左

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26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	<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>	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20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26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	△30,517,713	1,668,324,956
合計	△30,517,713	1,668,324,956

(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20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,7299円 (17,299円)	1,8898円 (18,898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

2024年2月26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	895,699,678	4,179,334,697	
	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	11,158,997,183	13,861,706,300	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	133,558,960	1,138,897,319	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	734,747,927	1,710,860,548	
親投資信託受益証券	合計	12,923,003,748	20,890,798,864	
合計			20,890,798,864	

(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。

独立監査人の監査報告書

2024年4月26日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛
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D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2023年2月28日から2024年2月26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、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2024年2月26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。

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,289,647,758	1,580,250,582
親投資信託受益証券	39,048,008,532	47,844,610,300
未収入金	4,635,000	67,386,000
流動資産合計	40,342,291,290	49,492,246,882
資産合計	40,342,291,290	49,492,246,882
負債の部		
流動負債		
未払解約金	29,438,564	120,396,951
未払受託者報酬	6,623,677	7,717,815
未払委託者報酬	57,405,579	66,888,022
その他未払費用	592,478	656,315
流動負債合計	94,060,298	195,659,103
負債合計	94,060,298	195,659,103
純資産の部		
元本等		
元本	17,911,791,114	18,824,329,381
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	22,336,439,878	30,472,258,398
(分配準備積立金)	7,364,439,377	13,237,982,363
元本等合計	40,248,230,992	49,296,587,779
純資産合計	40,248,230,992	49,296,587,779
負債純資産合計	40,342,291,290	49,492,246,882

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21期	
	自	2022年2月26日 至 2023年2月27日	自	2023年2月28日 至 2024年2月26日
営業収益				
受取利息		9,313		12,466
有価証券売買等損益		1,001,872,709		7,002,267,768
営業収益合計		1,001,882,022		7,002,280,234
営業費用				
支払利息		455,460		527,336
受託者報酬		12,870,703		14,635,776
委託者報酬		111,546,809		126,844,059
その他費用		1,157,248		1,258,737
営業費用合計		126,030,220		143,265,908
営業利益又は営業損失(△)		875,851,802		6,859,014,326
経常利益又は経常損失(△)		875,851,802		6,859,014,326
当期純利益又は当期純損失(△)		875,851,802		6,859,014,326
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(△)		47,788,864		309,555,206
期首剰余金又は期首欠損金(△)		20,098,427,700		22,336,439,878
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,030,135,060		3,815,468,353
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		3,030,135,060		3,815,468,353
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,620,185,820		2,229,108,953
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,620,185,820		2,229,108,953
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(△)		22,336,439,878		30,472,258,398

(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21期	
	自 2023年2月28日	至 2024年2月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2023年2月27日、当計算期間末日を2024年2月26日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期
	2023年2月27日現在	2024年2月26日現在
1. 期首元本額	16,810,432,066円	17,911,791,114円
期中追加設定元本額	2,453,637,662円	2,686,742,128円
期中一部解約元本額	1,352,278,614円	1,774,203,861円
2. 受益権の総数	17,911,791,114口	18,824,329,381口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2022年2月26日 至 2023年2月27日	自 2023年2月28日 至 2024年2月26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(0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(828,276,639円)、信託約款に規定される収益調整金(14,972,435,023円)及び分配準備積立金(6,536,162,738円)より分配対象収益は22,336,874,400円(1万口当たり12,470.48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(0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(6,549,550,402円)、信託約款に規定される収益調整金(17,234,761,944円)及び分配準備積立金(6,688,431,961円)より分配対象収益は30,472,744,307円(1万口当たり16,187.95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20期	第21期
	自 2022年2月26日 至 2023年2月27日	自 2023年2月28日 至 2024年2月26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	同左

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26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	<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>	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20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26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	943,654,630	6,717,071,466
合計	943,654,630	6,717,071,466

(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20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2470円 (22,470円)	2,6188円 (26,188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

2024年2月26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	3,302,701,027	15,410,402,991	
	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	16,433,739,226	20,413,990,866	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	746,042,424	6,361,727,562	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	2,430,100,443	5,658,488,881	
親投資信託受益証券	合計	22,912,583,120	47,844,610,300	
合計			47,844,610,300	

(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。

独立監査人の監査報告書

2024年4月26日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛
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D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型の2023年2月28日から2024年2月26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、D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型の2024年2月26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。

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,080,137,197	1,440,871,490
親投資信託受益証券	32,466,953,953	42,813,408,531
未収入金	6,563,000	5,677,000
流動資産合計	33,553,654,150	44,259,957,021
資産合計	33,553,654,150	44,259,957,021
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,792,645	69,283,013
未払受託者報酬	5,478,891	6,710,774
未払委託者報酬	52,962,992	64,871,224
その他未払費用	524,545	596,568
流動負債合計	85,759,073	141,461,579
負債合計	85,759,073	141,461,579
純資産の部		
元本等		
元本	11,868,114,973	12,665,777,646
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	21,599,780,104	31,452,717,796
(分配準備積立金)	7,159,377,277	14,102,186,728
元本等合計	33,467,895,077	44,118,495,442
純資産合計	33,467,895,077	44,118,495,442
負債純資産合計	33,553,654,150	44,259,957,021

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21期	
	自	2022年2月26日 至 2023年2月27日	自	2023年2月28日 至 2024年2月26日
営業収益				
受取利息		7,754		10,769
有価証券売買等損益		1,596,608,483		8,281,536,578
営業収益合計		1,596,616,237		8,281,547,347
営業費用				
支払利息		379,300		454,786
受託者報酬		10,567,334		12,529,727
委託者報酬		102,151,632		121,121,525
その他費用		1,020,574		1,133,783
営業費用合計		114,118,840		135,239,821
営業利益又は営業損失(△)		1,482,497,397		8,146,307,526
経常利益又は経常損失(△)		1,482,497,397		8,146,307,526
当期純利益又は当期純損失(△)		1,482,497,397		8,146,307,526
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(△)		87,622,719		411,653,053
期首剰余金又は期首欠損金(△)		18,691,924,052		21,599,780,104
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,338,727,941		4,752,431,370
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		3,338,727,941		4,752,431,370
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,825,746,567		2,634,148,151
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,825,746,567		2,634,148,151
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(△)		21,599,780,104		31,452,717,796

(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21期	
	自 2023年2月28日	至 2024年2月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2023年2月27日、当計算期間末日を2024年2月26日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期
	2023年2月27日現在	2024年2月26日現在
1. 期首元本額	11,065,901,730円	11,868,114,973円
期中追加設定元本額	1,879,201,334円	2,230,886,992円
期中一部解約元本額	1,076,988,091円	1,433,224,319円
2. 受益権の総数	11,868,114,973口	12,665,777,646口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2022年2月26日 至 2023年2月27日	自 2023年2月28日 至 2024年2月26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(0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(1,395,059,799円)、信託約款に規定される収益調整金(14,440,762,454円)及び分配準備積立金(5,764,317,478円)より分配対象収益は21,600,139,731円(1万口当たり18,200.14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(0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(7,734,750,018円)、信託約款に規定される収益調整金(17,350,946,449円)及び分配準備積立金(6,367,436,710円)より分配対象収益は31,453,133,177円(1万口当たり24,833.16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20期	第21期
	自 2022年2月26日 至 2023年2月27日	自 2023年2月28日 至 2024年2月26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	同左

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>同左</p>
--------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26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	<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>	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20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26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	1,536,732,568	8,113,893,316
合計	1,536,732,568	8,113,893,316

(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20期 2023年2月27日現在	第21期 2024年2月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,820円 (28,200円)	3,483円 (34,833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

2024年2月26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	3,859,431,007	18,008,105,078	
	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	7,579,122,762	9,414,786,294	
	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	1,008,349,921	8,598,502,281	
	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド	2,916,905,681	6,792,014,878	
親投資信託受益証券	合計	15,363,809,371	42,813,408,531	
合計			42,813,408,531	

(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)

「D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「D I A M バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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)

2024年2月26日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,639,446,490
株式	554,603,550,290
派生商品評価勘定	869,335,710
未収配当金	758,743,311
差入委託証拠金	545,014,601
流動資産合計	570,416,090,402
資産合計	570,416,090,402
負債の部	
流動負債	
前受金	792,795,000
未払解約金	3,529,719,000
流動負債合計	4,322,514,000
負債合計	4,322,514,000
純資産の部	
元本等	
元本	121,324,101,032
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	444,769,475,370
元本等合計	566,093,576,402
純資産合計	566,093,576,402
負債純資産合計	570,416,090,402

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月28日
	至 2024年2月26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	2024年2月26日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	116,441,395,034円
同期中追加設定元本額	60,015,158,565円
同期中一部解約元本額	55,132,452,567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	2,456,592,576円
たわらノーロード 国内株式くらっ専用	3,295,882,867円
One DC 国内株式インデックスファンド	31,136,150,901円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,615,414,537円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	8,821,913円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,608,149円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	17,989,649円
たわらノーロード TOPIX	2,256,387,392円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス (堅実型)	47,484,290円
たわらノーロード バランス (標準型)	352,878,788円
たわらノーロード バランス (積極型)	607,683,019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)	2,251,159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)	141,973,889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)	409,420,755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)	352,810,839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)	481,107,960円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	354,451円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,368,776円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,608,219円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,827,773円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,193,315円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,466,075,190円
O n eグローバルバランス	44,410,502円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	895,699,678円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,302,701,027円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,859,431,007円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	288,206,993円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	959,707,882円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,085,071,047円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,070,522,519円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	282,382,237円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	332,825,964円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	561,215,599円
投資のソムリエ	8,000,617,019円
クルーズコントロール	376,994,748円
投資のソムリエ<DC年金>	791,599,868円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	312,033,504円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,095,783,511円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	899,828,907円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,915,969,406円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	79,256,153円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	40,575,661円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,224,956円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	177,810,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,104,346円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,363,308,339円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	225,467,592円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	80,685,240円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	43,107,354円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	26,468,340円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	501,741,918円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	6,256,314円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,609,480円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	31,354,781円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	348,992円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	282,142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)	718,558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)	200,478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)	20,951,104円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	715,577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)	179,053,363円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	173,190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）	82,171,987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）	373,974,618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）	425,851円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	260,041,270円
AMOne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）（適格機関投資家限定）	13,265,462円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	22,573,361円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	42,437,517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）	361,860円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,508,523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）	34,738,163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）	67,464,810円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,592,057円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	10,658,140円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,372,449円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	80,001円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	525,739円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	17,271,356円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	273,390,417円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	393,150,991円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,211,856,591円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	10,308,559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）	14,774,714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）	145,663,481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）	28,519,490円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	53,149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）	152,022,700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）	8,087,896円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	38,195,241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）	100,569,183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）	129,820,633円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	17,239,731円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	6,977,149円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,746,688円
コア資産形成ファンド	13,022,014円
MHAMトピックスファンド	778,065,573円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	44,609,227円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,030,548,533円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,852,289,009円
計	121,324,101,032円
2. 受益権の総数	121,324,101,032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 2023年2月28日 至 2024年2月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年2月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月26日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	25,655,800,560

合計	25,655,800,560
----	----------------

(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（2024年2月8日から2024年2月26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	2024年2月26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	12,863,505,000	—	13,733,010,000	869,505,000
合計	12,863,505,000	—	13,733,010,000	869,505,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年2月26日現在	
1口当たり純資産額	4.6660円
(1万口当たり純資産額)	(46,660円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年2月26日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,800	3,485.00	27,183,000	
ニッセイ	205,000	930.10	190,670,500	
マルハニチロ	30,400	2,901.00	88,190,400	
雪国まいたけ	17,500	997.00	17,447,500	
カネコ種苗	5,800	1,425.00	8,265,000	
サカタのタネ	23,300	3,670.00	85,511,000	
ホクト	16,400	1,831.00	30,028,400	
ホクリョウ	1,500	1,036.00	1,554,000	
ショーボンドホールディングス	27,900	6,318.00	176,272,200	
ミライト・ワン	67,800	1,775.50	120,378,900	
タマホーム	12,900	4,010.00	51,729,000	
サンヨーホームズ	1,100	764.00	840,400	
日本アクア	3,800	1,046.00	3,974,800	
ファーストコーポレーション	2,600	781.00	2,030,600	
ベステラ	2,200	1,096.00	2,411,200	

Robot Home	39,900	160.00	6,384,000
キャンディル	1,700	579.00	984,300
住石ホールディングス	23,200	2,306.00	53,499,200
日鉄鉱業	8,200	5,170.00	42,394,000
三井松島ホールディングス	12,100	3,050.00	36,905,000
I N P E X	758,200	1,984.00	1,504,268,800
石油資源開発	23,800	6,030.00	143,514,000
K&Oエナジーグループ	9,300	2,335.00	21,715,500
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,044.00	1,879,200
第一カッター興業	5,900	1,310.00	7,729,000
明豊ファシリティワークス	3,300	930.00	3,069,000
安藤・間	118,700	1,218.00	144,576,600
東急建設	64,200	820.00	52,644,000
コムシスホールディングス	65,500	3,366.00	220,473,000
ビーアールホールディングス	30,100	378.00	11,377,800
高松コンストラクショングループ	15,200	2,730.00	41,496,000
東建コーポレーション	5,200	9,590.00	49,868,000
ソネック	1,000	935.00	935,000
ヤマウラ	10,400	1,529.00	15,901,600
オリエンタル白石	75,800	383.00	29,031,400
大成建設	134,200	4,837.00	649,125,400
大林組	512,800	1,435.50	736,124,400
清水建設	406,600	906.10	368,420,260
飛島建設	14,800	1,466.00	21,696,800
長谷工コーポレーション	131,600	1,900.00	250,040,000
松井建設	13,400	845.00	11,323,000
銭高組	1,000	4,215.00	4,215,000
鹿島建設	318,000	2,792.00	887,856,000
不動テトラ	9,900	2,162.00	21,403,800
大末建設	2,500	1,621.00	4,052,500
鉄建建設	10,300	2,488.00	25,626,400
西松建設	27,400	4,489.00	122,998,600
三井住友建設	106,600	431.00	45,944,600
大豊建設	4,900	3,170.00	15,533,000
佐田建設	4,100	703.00	2,882,300
ナカノフドー建設	4,500	657.00	2,956,500
奥村組	23,200	5,100.00	118,320,000
東鉄工業	17,800	3,060.00	54,468,000
イチケン	1,600	2,452.00	3,923,200
富士ピー・エス	2,900	455.00	1,319,500
浅沼組	10,600	4,230.00	44,838,000
戸田建設	194,100	965.10	187,325,910
熊谷組	23,700	3,810.00	90,297,000
北野建設	1,200	3,160.00	3,792,000
植木組	1,800	1,757.00	3,162,600
矢作建設工業	19,500	1,549.00	30,205,500
ピーエス三菱	18,200	1,039.00	18,909,800
日本ハウスホールディングス	30,500	308.00	9,394,000
大東建託	52,800	17,370.00	917,136,000
新日本建設	20,100	1,279.00	25,707,900

東亜道路工業	5,700	6,400.00	36,480,000
日本道路	16,800	2,041.00	34,288,800
東亜建設工業	11,100	5,120.00	56,832,000
日本国土開発	40,800	527.00	21,501,600
若築建設	5,000	3,270.00	16,350,000
東洋建設	36,100	1,380.00	49,818,000
五洋建設	203,300	782.00	158,980,600
世紀東急工業	18,400	1,915.00	35,236,000
福田組	5,400	5,290.00	28,566,000
日本ドライケミカル	1,600	2,505.00	4,008,000
住友林業	123,900	4,285.00	530,911,500
日本基礎技術	3,800	452.00	1,717,600
巴コーポレーション	8,100	630.00	5,103,000
大和ハウス工業	396,600	4,379.00	1,736,711,400
ライト工業	29,500	1,914.00	56,463,000
積水ハウス	434,900	3,326.00	1,446,477,400
日特建設	13,700	1,153.00	15,796,100
北陸電気工事	9,800	1,229.00	12,044,200
ユアテック	31,600	1,270.00	40,132,000
日本リーテック	11,200	1,264.00	14,156,800
四電工	6,000	4,180.00	25,080,000
中電工	22,300	2,936.00	65,472,800
関電工	89,900	1,595.00	143,390,500
きんでん	101,000	2,624.00	265,024,000
東京エネシス	14,300	1,135.00	16,230,500
トーエネック	4,700	5,270.00	24,769,000
住友電設	13,700	3,070.00	42,059,000
日本電設工業	26,900	2,063.00	55,494,700
エクシオグループ	70,100	3,150.00	220,815,000
新日本空調	9,300	2,868.00	26,672,400
九電工	31,000	5,839.00	181,009,000
三機工業	31,000	1,955.00	60,605,000
日揮ホールディングス	141,900	1,379.00	195,680,100
中外炉工業	4,700	2,808.00	13,197,600
ヤマト	5,300	959.00	5,082,700
太平電業	8,900	4,345.00	38,670,500
高砂熱学工業	38,400	4,265.00	163,776,000
三晃金属工業	900	4,935.00	4,441,500
NEC ネットエスアイ	57,200	2,478.00	141,741,600
朝日工業社	6,700	3,045.00	20,401,500
明星工業	27,800	1,246.00	34,638,800
大気社	16,500	4,770.00	78,705,000
ダイダン	18,900	1,812.00	34,246,800
日比谷総合設備	10,400	2,595.00	26,988,000
ニッポン	43,100	2,373.00	102,276,300
日清製粉グループ本社	133,100	2,117.00	281,772,700
日東富士製粉	2,300	5,330.00	12,259,000
昭和産業	14,000	3,415.00	47,810,000
鳥越製粉	5,600	703.00	3,936,800
中部飼料	19,900	1,237.00	24,616,300

フィード・ワン	21,000	1,034.00	21,714,000
東洋精糖	1,200	2,677.00	3,212,400
日本甜菜製糖	8,400	2,131.00	17,900,400
DM三井製糖ホールディングス	14,300	3,215.00	45,974,500
塩水港精糖	8,400	308.00	2,587,200
ウェルネオシュガー	7,200	2,310.00	16,632,000
L I F U L L	51,300	173.00	8,874,900
M I X I	32,200	2,439.00	78,535,800
ジェイエイシーリクルートメント	54,300	733.00	39,801,900
日本M&Aセンターホールディングス	239,500	1,023.00	245,008,500
メンバーズ	5,100	923.00	4,707,300
中広	1,000	407.00	407,000
UTグループ	19,400	3,350.00	64,990,000
アイティメディア	5,700	1,950.00	11,115,000
ケアネット	23,100	650.00	15,015,000
E・Jホールディングス	8,800	1,683.00	14,810,400
オープンアップグループ	45,100	2,201.00	99,265,100
コシダカホールディングス	45,000	914.00	41,130,000
アルトナー	2,800	2,403.00	6,728,400
パソナグループ	18,200	2,832.00	51,542,400
CDS	1,700	1,711.00	2,908,700
リンクアンドモチベーション	43,300	598.00	25,893,400
エス・エム・エス	52,700	2,596.50	136,835,550
サニーサイドアップグループ	2,300	743.00	1,708,900
パーソルホールディングス	1,530,100	218.00	333,561,800
リニカル	4,300	422.00	1,814,600
クックパッド	41,100	130.00	5,343,000
エスクリ	2,700	319.00	861,300
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,300	735.00	2,425,500
森永製菓	61,600	2,711.50	167,028,400
中村屋	3,500	3,155.00	11,042,500
江崎グリコ	41,200	4,719.00	194,422,800
名糖産業	5,700	1,848.00	10,533,600
井村屋グループ	8,600	2,473.00	21,267,800
不二家	9,900	2,494.00	24,690,600
山崎製パン	96,400	3,739.00	360,439,600
第一屋製パン	1,200	748.00	897,600
モロゾフ	4,600	4,385.00	20,171,000
亀田製菓	8,200	4,365.00	35,793,000
寿スピリッツ	68,100	2,020.50	137,596,050
カルビー	65,900	3,166.00	208,639,400
森永乳業	50,300	3,109.00	156,382,700
六甲バター	10,600	1,360.00	14,416,000
ヤクルト本社	205,700	3,185.00	655,154,500
明治ホールディングス	176,500	3,394.00	599,041,000
雪印メグミルク	34,800	2,201.00	76,594,800
プリマハム	19,300	2,255.00	43,521,500
日本ハム	61,900	5,335.00	330,236,500
林兼産業	2,200	564.00	1,240,800
丸大食品	14,500	1,640.00	23,780,000

S Foods	15,900	3,190.00	50,721,000
柿安本店	5,600	2,642.00	14,795,200
伊藤ハム米久ホールディングス	22,000	4,115.00	90,530,000
学情	7,700	1,876.00	14,445,200
スタジオアリス	7,500	2,044.00	15,330,000
クロスキャット	9,300	1,232.00	11,457,600
エプロ	1,800	890.00	1,602,000
システナ	221,900	293.00	65,016,700
N J S	3,300	2,746.00	9,061,800
デジタルアーツ	9,300	4,505.00	41,896,500
日鉄ソリューションズ	25,000	4,965.00	124,125,000
総合警備保障	251,100	822.90	206,630,190
キューブシステム	7,800	1,111.00	8,665,800
いちご	165,900	402.00	66,691,800
日本駐車場開発	152,400	184.00	28,041,600
コア	6,500	1,879.00	12,213,500
カカコム	99,300	1,701.50	168,958,950
アイロムグループ	6,100	1,834.00	11,187,400
セントケア・ホールディング	11,000	906.00	9,966,000
サイネックス	1,100	855.00	940,500
ルネサンス	11,700	1,083.00	12,671,100
ディップ	23,000	2,660.00	61,180,000
S B Sホールディングス	13,000	2,417.00	31,421,000
デジタルホールディングス	7,800	1,165.00	9,087,000
新日本科学	13,700	1,650.00	22,605,000
キャリアデザインセンター	1,400	1,756.00	2,458,400
ベネフィット・ワン	52,200	2,168.00	113,169,600
エムスリー	297,000	2,100.00	623,700,000
ツカダ・グローバルホールディング	4,300	399.00	1,715,700
プラス	700	684.00	478,800
アウトソーシング	96,500	1,718.50	165,835,250
ウェルネット	5,900	545.00	3,215,500
ワールドホールディングス	6,800	2,486.00	16,904,800
ディー・エヌ・エー	53,400	1,248.00	66,643,200
博報堂D Yホールディングス	191,700	1,428.00	273,747,600
ぐるなび	28,000	296.00	8,288,000
タカミヤ	20,400	555.00	11,322,000
ファンコミュニケーションズ	21,000	404.00	8,484,000
ライク	5,600	1,549.00	8,674,400
A o b a - B B T	2,500	392.00	980,000
エスプール	43,200	315.00	13,608,000
W D Bホールディングス	7,700	2,290.00	17,633,000
手間いらず	2,500	2,819.00	7,047,500
ティア	3,900	464.00	1,809,600
C D G	800	1,231.00	984,800
アドウェイズ	20,700	494.00	10,225,800
パリュウコマース	13,200	1,137.00	15,008,400
インフォマート	156,000	432.00	67,392,000
サッポロホールディングス	47,400	6,816.00	323,078,400
アサヒグループホールディングス	332,700	5,311.00	1,766,969,700

麒麟ホールディングス	599,700	2,146.50	1,287,256,050
宝ホールディングス	98,300	1,208.50	118,795,550
オエノンホールディングス	43,000	346.00	14,878,000
養命酒製造	4,800	1,890.00	9,072,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	112,800	2,025.50	228,476,400
ライフドリンク カンパニー	2,100	4,845.00	10,174,500
サントリー食品インターナショナル	101,400	5,122.00	519,370,800
ダイドーグループホールディングス	16,300	3,105.00	50,611,500
伊藤園	48,800	4,263.00	208,034,400
キーコーヒー	16,100	2,048.00	32,972,800
ユニカフェ	2,200	906.00	1,993,200
ジャパンフーズ	1,000	1,366.00	1,366,000
日清オイリオグループ	20,300	5,240.00	106,372,000
不二製油グループ本社	33,500	2,437.50	81,656,250
かどや製油	800	3,905.00	3,124,000
J-オイルミルズ	16,500	1,944.00	32,076,000
ローソン	32,900	10,255.00	337,389,500
サンエー	11,800	4,570.00	53,926,000
カワチ薬品	12,100	2,755.00	33,335,500
エービーシー・マート	67,700	2,588.00	175,207,600
ハードオフコーポレーション	5,500	1,834.00	10,087,000
高千穂交易	4,900	4,005.00	19,624,500
アスクル	37,300	2,049.00	76,427,700
ゲオホールディングス	17,400	1,945.00	33,843,000
アダストリア	18,700	3,505.00	65,543,500
ジーフット	5,700	302.00	1,721,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	724.00	651,600
オルパヘルスケアホールディングス	1,100	1,865.00	2,051,500
伊藤忠食品	3,500	7,640.00	26,740,000
くら寿司	18,100	4,065.00	73,576,500
キャンドウ	5,500	2,705.00	14,877,500
エレマテック	13,900	1,808.00	25,131,200
I Kホールディングス	2,300	371.00	853,300
パルグループホールディングス	30,400	2,266.00	68,886,400
エディオン	61,200	1,519.00	92,962,800
あらた	23,700	3,285.00	77,854,500
サーラコーポレーション	32,500	800.00	26,000,000
ワッツ	3,300	609.00	2,009,700
トーマンデバイス	2,200	5,250.00	11,550,000
ハローズ	7,000	4,420.00	30,940,000
J Pホールディングス	38,400	452.00	17,356,800
フジオフードグループ本社	17,400	1,396.00	24,290,400
あみやき亭	3,700	4,415.00	16,335,500
東京エレクトロン デバイス	15,400	6,960.00	107,184,000
ひらまつ	16,400	251.00	4,116,400
円谷フィールドホールディングス	26,600	1,591.00	42,320,600
双日	172,300	3,844.00	662,321,200
アルフレッサ ホールディングス	155,300	2,293.50	356,180,550
大黒天物産	4,800	8,630.00	41,424,000

ハニーズホールディングス	13,700	1,654.00	22,659,800
ファーマライズホールディングス	1,600	652.00	1,043,200
キッコーマン	95,400	9,596.00	915,458,400
味の素	342,100	5,861.00	2,005,048,100
ブルドックソース	7,600	2,147.00	16,317,200
キューピー	77,400	2,765.50	214,049,700
ハウス食品グループ本社	49,600	3,130.00	155,248,000
カゴメ	61,900	3,503.00	216,835,700
焼津水産化学工業	2,800	1,350.00	3,780,000
アリアケジャパン	14,400	5,360.00	77,184,000
ピエトロ	900	1,821.00	1,638,900
エバラ食品工業	3,400	2,941.00	9,999,400
やまみ	900	3,775.00	3,397,500
ニチレイ	66,000	3,806.00	251,196,000
横浜冷凍	42,100	1,070.00	45,047,000
東洋水産	72,800	8,710.00	634,088,000
イトアンドホールディングス	6,800	2,112.00	14,361,600
大冷	1,000	1,931.00	1,931,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,500	1,256.00	8,164,000
日清食品ホールディングス	151,900	4,400.00	668,360,000
永谷園ホールディングス	7,100	2,214.00	15,719,400
一正蒲鉾	2,800	745.00	2,086,000
フジッコ	14,800	1,950.00	28,860,000
ロック・フィールド	17,600	1,668.00	29,356,800
日本たばこ産業	874,800	3,939.00	3,445,837,200
ケンコーマヨネーズ	9,900	2,100.00	20,790,000
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,827.00	27,139,200
なとり	9,100	2,177.00	19,810,700
イフジ産業	1,200	1,407.00	1,688,400
ファーマフーズ	20,700	949.00	19,644,300
北の達人コーポレーション	61,700	222.00	13,697,400
ユーグレナ	89,600	603.00	54,028,800
紀文食品	12,500	1,178.00	14,725,000
ピクルスホールディングス	8,400	1,246.00	10,466,400
スター・マイカ・ホールディングス	16,700	529.00	8,834,300
SREホールディングス	6,200	3,475.00	21,545,000
ADワークスグループ	16,100	232.00	3,735,200
片倉工業	13,500	1,822.00	24,597,000
グンゼ	10,400	5,580.00	58,032,000
ヒューリック	335,900	1,527.50	513,087,250
神栄	1,000	1,661.00	1,661,000
ラサ商事	6,300	1,965.00	12,379,500
アルペン	12,700	1,985.00	25,209,500
ハブ	2,200	806.00	1,773,200
ラクーンホールディングス	10,900	726.00	7,913,400
クオールホールディングス	21,300	1,644.00	35,017,200
アルコニックス	20,400	1,396.00	28,478,400
神戸物産	119,700	3,935.00	471,019,500
ソリトンシステムズ	7,600	1,361.00	10,343,600
ジンズホールディングス	9,200	3,985.00	36,662,000

ビックカメラ	82,300	1,311.00	107,895,300
DCMホールディングス	81,800	1,439.00	117,710,200
ペッパーフードサービス	35,800	127.00	4,546,600
ハイパー	1,600	304.00	486,400
MonotaRO	219,300	1,525.00	334,432,500
東京一番フーズ	1,700	520.00	884,000
DDグループ	4,400	1,423.00	6,261,200
あいホールディングス	24,800	2,351.00	58,304,800
ディーブイエックス	1,900	1,061.00	2,015,900
きちりホールディングス	1,800	955.00	1,719,000
J.フロントリテイリング	177,500	1,522.00	270,155,000
ドトール・日レスホールディングス	27,400	2,102.00	57,594,800
マツキヨココカラ&カンパニー	281,400	2,687.50	756,262,500
ブロンコビリー	9,100	3,280.00	29,848,000
ZOZO	98,600	3,380.00	333,268,000
トレジャー・ファクトリー	8,500	1,476.00	12,546,000
物語コーポレーション	25,800	4,605.00	118,809,000
三越伊勢丹ホールディングス	260,500	2,103.50	547,961,750
東洋紡	63,300	1,095.00	69,313,500
ユニチカ	47,300	158.00	7,473,400
富士紡ホールディングス	6,400	4,415.00	28,256,000
日清紡ホールディングス	111,000	1,286.50	142,801,500
倉敷紡績	10,400	3,330.00	34,632,000
ダイワボウホールディングス	68,500	2,666.50	182,655,250
シキボウ	7,700	1,200.00	9,240,000
日東紡績	18,600	5,750.00	106,950,000
トヨタ紡織	61,600	2,425.00	149,380,000
マクニカホールディングス	36,600	8,365.00	306,159,000
Hamee	6,200	1,107.00	6,863,400
マーケットエンタープライズ	600	836.00	501,600
ラクト・ジャパン	6,000	2,222.00	13,332,000
ウエルシアホールディングス	80,200	3,002.00	240,760,400
クリエイトSDホールディングス	21,900	3,275.00	71,722,500
グリムス	6,500	2,029.00	13,188,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,400	1,351.00	31,613,400
八洲電機	12,500	1,514.00	18,925,000
メディアスホールディングス	9,000	741.00	6,669,000
レスターホールディングス	13,200	3,030.00	39,996,000
ジオリーブグループ	1,600	1,338.00	2,140,800
丸善CHIホールディングス	8,300	327.00	2,714,100
大光	3,600	632.00	2,275,200
OCHIホールディングス	1,600	1,613.00	2,580,800
TOKAIホールディングス	84,000	1,009.00	84,756,000
黒谷	2,200	608.00	1,337,600
ミサワ	1,500	621.00	931,500
ティーライフ	900	1,398.00	1,258,200
Cominix	1,400	859.00	1,202,600
エー・ピーホールディングス	1,700	985.00	1,674,500
三洋貿易	17,500	1,335.00	23,362,500

チムニー	2,100	1,430.00	3,003,000
シュッピン	14,000	1,179.00	16,506,000
ビューティガレージ	4,900	2,299.00	11,265,100
オイシックス・ラ・大地	20,800	1,425.00	29,640,000
ウイン・パートナーズ	10,100	1,307.00	13,200,700
ネクステージ	35,300	2,316.00	81,754,800
ジョイフル本田	45,000	2,012.00	90,540,000
鳥貴族ホールディングス	5,700	4,160.00	23,712,000
ホットランド	11,800	1,840.00	21,712,000
すかいらーくホールディングス	211,400	2,168.50	458,420,900
SFPホールディングス	8,500	2,110.00	17,935,000
綿半ホールディングス	12,000	1,504.00	18,048,000
日本毛織	37,500	1,374.00	51,525,000
ダイトウボウ	10,400	92.00	956,800
トーア紡コーポレーション	2,500	421.00	1,052,500
ダイドーリミテッド	9,400	604.00	5,677,600
ヨシックスホールディングス	3,200	2,877.00	9,206,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,100	1,010.00	43,531,000
野村不動産ホールディングス	80,100	3,778.00	302,617,800
三重交通グループホールディングス	30,900	599.00	18,509,100
サムティ	22,900	2,470.00	56,563,000
ディア・ライフ	24,500	922.00	22,589,000
コーセーアールイー	2,000	881.00	1,762,000
地主	11,000	2,102.00	23,122,000
プレサンスコーポレーション	22,900	1,659.00	37,991,100
フィル・カンパニー	2,200	832.00	1,830,400
THEグローバル社	4,300	427.00	1,836,100
ハウスコム	1,000	956.00	956,000
JPMC	8,300	1,201.00	9,968,300
サンセイランディック	1,900	1,005.00	1,909,500
エストラスト	700	653.00	457,100
フージャースホールディングス	22,200	1,074.00	23,842,800
オープンハウスグループ	52,700	4,750.00	250,325,000
東急不動産ホールディングス	432,900	994.80	430,648,920
飯田グループホールディングス	138,000	1,940.00	267,720,000
イーグランド	1,000	1,568.00	1,568,000
ムゲンエステート	4,300	1,403.00	6,032,900
帝国繊維	16,500	2,151.00	35,491,500
日本コークス工業	148,700	118.00	17,546,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	612.00	4,284,000
ミタチ産業	1,900	1,185.00	2,251,500
BENOS	6,300	1,796.00	11,314,800
あさひ	14,300	1,293.00	18,489,900
日本調剤	10,500	1,439.00	15,109,500
コスモス薬品	13,100	14,810.00	194,011,000
シップヘルスケアホールディングス	55,600	2,124.50	118,122,200
トーエル	3,100	794.00	2,461,400
ソフトクリエイトホールディングス	12,100	1,967.00	23,800,700
セブン&アイ・ホールディングス	533,100	6,419.00	3,421,968,900

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	104,700	1,079.00	112,971,300
明治電機工業	5,800	1,511.00	8,763,800
ツルハホールディングス	32,500	12,165.00	395,362,500
デリカフーズホールディングス	3,000	588.00	1,764,000
スターティアホールディングス	1,800	1,561.00	2,809,800
サンマルクホールディングス	12,500	2,224.00	27,800,000
フェリシモ	1,500	924.00	1,386,000
トリドールホールディングス	43,400	4,246.00	184,276,400
帝人	140,700	1,257.50	176,930,250
東レ	981,200	695.30	682,228,360
クラレ	213,400	1,508.50	321,913,900
旭化成	990,800	1,049.00	1,039,349,200
TOKYO BASE	18,500	302.00	5,587,000
稲葉製作所	7,500	1,505.00	11,287,500
宮地エンジニアリンググループ	7,600	3,955.00	30,058,000
トーカロ	43,600	1,710.00	74,556,000
アルファ	2,400	1,603.00	3,847,200
SUMCO	268,000	2,374.00	636,232,000
川田テクノロジーズ	3,600	9,220.00	33,192,000
RS Technologies	10,100	2,822.00	28,502,200
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,056.00	2,467,200
信和	4,300	747.00	3,212,100
ビーロット	4,400	945.00	4,158,000
ファーストブラザーズ	1,300	1,270.00	1,651,000
And Doホールディングス	8,700	1,122.00	9,761,400
シーアールイー	8,000	1,312.00	10,496,000
ケイアイスター不動産	6,900	3,670.00	25,323,000
アグレ都市デザイン	1,100	1,635.00	1,798,500
グッドコムアセット	13,400	753.00	10,090,200
ジェイ・エス・ビー	7,200	2,729.00	19,648,800
ロードスターキャピタル	9,400	2,293.00	21,554,200
テンポイノベーション	1,900	923.00	1,753,700
グローバル・リンク・マネジメント	1,200	2,985.00	3,582,000
フェイスネットワーク	1,700	1,545.00	2,626,500
霞ヶ関キャピタル	3,900	14,190.00	55,341,000
住江織物	1,300	2,450.00	3,185,000
日本フェルト	3,700	435.00	1,609,500
イチカワ	800	1,765.00	1,412,000
エコナックホールディングス	5,800	136.00	788,800
日東製網	700	1,631.00	1,141,700
芦森工業	1,300	2,780.00	3,614,000
アツギ	4,500	601.00	2,704,500
ウイルプラスホールディングス	1,400	980.00	1,372,000
JMホールディングス	11,700	2,540.00	29,718,000
コメダホールディングス	37,900	2,756.00	104,452,400
サツドラホールディングス	2,800	820.00	2,296,000
アレンザホールディングス	11,600	1,134.00	13,154,400
串カツ田中ホールディングス	4,100	1,762.00	7,224,200
バロックジャパンリミテッド	12,000	844.00	10,128,000

クスリのアオキホールディングス	46,600	3,103.00	144,599,800
ダイニック	2,100	748.00	1,570,800
共和レザー	3,800	832.00	3,161,600
ピーバンドットコム	900	378.00	340,200
力の源ホールディングス	7,900	1,597.00	12,616,300
FOOD & LIFE COMPANIES	82,500	3,039.00	250,717,500
アセンテック	5,900	700.00	4,130,000
セーレン	28,300	2,502.00	70,806,600
ソトー	2,100	691.00	1,451,100
東海染工	600	818.00	490,800
小松マテーレ	21,200	784.00	16,620,800
ワコールホールディングス	30,000	3,655.00	109,650,000
ホギメディカル	19,300	3,555.00	68,611,500
クラウドディアホールディングス	1,500	398.00	597,000
T S I ホールディングス	47,600	705.00	33,558,000
マツオカコーポレーション	2,000	1,575.00	3,150,000
ワールド	20,700	1,965.00	40,675,500
T I S	160,400	3,419.00	548,407,600
テクミラホールディングス	3,000	481.00	1,443,000
グリー	49,100	493.00	24,206,300
GMOベパボ	1,800	1,412.00	2,541,600
コーエーテクモホールディングス	91,900	1,815.00	166,798,500
三菱総合研究所	7,200	4,920.00	35,424,000
ボルテージ	1,800	265.00	477,000
電算	800	1,508.00	1,206,400
A G S	2,700	910.00	2,457,000
ファインデックス	11,600	1,138.00	13,200,800
ブレインパッド	12,200	1,720.00	20,984,000
K L a b	26,900	359.00	9,657,100
ポールトゥウィンホールディングス	25,000	523.00	13,075,000
ネクソン	328,200	2,432.50	798,346,500
アイスタイル	47,800	448.00	21,414,400
エムアップホールディングス	18,000	1,034.00	18,612,000
エイチーム	8,700	572.00	4,976,400
エニグモ	18,600	356.00	6,621,600
テクノスジャパン	5,800	601.00	3,485,800
e n i s h	6,600	288.00	1,900,800
コロプラ	56,900	565.00	32,148,500
オルトプラス	5,800	140.00	812,000
ブロードリーフ	69,600	548.00	38,140,800
クロス・マーケティンググループ	3,100	598.00	1,853,800
デジタルハーツホールディングス	9,100	1,025.00	9,327,500
メディアドゥ	6,600	1,318.00	8,698,800
じげん	42,800	507.00	21,699,600
ブイキューブ	17,500	336.00	5,880,000
エンカレッジ・テクノロジー	1,500	626.00	939,000
サイバーリンクス	2,500	863.00	2,157,500
ディー・エル・イー	4,600	186.00	855,600
フィックスターズ	16,500	1,927.00	31,795,500

CARTA HOLDINGS	6,900	1,470.00	10,143,000
オブティム	15,100	1,174.00	17,727,400
セレス	5,900	1,602.00	9,451,800
SHIFT	9,700	26,270.00	254,819,000
特種東海製紙	8,000	3,815.00	30,520,000
ティーガイア	15,400	2,142.00	32,986,800
セック	1,800	5,000.00	9,000,000
テクマトリックス	26,800	2,083.00	55,824,400
プロシップ	7,100	1,469.00	10,429,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,200	2,227.00	85,071,400
GMOペイメントゲートウェイ	29,300	9,194.00	269,384,200
ザッパラス	1,500	439.00	658,500
システムリサーチ	5,000	3,410.00	17,050,000
インターネットイニシアティブ	70,100	2,808.00	196,840,800
さくらインターネット	16,500	6,430.00	106,095,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,500	2,850.00	12,825,000
SRAホールディングス	7,500	3,955.00	29,662,500
システムインテグレータ	2,000	431.00	862,000
朝日ネット	15,800	627.00	9,906,600
eBASE	20,700	750.00	15,525,000
アバントグループ	18,500	1,400.00	25,900,000
アドソル日進	6,200	1,650.00	10,230,000
ODKソリューションズ	1,300	600.00	780,000
フリービット	6,400	1,647.00	10,540,800
コムチュア	21,200	1,946.00	41,255,200
アステリア	11,500	692.00	7,958,000
アイル	6,800	3,640.00	24,752,000
王子ホールディングス	610,000	551.60	336,476,000
日本製紙	82,600	1,155.00	95,403,000
三菱製紙	8,800	567.00	4,989,600
北越コーポレーション	72,000	1,438.00	103,536,000
中越パルプ工業	2,600	1,801.00	4,682,600
巴川コーポレーション	1,800	939.00	1,690,200
大王製紙	64,700	1,090.50	70,555,350
阿波製紙	1,800	499.00	898,200
マークラインズ	7,900	3,205.00	25,319,500
メディカル・データ・ビジョン	17,500	580.00	10,150,000
gumi	23,800	405.00	9,639,000
ショーケース	1,500	313.00	469,500
モバイルファクトリー	1,400	734.00	1,027,600
テラスカイ	6,300	1,620.00	10,206,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	1,984.00	15,078,400
PCIホールディングス	2,400	947.00	2,272,800
アイビーシー	1,000	426.00	426,000
ネオジャパン	4,900	1,084.00	5,311,600
PR TIMES	2,900	1,936.00	5,614,400
ラクス	69,400	2,226.50	154,519,100

ランドコンピュータ	3,100	877.00	2,718,700
ダブルスタンダード	4,500	1,921.00	8,644,500
オープンドア	8,500	746.00	6,341,000
マイネット	2,100	407.00	854,700
アカツキ	7,000	2,578.00	18,046,000
ベネフィットジャパン	400	1,350.00	540,000
Ubicomホールディングス	4,600	1,388.00	6,384,800
カナミックネットワーク	15,800	517.00	8,168,600
ノムラシステムコーポレーション	7,100	115.00	816,500
レンゴー	133,400	1,011.50	134,934,100
トーモク	8,500	2,351.00	19,983,500
ザ・パック	10,900	3,735.00	40,711,500
チェンジホールディングス	31,900	1,500.00	47,850,000
シンクロ・フード	4,100	698.00	2,861,800
オークネット	5,400	2,209.00	11,928,600
キャピタル・アセット・プランニング	1,300	748.00	972,400
セグエグループ	2,100	2,132.00	4,477,200
エイトレッド	1,000	1,442.00	1,442,000
マクロミル	28,800	768.00	22,118,400
ビーグリー	1,400	1,148.00	1,607,200
オロ	5,300	2,732.00	14,479,600
ユーザーローカル	6,200	2,616.00	16,219,200
テモナ	1,500	232.00	348,000
ニーズウェル	3,600	956.00	3,441,600
マネーフォワード	32,700	5,873.00	192,047,100
サインポスト	2,500	606.00	1,515,000
レゾナック・ホールディングス	141,500	3,651.00	516,616,500
住友化学	1,086,700	308.60	335,355,620
住友精化	6,900	5,050.00	34,845,000
日産化学	68,800	6,254.00	430,275,200
ラサ工業	5,600	2,377.00	13,311,200
クレハ	32,000	2,712.00	86,784,000
多木化学	5,700	3,655.00	20,833,500
テイカ	12,700	1,449.00	18,402,300
石原産業	24,300	1,516.00	36,838,800
片倉コープアグリ	1,600	1,053.00	1,684,800
日本曹達	17,300	6,040.00	104,492,000
東ソー	195,500	2,039.50	398,722,250
トクヤマ	47,300	2,405.00	113,756,500
セントラル硝子	15,600	2,921.00	45,567,600
東亜合成	70,500	1,545.50	108,957,750
大阪ソーダ	10,200	10,850.00	110,670,000
関東電化工業	28,300	925.00	26,177,500
SUN ASTERISK	10,400	1,012.00	10,524,800
デンカ	53,300	2,510.50	133,809,650
イビデン	77,000	7,515.00	578,655,000
信越化学工業	1,328,100	6,416.00	8,521,089,600
日本カーバイド工業	6,200	1,820.00	11,284,000
プラスアルファ・コンサルティング	8,700	2,503.00	21,776,100
電算システムホールディングス	6,500	2,702.00	17,563,000

堺化学工業	11,100	1,949.00	21,633,900
第一稀元素化学工業	16,000	931.00	14,896,000
エア・ウォーター	138,200	2,199.00	303,901,800
日本酸素ホールディングス	142,100	4,261.00	605,488,100
日本化学工業	5,300	2,269.00	12,025,700
東邦アセチレン	6,900	393.00	2,711,700
日本パーカライジング	65,300	1,266.00	82,669,800
高压ガス工業	21,400	874.00	18,703,600
チタン工業	900	1,104.00	993,600
四国化成ホールディングス	18,700	1,792.00	33,510,400
戸田工業	3,300	1,680.00	5,544,000
ステラ ケミファ	7,900	3,925.00	31,007,500
保土谷化学工業	4,600	3,720.00	17,112,000
日本触媒	21,300	5,649.00	120,323,700
大日精化工業	10,200	2,709.00	27,631,800
カネカ	37,200	3,675.00	136,710,000
協和キリン	177,200	2,917.00	516,892,400
APPIER GROUP	50,100	1,910.00	95,691,000
三菱瓦斯化学	109,400	2,563.50	280,446,900
三井化学	120,800	4,183.00	505,306,400
JSR	159,500	4,023.00	641,668,500
東京応化工業	69,900	4,500.00	314,550,000
大阪有機化学工業	12,300	3,230.00	39,729,000
三菱ケミカルグループ	1,070,700	868.20	929,581,740
KHネオケム	22,300	2,237.00	49,885,100
ビジョナル	11,200	8,960.00	100,352,000
ダイセル	188,300	1,465.00	275,859,500
住友ベークライト	20,500	8,438.00	172,979,000
積水化学工業	294,300	2,114.00	622,150,200
日本ゼオン	100,400	1,298.00	130,319,200
アイカ工業	37,000	3,503.00	129,611,000
UBE	69,700	2,553.50	177,978,950
積水樹脂	21,900	2,516.00	55,100,400
タキロンシーアイ	37,400	645.00	24,123,000
旭有機材	9,700	4,040.00	39,188,000
ニチバン	7,900	1,856.00	14,662,400
リケンテクノス	31,600	967.00	30,557,200
大倉工業	6,800	3,100.00	21,080,000
積水化成成品工業	20,700	466.00	9,646,200
群栄化学工業	3,400	3,570.00	12,138,000
タイガースポリマー	3,000	1,160.00	3,480,000
ミライアル	2,200	1,531.00	3,368,200
ダイキアクシス	2,700	703.00	1,898,100
ダイキョーニシカワ	32,400	745.00	24,138,000
竹本容器	2,600	772.00	2,007,200
森六ホールディングス	7,600	2,745.00	20,862,000
恵和	10,500	1,153.00	12,106,500
日本化薬	111,900	1,303.50	145,861,650
カーリットホールディングス	15,800	1,058.00	16,716,400
ソルクシーズ	5,300	347.00	1,839,100

CLホールディングス	3,500	1,043.00	3,650,500
プレステージ・インターナショナル	70,400	617.00	43,436,800
フェイス	1,800	455.00	819,000
プロトコーポレーション	16,100	1,300.00	20,930,000
ハイマックス	4,500	1,404.00	6,318,000
アミューズ	9,200	1,497.00	13,772,400
野村総合研究所	324,900	4,179.00	1,357,757,100
ドリームインキュベータ	5,200	3,090.00	16,068,000
クイック	10,400	2,416.00	25,126,400
TAC	3,300	191.00	630,300
CEホールディングス	3,400	556.00	1,890,400
日本システム技術	5,400	3,570.00	19,278,000
電通グループ	147,700	4,239.00	626,100,300
インテージホールディングス	16,600	1,865.00	30,959,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,800	1,127.00	6,536,600
東邦システムサイエンス	5,500	1,298.00	7,139,000
ぴあ	5,000	3,170.00	15,850,000
イオンファンタジー	5,400	2,495.00	13,473,000
ソースネクスト	67,100	135.00	9,058,500
シーティーエス	19,000	753.00	14,307,000
NEXYZ. Group	2,100	631.00	1,325,100
インフォコム	18,900	2,344.00	44,301,600
メディカルシステムネットワーク	16,800	620.00	10,416,000
日本精化	9,700	2,614.00	25,355,800
扶桑化学工業	15,500	4,875.00	75,562,500
トリケミカル研究所	17,800	4,400.00	78,320,000
シンプレクス・ホールディングス	22,100	2,658.00	58,741,800
HEROZ	5,800	2,082.00	12,075,600
ラクスル	35,300	1,108.00	39,112,400
メルカリ	71,400	2,119.00	151,296,600
IPS	4,200	2,367.00	9,941,400
FIG	7,600	318.00	2,416,800
システムサポート	5,700	2,013.00	11,474,100
ADEKA	51,100	3,092.00	158,001,200
日油	44,200	7,111.00	314,306,200
ミヨシ油脂	2,500	1,290.00	3,225,000
新日本理化	8,900	207.00	1,842,300
ハリマ化成グループ	9,100	921.00	8,381,100
イーソル	10,600	971.00	10,292,600
東海ソフト	1,100	1,165.00	1,281,500
ウイングアーク1st	15,200	2,955.00	44,916,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,173.00	4,574,700
サーバーワークス	3,000	4,190.00	12,570,000
東名	500	2,430.00	1,215,000
ヴィッツ	600	770.00	462,000
トビラシステムズ	1,900	884.00	1,679,600
Sansan	48,100	1,647.00	79,220,700
Link-U	1,600	687.00	1,099,200
ギフトィ	12,900	1,422.00	18,343,800

花王	331,200	5,684.00	1,882,540,800
第一工業製薬	5,800	3,460.00	20,068,000
石原ケミカル	6,600	1,950.00	12,870,000
日華化学	2,600	900.00	2,340,000
ニイタカ	1,300	1,908.00	2,480,400
三洋化成工業	9,000	4,165.00	37,485,000
メドレー	19,700	4,870.00	95,939,000
ベース	5,100	3,510.00	17,901,000
JMDC	25,000	3,700.00	92,500,000
武田薬品工業	1,297,800	4,482.00	5,816,739,600
アステラス製薬	1,286,300	1,671.50	2,150,050,450
住友ファーマ	108,800	353.00	38,406,400
塩野義製薬	184,900	7,354.00	1,359,754,600
わかもと製薬	6,800	204.00	1,387,200
日本新薬	38,400	4,818.00	185,011,200
中外製薬	459,000	6,008.00	2,757,672,000
科研製薬	25,100	3,552.00	89,155,200
エーザイ	178,400	6,239.00	1,113,037,600
理研ビタミン	12,500	2,464.00	30,800,000
ロート製薬	142,100	3,037.00	431,557,700
小野薬品工業	311,200	2,440.00	759,328,000
久光製薬	32,600	4,028.00	131,312,800
有機合成薬品工業	5,200	309.00	1,606,800
持田製薬	16,900	3,240.00	54,756,000
参天製薬	267,200	1,567.00	418,702,400
扶桑薬品工業	5,200	2,255.00	11,726,000
日本ケミファ	700	1,614.00	1,129,800
ツムラ	46,200	2,743.50	126,749,700
テルモ	408,800	5,852.00	2,392,297,600
H. U. グループホールディングス	44,000	2,646.50	116,446,000
キッセイ薬品工業	24,300	3,365.00	81,769,500
生化学工業	24,900	742.00	18,475,800
栄研化学	26,900	1,856.00	49,926,400
鳥居薬品	7,900	4,115.00	32,508,500
JCRファーマ	49,600	899.00	44,590,400
東和薬品	22,500	2,893.00	65,092,500
富士製薬工業	10,800	1,717.00	18,543,600
ゼリア新薬工業	20,300	2,149.00	43,624,700
そーせいグループ	48,100	1,430.00	68,783,000
第一三共	1,277,500	5,107.00	6,524,192,500
杏林製薬	31,800	1,792.00	56,985,600
大幸薬品	30,300	325.00	9,847,500
ダイト	11,300	2,029.00	22,927,700
大塚ホールディングス	305,000	5,772.00	1,760,460,000
大正製薬ホールディングス	32,600	8,593.00	280,131,800
ペプチドリーム	71,100	1,521.50	108,178,650
大日本塗料	16,300	1,106.00	18,027,800
日本ペイントホールディングス	777,700	1,169.50	909,520,150
関西ペイント	143,500	2,270.00	325,745,000
神東塗料	5,300	127.00	673,100

中国塗料	30,100	2,167.00	65,226,700
日本特殊塗料	4,700	1,380.00	6,486,000
藤倉化成	16,800	467.00	7,845,600
太陽ホールディングス	25,500	3,240.00	82,620,000
D I C	57,200	2,985.50	170,770,600
サカタインクス	32,600	1,410.00	45,966,000
a r t i e n c e	31,900	2,883.00	91,967,700
T&K TOKA	14,000	1,408.00	19,712,000
アルプス技研	14,300	2,939.00	42,027,700
サニックス	24,100	310.00	7,471,000
日本空調サービス	16,200	895.00	14,499,000
オリエンタルランド	795,400	5,325.00	4,235,505,000
フォーカスシステムズ	9,800	1,150.00	11,270,000
ダスキン	33,500	3,355.00	112,392,500
パーク24	93,500	1,801.50	168,440,250
明光ネットワークジャパン	18,200	720.00	13,104,000
ファルコホールディングス	6,800	2,296.00	15,612,800
クレスコ	12,000	2,020.00	24,240,000
フジ・メディア・ホールディングス	140,900	1,894.50	266,935,050
秀英予備校	1,500	303.00	454,500
田谷	1,200	418.00	501,600
ラウンドワン	141,400	696.00	98,414,400
リゾートトラスト	65,300	2,578.50	168,376,050
オービック	49,000	22,815.00	1,117,935,000
ジャストシステム	21,100	2,715.00	57,286,500
TDCソフト	13,700	2,166.00	29,674,200
L I N Eヤフー	2,087,700	420.80	878,504,160
ビー・エム・エル	18,500	2,762.00	51,097,000
トレンドマイクロ	69,300	7,350.00	509,355,000
I Dホールディングス	9,900	1,690.00	16,731,000
リソー教育	76,800	236.00	18,124,800
日本オラクル	28,100	11,875.00	333,687,500
早稲田アカデミー	8,300	1,622.00	13,462,600
アルファシステムズ	3,900	3,470.00	13,533,000
フューチャー	31,300	1,651.00	51,676,300
C A C H o l d i n g s	7,900	1,800.00	14,220,000
S Bテクノロジー	6,200	2,216.00	13,739,200
トーセ	1,900	715.00	1,358,500
ユー・エス・エス	168,600	2,591.50	436,926,900
オービックビジネスコンサルタント	20,600	7,021.00	144,632,600
アイティフォー	18,800	1,417.00	26,639,600
東京個別指導学院	17,900	450.00	8,055,000
東計電算	4,100	3,475.00	14,247,500
サイバーエージェント	332,100	1,030.00	342,063,000
楽天グループ	1,288,300	788.00	1,015,180,400
エックスネット	1,000	1,136.00	1,136,000
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,943.00	14,766,800
S B I グローバルアセットマネジメン ト	29,400	755.00	22,197,000
テー・オー・ダブリュー	29,400	377.00	11,083,800

大塚商会	72,700	6,539.00	475,385,300
サイボウズ	20,200	1,997.00	40,339,400
山田コンサルティンググループ	6,500	1,824.00	11,856,000
セントラルスポーツ	5,600	2,434.00	13,630,400
パラカ	5,100	1,965.00	10,021,500
電通総研	17,800	5,380.00	95,764,000
ACCESS	15,200	1,088.00	16,537,600
デジタルガレージ	23,400	3,555.00	83,187,000
イーエムシステムズ	24,500	717.00	17,566,500
ウェザーニューズ	4,500	5,160.00	23,220,000
C I J	24,400	741.00	18,080,400
ビジネスエンジニアリング	2,800	4,135.00	11,578,000
日本エンタープライズ	6,600	124.00	818,400
WOWOW	11,000	1,111.00	12,221,000
スカラ	13,500	726.00	9,801,000
インテリジェント ウェイブ	3,500	1,247.00	4,364,500
フルキャストホールディングス	14,400	1,517.00	21,844,800
エン・ジャパン	24,500	2,609.00	63,920,500
セルソース	4,100	1,315.00	5,391,500
あすか製薬ホールディングス	15,000	2,058.00	30,870,000
サワイグループホールディングス	33,500	5,820.00	194,970,000
富士フイルムホールディングス	272,000	9,645.00	2,623,440,000
コニカミノルタ	329,800	467.30	154,115,540
資生堂	306,200	4,167.00	1,275,935,400
ライオン	191,900	1,324.00	254,075,600
高砂香料工業	11,000	3,400.00	37,400,000
マンダム	31,700	1,330.00	42,161,000
ミルボン	19,900	3,349.00	66,645,100
ファンケル	64,100	2,127.50	136,372,750
コーセー	29,800	8,456.00	251,988,800
コタ	13,500	1,591.00	21,478,500
シーボン	900	1,487.00	1,338,300
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	1,499.50	112,762,400
ノエビアホールディングス	13,100	5,240.00	68,644,000
アジュバンホールディングス	1,600	943.00	1,508,800
新日本製薬	8,400	1,708.00	14,347,200
I-n-e	2,900	2,074.00	6,014,600
アクシージア	7,200	851.00	6,127,200
エステー	11,300	1,541.00	17,413,300
アグロ カネショウ	5,900	1,270.00	7,493,000
コニシ	42,400	1,462.00	61,988,800
長谷川香料	28,000	3,110.00	87,080,000
小林製薬	42,700	6,033.00	257,609,100
荒川化学工業	12,400	1,122.00	13,912,800
メック	12,100	4,440.00	53,724,000
日本高純度化学	3,300	2,800.00	9,240,000
タカラバイオ	39,500	1,035.00	40,882,500
JCU	16,400	4,025.00	66,010,000
新田ゼラチン	4,400	678.00	2,983,200
OATアグリオ	4,800	1,703.00	8,174,400

デクセリアルズ	36,800	5,870.00	216,016,000
アース製薬	13,300	4,220.00	56,126,000
北興化学工業	14,800	1,212.00	17,937,600
大成ラミック	4,200	3,035.00	12,747,000
クミアイ化学工業	58,300	827.00	48,214,100
日本農薬	26,900	700.00	18,830,000
富士興産	1,900	2,072.00	3,936,800
ニチレキ	19,100	2,429.00	46,393,900
ユシロ化学工業	7,600	2,177.00	16,545,200
ビーピー・カストロール	2,500	906.00	2,265,000
富士石油	42,700	335.00	14,304,500
MORESCO	2,300	1,460.00	3,358,000
出光興産	814,300	935.00	761,370,500
ENEOSホールディングス	2,321,700	642.90	1,492,620,930
コスモエネルギーホールディングス	43,500	6,456.00	280,836,000
ANYCOLOR	15,500	3,070.00	47,585,000
テスホールディングス	30,900	477.00	14,739,300
インフロニア・ホールディングス	165,300	1,541.00	254,727,300
横浜ゴム	74,200	4,037.00	299,545,400
TOYO TIRE	84,300	2,846.00	239,917,800
ブリヂストン	429,200	6,410.00	2,751,172,000
住友ゴム工業	143,800	1,806.50	259,774,700
藤倉コンポジット	11,300	1,417.00	16,012,100
オカモト	6,900	4,805.00	33,154,500
アキレス	9,300	1,495.00	13,903,500
フコク	7,700	1,653.00	12,728,100
ニッタ	14,900	3,705.00	55,204,500
クリエートメディック	2,100	958.00	2,011,800
住友理工	22,800	1,145.00	26,106,000
三ツ星ベルト	17,800	4,925.00	87,665,000
バンドー化学	21,800	1,731.00	37,735,800
AGC	130,800	5,430.00	710,244,000
日本板硝子	69,900	521.00	36,417,900
石塚硝子	1,100	3,200.00	3,520,000
有沢製作所	25,700	1,152.00	29,606,400
日本山村硝子	2,400	1,530.00	3,672,000
日本電気硝子	59,800	3,578.00	213,964,400
オハラ	7,000	1,219.00	8,533,000
住友大阪セメント	24,400	3,575.00	87,230,000
太平洋セメント	86,700	3,224.00	279,520,800
リソルホールディングス	600	6,000.00	3,600,000
日本ヒューム	12,800	917.00	11,737,600
日本コンクリート工業	28,400	436.00	12,382,400
三谷セキサン	5,900	5,610.00	33,099,000
アジアパイルホールディングス	20,800	765.00	15,912,000
東海カーボン	135,300	1,000.50	135,367,650
日本カーボン	7,800	5,260.00	41,028,000
東洋炭素	10,300	6,810.00	70,143,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	8,070.00	65,367,000
TOTO	96,800	4,078.00	394,750,400

日本碍子	170,600	1,927.00	328,746,200
日本特殊陶業	122,800	4,504.00	553,091,200
ダントーホールディングス	4,300	947.00	4,072,100
MARUWA	5,400	32,750.00	176,850,000
品川リフラクトリーズ	18,100	2,048.00	37,068,800
黒崎播磨	3,000	14,590.00	43,770,000
ヨータイ	9,100	1,453.00	13,222,300
東京窯業	7,000	466.00	3,262,000
ニッカトー	3,000	580.00	1,740,000
フジミインコーポレーテッド	39,400	3,720.00	146,568,000
クニミネ工業	1,900	1,030.00	1,957,000
エーアンドエーマテリアル	1,400	1,337.00	1,871,800
ニチアス	37,100	3,800.00	140,980,000
日本製鉄	675,600	3,579.00	2,417,972,400
神戸製鋼所	303,400	2,041.50	619,391,100
中山製鋼所	34,600	920.00	31,832,000
合同製鐵	8,500	6,100.00	51,850,000
JFEホールディングス	419,600	2,418.00	1,014,592,800
東京製鐵	42,500	1,660.00	70,550,000
共英製鋼	17,300	2,352.00	40,689,600
大和工業	28,500	8,400.00	239,400,000
東京鐵鋼	6,700	5,440.00	36,448,000
大阪製鐵	7,000	2,307.00	16,149,000
淀川製鋼所	17,200	4,265.00	73,358,000
中部鋼板	9,900	2,487.00	24,621,300
丸一鋼管	46,000	4,022.00	185,012,000
モリ工業	2,600	5,180.00	13,468,000
大同特殊鋼	95,100	1,832.00	174,223,200
日本高周波鋼業	2,700	599.00	1,617,300
日本冶金工業	11,000	4,680.00	51,480,000
山陽特殊製鋼	15,000	2,203.00	33,045,000
愛知製鋼	8,700	3,615.00	31,450,500
日本金属	1,900	854.00	1,622,600
ミガロホールディングス	1,000	1,559.00	1,559,000
大平洋金属	12,900	1,367.00	17,634,300
新日本電工	75,400	297.00	22,393,800
栗本鐵工所	7,000	3,415.00	23,905,000
虹 技	900	1,513.00	1,361,700
日本鑄鐵管	800	1,177.00	941,600
日本製鋼所	40,700	2,566.00	104,436,200
三菱製鋼	11,200	1,450.00	16,240,000
日亜鋼業	7,400	348.00	2,575,200
日本精線	2,100	6,020.00	12,642,000
エンビプロ・ホールディングス	11,900	493.00	5,866,700
大紀アルミニウム工業所	19,200	1,215.00	23,328,000
日本輕金属ホールディングス	44,200	1,711.00	75,626,200
三井金属鋁業	43,900	4,421.00	194,081,900
東邦亜鉛	9,800	1,045.00	10,241,000
三菱マテリアル	108,000	2,587.50	279,450,000
住友金属鋁山	174,900	4,036.00	705,896,400

DOWAホールディングス	37,300	5,272.00	196,645,600
古河機械金属	20,000	1,786.00	35,720,000
エス・サイエンス	41,900	22.00	921,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	2,664.00	69,796,800
東邦チタニウム	31,200	1,711.00	53,383,200
UACJ	21,200	4,175.00	88,510,000
CKサンエツ	2,700	3,845.00	10,381,500
古河電気工業	50,200	2,947.00	147,939,400
住友電気工業	564,400	2,206.00	1,245,066,400
フジクラ	177,900	1,759.00	312,926,100
SWCC	16,900	3,390.00	57,291,000
タツタ電線	26,800	693.00	18,572,400
カナレ電気	1,100	1,719.00	1,890,900
平河ビューテック	9,600	1,311.00	12,585,600
いよぎんホールディングス	171,400	1,122.50	192,396,500
しずおかフィナンシャルグループ	320,000	1,461.50	467,680,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	121,300	1,105.50	134,097,150
楽天銀行	50,100	2,854.00	142,985,400
京都フィナンシャルグループ	182,500	2,614.00	477,055,000
リョービ	16,100	2,534.00	40,797,400
アーレスティ	7,400	779.00	5,764,600
AREホールディングス	56,800	1,943.00	110,362,400
東洋製罐グループホールディングス	86,600	2,507.00	217,106,200
ホッカンホールディングス	7,400	1,830.00	13,542,000
コロナ	8,600	967.00	8,316,200
横河ブリッジホールディングス	23,600	2,812.00	66,363,200
駒井ハルテック	1,200	2,051.00	2,461,200
高田機工	500	3,410.00	1,705,000
三和ホールディングス	151,600	2,652.00	402,043,200
文化シャッター	39,500	1,549.00	61,185,500
三協立山	19,000	870.00	16,530,000
アルインコ	11,500	1,046.00	12,029,000
東洋シャッター	1,500	723.00	1,084,500
LIXIL	235,500	1,948.00	458,754,000
日本フィルコン	4,400	541.00	2,380,400
ノーリツ	25,000	1,650.00	41,250,000
長府製作所	15,000	2,077.00	31,155,000
リンナイ	72,200	3,473.00	250,750,600
ユニプレス	26,200	1,066.00	27,929,200
ダイニチ工業	3,500	702.00	2,457,000
日東精工	21,900	585.00	12,811,500
三洋工業	800	3,795.00	3,036,000
岡部	26,900	766.00	20,605,400
ジーテクト	19,200	2,031.00	38,995,200
東プレ	26,600	2,413.00	64,185,800
高周波熱錬	23,300	1,055.00	24,581,500
東京製綱	9,800	1,510.00	14,798,000
サンコール	13,400	486.00	6,512,400
モリテックスチール	6,100	261.00	1,592,100
パイオラックス	18,700	2,721.00	50,882,700

エイチワン	15,500	672.00	10,416,000
日本発条	133,500	1,472.00	196,512,000
中央発條	11,200	743.00	8,321,600
アドバネクス	800	1,025.00	820,000
三浦工業	61,700	2,989.00	184,421,300
タクマ	49,900	1,860.00	92,814,000
テクノプロ・ホールディングス	88,000	3,177.00	279,576,000
アトラグループ	2,000	177.00	354,000
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	1,328.00	10,358,400
Ke e P e r 技研	9,300	6,590.00	61,287,000
ファーストロジック	1,600	502.00	803,200
三機サービス	1,200	1,415.00	1,698,000
G u n o s y	11,900	698.00	8,306,200
デザインワン・ジャパン	1,600	131.00	209,600
イー・ガーディアン	5,700	1,362.00	7,763,400
リブセンス	3,100	235.00	728,500
ジャパンマテリアル	46,000	2,543.00	116,978,000
ベクトル	18,400	1,231.00	22,650,400
ウチヤマホールディングス	2,800	371.00	1,038,800
チャーム・ケア・コーポレーション	12,500	1,356.00	16,950,000
キャリアリンク	5,500	2,638.00	14,509,000
I B J	11,500	612.00	7,038,000
アサンテ	7,400	1,675.00	12,395,000
バリューHR	13,100	1,359.00	17,802,900
M&Aキャピタルパートナーズ	12,200	2,508.00	30,597,600
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,000	1,066.00	6,396,000
E R I ホールディングス	1,900	1,885.00	3,581,500
アビスト	1,000	3,205.00	3,205,000
シグマクシス・ホールディングス	20,300	1,729.00	35,098,700
ウィルグループ	12,500	1,140.00	14,250,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,900	144.00	1,137,600
メドピア	13,200	789.00	10,414,800
レアジョブ	1,300	930.00	1,209,000
リクルートホールディングス	1,112,800	6,059.00	6,742,455,200
エラン	19,900	953.00	18,964,700
ツガミ	32,800	1,157.00	37,949,600
オークマ	12,900	7,121.00	91,860,900
芝浦機械	14,700	3,525.00	51,817,500
アマダ	235,600	1,636.00	385,441,600
アイダエンジニアリング	34,200	868.00	29,685,600
F U J I	69,500	2,606.50	181,151,750
牧野フライス製作所	16,300	6,140.00	100,082,000
オーエスジー	65,100	2,149.00	139,899,900
ダイジェット工業	700	856.00	599,200
旭ダイヤモンド工業	34,000	900.00	30,600,000
DMG森精機	89,500	3,454.00	309,133,000
ソディック	35,900	727.00	26,099,300
ディスコ	71,100	46,950.00	3,338,145,000

日東工器	7,200	1,924.00	13,852,800
日進工具	13,700	1,048.00	14,357,600
パンチ工業	6,400	425.00	2,720,000
富士ダイス	8,700	688.00	5,985,600
土木管理総合試験所	3,100	328.00	1,016,800
日本郵政	1,766,200	1,421.00	2,509,770,200
ベルシステム24ホールディングス	16,100	1,772.00	28,529,200
鎌倉新書	12,800	623.00	7,974,400
SMN	1,300	386.00	501,800
一蔵	800	581.00	464,800
グローバルキッズCOMPANY	1,200	671.00	805,200
エアトリ	11,000	1,551.00	17,061,000
アトラエ	8,900	469.00	4,174,100
ストライク	6,400	5,290.00	33,856,000
ソラスト	41,400	532.00	22,024,800
セラク	4,600	1,142.00	5,253,200
インソース	32,600	827.00	26,960,200
豊田自動織機	124,700	15,355.00	1,914,768,500
豊和工業	3,600	765.00	2,754,000
石川製作所	1,700	1,210.00	2,057,000
リケンNPR	16,000	2,985.00	47,760,000
東洋機械金属	5,400	745.00	4,023,000
津田駒工業	1,200	380.00	456,000
エンシュウ	1,500	673.00	1,009,500
島精機製作所	23,500	1,398.00	32,853,000
オプトラン	24,300	1,896.00	46,072,800
NCホールディングス	1,600	1,603.00	2,564,800
イワキ	9,800	2,481.00	24,313,800
フリーー	13,900	1,228.00	17,069,200
ヤマシンフィルタ	35,500	355.00	12,602,500
日阪製作所	16,100	992.00	15,971,200
やまびこ	24,100	1,792.00	43,187,200
野村マイクロ・サイエンス	5,000	16,270.00	81,350,000
平田機工	7,100	7,870.00	55,877,000
PEGASUS	16,300	437.00	7,123,100
マルマエ	6,400	1,985.00	12,704,000
タツモ	8,900	3,535.00	31,461,500
ナブテスコ	92,700	2,588.00	239,907,600
三井海洋開発	18,700	3,015.00	56,380,500
レオン自動機	17,100	1,441.00	24,641,100
SMC	44,200	88,090.00	3,893,578,000
ホソカワミクロン	9,500	4,285.00	40,707,500
ユニオンツール	6,500	3,880.00	25,220,000
瑞光	10,600	1,819.00	19,281,400
オイレス工業	20,100	2,030.00	40,803,000
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,450.00	26,255,000
サトーホールディングス	21,000	2,261.00	47,481,000
技研製作所	13,900	2,076.00	28,856,400
日本エアータック	6,900	1,169.00	8,066,100
カワタ	2,000	1,086.00	2,172,000

日精樹脂工業	11,000	1,152.00	12,672,000
オカダアイヨン	2,200	2,935.00	6,457,000
ワイエイシイホールディングス	5,500	2,307.00	12,688,500
小松製作所	692,200	4,318.00	2,988,919,600
住友重機械工業	87,400	4,538.00	396,621,200
日立建機	58,800	4,197.00	246,783,600
日工	21,900	763.00	16,709,700
巴工業	5,800	3,790.00	21,982,000
井関農機	13,800	1,009.00	13,924,200
TOWA	16,400	8,820.00	144,648,000
丸山製作所	1,100	2,320.00	2,552,000
北川鉄工所	5,800	1,576.00	9,140,800
シンニッタン	8,600	280.00	2,408,000
ローツェ	7,700	20,460.00	157,542,000
タカキタ	2,200	484.00	1,064,800
クボタ	772,000	2,159.00	1,666,748,000
荏原実業	7,800	3,035.00	23,673,000
東洋エンジニアリング	21,100	848.00	17,892,800
三菱化工機	5,200	3,780.00	19,656,000
月島ホールディングス	20,000	1,386.00	27,720,000
帝国電機製作所	10,400	2,707.00	28,152,800
東京機械製作所	1,700	448.00	761,600
新東工業	29,900	1,177.00	35,192,300
澁谷工業	13,900	3,165.00	43,993,500
アイチコーポレーション	20,600	1,093.00	22,515,800
小森コーポレーション	36,400	1,289.00	46,919,600
鶴見製作所	11,300	3,380.00	38,194,000
日本ギア工業	2,500	636.00	1,590,000
酒井重工業	2,300	6,410.00	14,743,000
荏原製作所	60,600	11,710.00	709,626,000
石井鐵工所	800	2,721.00	2,176,800
西島製作所	12,700	2,696.00	34,239,200
北越工業	14,800	2,355.00	34,854,000
ダイキン工業	176,300	21,325.00	3,759,597,500
オルガノ	17,700	7,120.00	126,024,000
トーヨーカネツ	5,000	4,440.00	22,200,000
栗田工業	82,600	5,859.00	483,953,400
椿本チエイン	20,900	4,645.00	97,080,500
大同工業	2,900	752.00	2,180,800
日機装	34,100	1,242.00	42,352,200
木村化工機	11,300	707.00	7,989,100
レイズネクスト	20,800	2,286.00	47,548,800
アネスト岩田	22,800	1,334.00	30,415,200
ダイフク	249,200	3,480.00	867,216,000
サムコ	4,000	5,730.00	22,920,000
加藤製作所	3,300	1,440.00	4,752,000
油研工業	1,100	2,419.00	2,660,900
タダノ	85,000	1,297.50	110,287,500
フジテック	34,500	3,854.00	132,963,000
CKD	40,900	2,890.00	118,201,000

平和	43,700	2,083.00	91,027,100
理想科学工業	11,800	3,285.00	38,763,000
SANKYO	34,000	8,724.00	296,616,000
日本金銭機械	17,800	1,324.00	23,567,200
マースグループホールディングス	7,500	2,938.00	22,035,000
フクシマガリレイ	9,700	5,690.00	55,193,000
オーイズミ	2,500	402.00	1,005,000
ダイコク電機	7,300	4,000.00	29,200,000
竹内製作所	26,800	5,400.00	144,720,000
アマノ	41,900	3,692.00	154,694,800
JUKI	22,800	489.00	11,149,200
サンデン	9,800	175.00	1,715,000
ジャノメ	15,000	694.00	10,410,000
ブラザー工業	197,300	2,515.00	496,209,500
マックス	20,800	3,070.00	63,856,000
モリタホールディングス	25,700	1,606.00	41,274,200
グローリー	35,400	2,911.00	103,049,400
新晃工業	14,900	3,190.00	47,531,000
大和冷機工業	22,700	1,484.00	33,686,800
セガサミーホールディングス	131,900	1,880.00	247,972,000
T P R	18,700	2,104.00	39,344,800
ツバキ・ナカシマ	29,700	762.00	22,631,400
ホシザキ	87,100	5,129.00	446,735,900
大豊工業	12,800	882.00	11,289,600
日本精工	273,400	811.20	221,782,080
NTN	320,300	299.50	95,929,850
ジェイテクト	131,400	1,384.50	181,923,300
不二越	10,900	3,360.00	36,624,000
ミネベアミツミ	256,900	3,073.00	789,453,700
日本トムソン	40,300	637.00	25,671,100
THK	85,200	3,187.00	271,532,400
ユウシン精機	11,800	697.00	8,224,600
前澤給装工業	11,300	1,307.00	14,769,100
イーグル工業	16,300	1,782.00	29,046,600
前澤工業	4,200	1,046.00	4,393,200
日本ピラー工業	13,700	5,620.00	76,994,000
キッツ	49,500	1,282.00	63,459,000
日立製作所	709,700	12,710.00	9,020,287,000
三菱電機	1,643,600	2,377.50	3,907,659,000
富士電機	89,800	9,061.00	813,677,800
東洋電機製造	2,300	1,070.00	2,461,000
安川電機	160,400	5,830.00	935,132,000
シンフォニア テクノロジー	16,300	2,643.00	43,080,900
明電舎	27,400	2,750.00	75,350,000
オリジン	1,500	1,225.00	1,837,500
山洋電気	6,400	6,280.00	40,192,000
デンヨー	11,300	2,310.00	26,103,000
PHCホールディングス	27,600	1,252.00	34,555,200
KOKUSAI ELECTRIC	57,100	4,680.00	267,228,000
ソシオネクスト	107,200	3,988.00	427,513,600

バイカレント・コンサルティング	110,500	3,154.00	348,517,000
Orchestra Holdings	3,200	1,091.00	3,491,200
アイモバイル	20,100	453.00	9,105,300
キャリアインデックス	2,300	176.00	404,800
MS-Japan	5,500	1,210.00	6,655,000
船場	1,400	1,261.00	1,765,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,700	2,187.00	106,506,900
フルテック	1,000	1,112.00	1,112,000
グリーンズ	2,400	2,143.00	5,143,200
ツナググループ・ホールディングス	1,900	810.00	1,539,000
GAMEWITH	2,800	304.00	851,200
MS&Consulting	1,000	591.00	591,000
ウェルビー	7,500	1,085.00	8,137,500
エル・ティール・エス	1,700	2,625.00	4,462,500
ミダックホールディングス	9,100	1,597.00	14,532,700
キュービーネットホールディングス	8,600	1,277.00	10,982,200
RPAホールディングス	20,400	261.00	5,324,400
三櫻工業	22,300	1,038.00	23,147,400
マキタ	168,400	3,827.00	644,466,800
東芝テック	18,900	3,125.00	59,062,500
芝浦メカトロニクス	8,400	6,800.00	57,120,000
マブチモーター	72,600	2,738.50	198,815,100
ニデック	326,000	5,712.00	1,862,112,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,300	354.00	3,292,200
トレックス・セミコンダクター	7,600	1,894.00	14,394,400
東光高岳	8,900	2,425.00	21,582,500
ダブル・スコープ	42,300	764.00	32,317,200
宮越ホールディングス	6,600	1,222.00	8,065,200
ダイヘン	14,800	7,450.00	110,260,000
ヤーマン	28,700	1,007.00	28,900,900
JVCケンウッド	116,600	737.00	85,934,200
ミマキエンジニアリング	14,000	1,007.00	14,098,000
I-PEX	10,200	1,901.00	19,390,200
大崎電気工業	32,300	673.00	21,737,900
オムロン	112,800	5,792.00	653,337,600
日東工業	19,900	4,320.00	85,968,000
IDEC	21,800	2,809.00	61,236,200
正興電機製作所	2,200	1,182.00	2,600,400
不二電機工業	1,300	1,136.00	1,476,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	57,600	2,815.00	162,144,000
サクサホールディングス	1,500	3,265.00	4,897,500
メルコホールディングス	4,600	3,225.00	14,835,000
テクノメディカ	3,500	1,760.00	6,160,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,500	658.00	3,619,000
日本電気	193,900	10,245.00	1,986,505,500
富士通	135,900	22,900.00	3,112,110,000
沖電気工業	66,800	1,060.00	70,808,000

岩崎通信機	3,100	648.00	2,008,800
電気興業	6,600	2,101.00	13,866,600
サンケン電気	13,700	7,740.00	106,038,000
ナカヨ	1,100	1,149.00	1,263,900
アイホン	8,000	2,816.00	22,528,000
ルネサスエレクトロニクス	963,800	2,579.00	2,485,640,200
セイコーエプソン	189,500	2,410.50	456,789,750
ワコム	112,300	628.00	70,524,400
アルバック	32,400	9,150.00	296,460,000
アクセル	5,900	2,109.00	12,443,100
E I Z O	10,800	5,100.00	55,080,000
ジャパンディスプレイ	636,300	23.00	14,634,900
日本信号	33,700	1,018.00	34,306,600
京三製作所	30,900	466.00	14,399,400
能美防災	20,000	2,230.00	44,600,000
ホーチキ	11,000	2,189.00	24,079,000
星和電機	2,900	520.00	1,508,000
エレコム	35,300	1,628.00	57,468,400
パナソニック ホールディングス	1,744,500	1,414.00	2,466,723,000
シャープ	248,900	831.50	206,960,350
アンリツ	104,000	1,176.00	122,304,000
富士通ゼネラル	41,900	2,000.50	83,820,950
ソニーグループ	1,034,300	13,035.00	13,482,100,500
T D K	233,800	7,886.00	1,843,746,800
帝国通信工業	6,500	1,906.00	12,389,000
タムラ製作所	58,800	566.00	33,280,800
アルプスアルパイン	131,900	1,057.50	139,484,250
池上通信機	2,000	819.00	1,638,000
日本電波工業	17,700	1,464.00	25,912,800
鈴木	7,900	1,169.00	9,235,100
メイコー	14,700	4,850.00	71,295,000
日本トリム	3,300	3,305.00	10,906,500
ローランド ディー. ジー.	8,100	5,010.00	40,581,000
フォスター電機	10,900	1,140.00	12,426,000
SMK	3,800	2,486.00	9,446,800
ヨコオ	13,000	1,604.00	20,852,000
ティアック	10,600	99.00	1,049,400
ホシデン	33,600	1,981.00	66,561,600
ヒロセ電機	21,800	16,045.00	349,781,000
日本航空電子工業	35,300	2,752.00	97,145,600
T O A	16,800	1,133.00	19,034,400
マクセル	32,600	1,589.00	51,801,400
古野電気	19,200	2,264.00	43,468,800
スミダコーポレーション	19,800	1,197.00	23,700,600
アイコム	5,700	3,420.00	19,494,000
リオン	6,100	2,908.00	17,738,800
横河電機	161,600	3,108.00	502,252,800
新電元工業	5,600	3,105.00	17,388,000
アズビル	100,600	4,541.00	456,824,600
東亜ディーケーケー	3,100	980.00	3,038,000

日本光電工業	62,700	4,086.00	256,192,200
チノー	6,100	2,325.00	14,182,500
共和電業	6,100	424.00	2,586,400
日本電子材料	9,000	2,124.00	19,116,000
堀場製作所	27,900	14,830.00	413,757,000
アドバンテスト	418,900	7,070.00	2,961,623,000
小野測器	2,700	620.00	1,674,000
エスペック	11,700	2,725.00	31,882,500
キーエンス	146,300	70,900.00	10,372,670,000
日置電機	6,900	6,700.00	46,230,000
シスメックス	126,200	8,131.00	1,026,132,200
日本マイクロニクス	26,300	7,070.00	185,941,000
メガチップス	11,600	4,150.00	48,140,000
OBARA GROUP	8,000	3,750.00	30,000,000
IMAGICA GROUP	14,700	705.00	10,363,500
澤藤電機	800	1,302.00	1,041,600
デンソー	1,206,300	2,749.50	3,316,721,850
原田工業	2,900	752.00	2,180,800
コーセル	15,600	1,546.00	24,117,600
イリソ電子工業	13,400	3,080.00	41,272,000
オブテックスグループ	26,800	1,825.00	48,910,000
千代田インテグレ	5,700	2,624.00	14,956,800
レーザーテック	67,000	40,120.00	2,688,040,000
スタンレー電気	93,600	2,570.00	240,552,000
ウシオ電機	74,300	2,032.00	150,977,600
岡谷電機産業	5,000	274.00	1,370,000
ヘリオス テクノ ホールディング	6,500	579.00	3,763,500
エノモト	1,800	1,626.00	2,926,800
日本セラミック	11,900	2,627.00	31,261,300
遠藤照明	2,900	1,550.00	4,495,000
古河電池	10,700	1,010.00	10,807,000
双信電機	2,600	294.00	764,400
山一電機	13,100	2,238.00	29,317,800
図研	12,700	4,460.00	56,642,000
日本電子	36,600	6,667.00	244,012,200
カシオ計算機	105,600	1,205.50	127,300,800
ファナック	713,000	4,285.00	3,055,205,000
日本シイエムケイ	31,100	600.00	18,660,000
エンプラス	4,300	8,600.00	36,980,000
大真空	21,800	916.00	19,968,800
ローム	270,300	2,615.50	706,969,650
浜松ホトニクス	117,300	5,460.00	640,458,000
三井ハイテック	12,900	8,231.00	106,179,900
新光電気工業	51,700	5,472.00	282,902,400
京セラ	908,500	2,235.00	2,030,497,500
協栄産業	700	2,935.00	2,054,500
太陽誘電	71,200	3,362.00	239,374,400
村田製作所	1,330,300	3,026.00	4,025,487,800
双葉電子工業	27,800	512.00	14,233,600
日東電工	94,200	13,955.00	1,314,561,000

北陸電気工業	2,400	1,429.00	3,429,600	
東海理化電機製作所	41,200	2,500.00	103,000,000	
ニチコン	38,400	1,236.00	47,462,400	
日本ケミコン	15,600	1,336.00	20,841,600	
KOA	22,100	1,500.00	33,150,000	
三井E&S	73,300	1,744.00	127,835,200	
日立造船	130,300	1,151.00	149,975,300	
三菱重工業	258,200	11,720.00	3,026,104,000	
川崎重工業	119,400	4,118.00	491,689,200	
IHI	109,900	3,226.00	354,537,400	
名村造船所	36,400	2,000.00	72,800,000	
サノヤスホールディングス	9,600	147.00	1,411,200	
スプリックス	1,900	814.00	1,546,600	
マネジメントソリューションズ	6,400	2,915.00	18,656,000	
プロレド・パートナーズ	3,500	359.00	1,256,500	
and factory	2,000	314.00	628,000	
テノ・ホールディングス	800	496.00	396,800	
フロンティア・マネジメント	3,800	1,890.00	7,182,000	
ピアラ	1,200	326.00	391,200	
コプロ・ホールディングス	2,200	1,795.00	3,949,000	
ギークス	900	488.00	439,200	
アンビスホールディングス	16,100	2,518.00	40,539,800	
カーブスホールディングス	41,100	724.00	29,756,400	
フォーラムエンジニアリング	20,500	967.00	19,823,500	
FAST FITNESS JAPAN	5,100	954.00	4,865,400	
日本車輛製造	4,800	2,362.00	11,337,600	
三菱ロジスネクスト	23,300	1,450.00	33,785,000	
近畿車輛	900	2,566.00	2,309,400	
一家ホールディングス	1,700	704.00	1,196,800	
フルサト・マルカホールディングス	13,800	2,241.00	30,925,800	
ヤマエグループホールディングス	8,700	2,710.00	23,577,000	
ジャパングラフトホールディングス	4,900	166.00	813,400	
FPG	48,700	1,823.00	88,780,100	
島根銀行	1,900	518.00	984,200	
じもとホールディングス	5,600	551.00	3,085,600	
全国保証	37,700	5,546.00	209,084,200	
めぶきフィナンシャルグループ	714,500	455.40	325,383,300	
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,400	866.00	20,264,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,400	4,245.00	78,108,000	
九州フィナンシャルグループ	278,700	992.70	276,665,490	
かんぽ生命保険	146,600	2,716.00	398,165,600	
ゆうちょ銀行	1,582,400	1,540.00	2,436,896,000	
あんしん保証	2,900	250.00	725,000	
富山第一銀行	45,700	890.00	40,673,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	772,700	749.00	578,752,300	
ジェイリース	4,300	2,648.00	11,386,400	
西日本フィナンシャルホールディング	81,300	1,675.00	136,177,500	

ス				
イントラスト	2,500	805.00	2,012,500	
日本モーゲージサービス	3,500	528.00	1,848,000	
CASA	2,500	810.00	2,025,000	
SBIアルヒ	13,800	903.00	12,461,400	
プレミアグループ	24,300	1,755.00	42,646,500	
日産自動車	1,973,100	573.40	1,131,375,540	
いすゞ自動車	425,100	2,140.50	909,926,550	
トヨタ自動車	8,028,600	3,565.00	28,621,959,000	
日野自動車	219,900	473.20	104,056,680	
三菱自動車工業	570,400	453.20	258,505,280	
エフテック	4,500	720.00	3,240,000	
レシップホールディングス	2,800	723.00	2,024,400	
GMB	1,300	1,133.00	1,472,900	
ファルテック	1,300	542.00	704,600	
武蔵精密工業	35,700	1,668.00	59,547,600	
日産車体	14,800	962.00	14,237,600	
新明和工業	42,100	1,224.00	51,530,400	
極東開発工業	24,200	2,410.00	58,322,000	
トピー工業	11,900	3,010.00	35,819,000	
ティラド	3,200	3,795.00	12,144,000	
曙ブレーキ工業	89,100	113.00	10,068,300	
タチエス	27,000	2,017.00	54,459,000	
NOK	56,800	2,103.50	119,478,800	
フタバ産業	39,200	1,061.00	41,591,200	
カヤバ	14,100	5,070.00	71,487,000	
市光工業	26,400	532.00	14,044,800	
大同メタル工業	28,600	561.00	16,044,600	
プレス工業	58,400	660.00	38,544,000	
ミクニ	8,200	466.00	3,821,200	
太平洋工業	33,500	1,477.00	49,479,500	
河西工業	10,300	254.00	2,616,200	
アイシン	112,800	5,571.00	628,408,800	
マツダ	483,600	1,801.50	871,205,400	
今仙電機製作所	4,100	663.00	2,718,300	
本田技研工業	3,565,600	1,785.00	6,364,596,000	
スズキ	268,500	6,792.00	1,823,652,000	
SUBARU	453,400	3,340.00	1,514,356,000	
安永	2,800	746.00	2,088,800	
ヤマハ発動機	631,900	1,374.00	868,230,600	
小糸製作所	151,500	1,906.00	288,759,000	
TBK	7,000	409.00	2,863,000	
エクセディ	23,900	2,897.00	69,238,300	
ミツバ	27,400	1,327.00	36,359,800	
豊田合成	41,900	2,998.50	125,637,150	
愛三工業	24,200	1,517.00	36,711,400	
盟和産業	900	1,016.00	914,400	
日本プラスト	5,500	555.00	3,052,500	
ヨロズ	13,700	927.00	12,699,900	
エフ・シー・シー	25,900	2,123.00	54,985,700	

新家工業	1,500	3,935.00	5,902,500
シマノ	59,100	20,735.00	1,225,438,500
テイ・エス テック	52,000	1,959.50	101,894,000
三十三フィナンシャルグループ	12,900	1,927.00	24,858,300
第四北越フィナンシャルグループ	22,600	4,210.00	95,146,000
ひろぎんホールディングス	205,000	1,043.50	213,917,500
マーキュリアホールディングス	3,300	945.00	3,118,500
おきなわフィナンシャルグループ	12,300	2,485.00	30,565,500
ダイレクトマーケティングミックス	15,500	299.00	4,634,500
ポピンズ	2,200	1,455.00	3,201,000
LITALICO	11,700	2,163.00	25,307,100
コンフィデンス・インターワークス	600	1,639.00	983,400
十六フィナンシャルグループ	18,700	4,240.00	79,288,000
北國フィナンシャルホールディングス	15,200	4,765.00	72,428,000
ネットプロテクションズホールディングス	47,700	191.00	9,110,700
プロクレアホールディングス	16,500	1,842.00	30,393,000
FPパートナー	2,900	6,990.00	20,271,000
あいちフィナンシャルグループ	22,200	2,610.00	57,942,000
ジャムコ	7,100	1,330.00	9,443,000
小野建	15,400	1,775.00	27,335,000
はるやまホールディングス	3,300	597.00	1,970,100
南陽	1,400	2,584.00	3,617,600
ノジマ	44,900	1,662.00	74,623,800
佐島電機	8,600	2,420.00	20,812,000
カッパ・クリエイト	24,300	1,663.00	40,410,900
エコートレーディング	1,300	1,236.00	1,606,800
伯東	8,900	5,880.00	52,332,000
コンドーテック	11,900	1,300.00	15,470,000
中山福	3,900	362.00	1,411,800
ライトオン	5,200	410.00	2,132,000
ナガイレーベン	19,600	2,307.00	45,217,200
三菱食品	14,300	5,180.00	74,074,000
良品計画	168,900	2,294.00	387,456,600
パリミキホールディングス	8,600	423.00	3,637,800
松田産業	11,800	2,384.00	28,131,200
第一興商	59,900	1,918.50	114,918,150
メディバルホールディングス	157,300	2,309.50	363,284,350
アドヴァングループ	14,700	1,176.00	17,287,200
SPK	6,900	2,061.00	14,220,900
萩原電気ホールディングス	6,600	4,745.00	31,317,000
アルビス	5,000	2,625.00	13,125,000
アズワン	24,200	5,285.00	127,897,000
スズデン	5,400	2,239.00	12,090,600
尾家産業	1,600	1,734.00	2,774,400
シモジマ	10,400	1,293.00	13,447,200
ドウシヤ	14,300	2,136.00	30,544,800
小津産業	1,500	1,671.00	2,506,500
コナカ	7,400	413.00	3,056,200
高速	9,200	2,373.00	21,831,600

ハウス オブ ローゼ	900	1,631.00	1,467,900
G-7ホールディングス	16,900	1,459.00	24,657,100
たけびし	5,900	1,981.00	11,687,900
イオン北海道	45,700	925.00	42,272,500
コジマ	25,600	756.00	19,353,600
ヒマラヤ	2,200	946.00	2,081,200
コーナン商事	19,000	4,090.00	77,710,000
ネットワンシステムズ	59,200	2,649.50	156,850,400
エコス	5,700	2,345.00	13,366,500
ワタミ	16,400	1,019.00	16,711,600
マルシェ	2,500	241.00	602,500
リックス	2,600	3,785.00	9,841,000
システムソフト	50,800	59.00	2,997,200
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	312,400	3,477.00	1,086,214,800
丸文	13,800	1,500.00	20,700,000
西松屋チェーン	30,400	2,267.00	68,916,800
ゼンショーホールディングス	78,800	6,569.00	517,637,200
ハピネット	13,200	3,320.00	43,824,000
幸楽苑ホールディングス	11,400	1,391.00	15,857,400
ハークスレイ	2,400	942.00	2,260,800
橋本総業ホールディングス	6,100	1,309.00	7,984,900
日本ライフライン	45,400	1,288.00	58,475,200
サイゼリヤ	22,900	4,900.00	112,210,000
タカショー	13,500	505.00	6,817,500
VTホールディングス	58,800	517.00	30,399,600
アルゴグラフィックス	13,500	4,245.00	57,307,500
魚力	5,400	2,408.00	13,003,200
IDOM	40,900	937.00	38,323,300
日本エム・ディ・エム	11,600	725.00	8,410,000
ポプラ	1,800	295.00	531,000
フジ・コーポレーション	7,400	1,826.00	13,512,400
ユナイテッドアローズ	18,200	1,755.00	31,941,000
進和	9,500	2,469.00	23,455,500
エスケイジャパン	1,700	719.00	1,222,300
ダイトロン	6,100	2,958.00	18,043,800
ハイデイ日高	22,900	2,714.00	62,150,600
シークス	22,000	1,652.00	36,344,000
YU-WA CREATION HOLDINGS	3,700	145.00	536,500
コロワイド	66,500	2,248.50	149,525,250
田中商事	1,900	818.00	1,554,200
オーハシテクニカ	8,100	1,765.00	14,296,500
壺番屋	12,200	6,030.00	73,566,000
白銅	4,500	2,585.00	11,632,500
トップカルチャー	2,200	152.00	334,400
PLANT	1,500	1,810.00	2,715,000
スギホールディングス	31,200	7,336.00	228,883,200
ダイコー通産	700	1,223.00	856,100
薬王堂ホールディングス	7,600	2,863.00	21,758,800

島津製作所	194,300	3,926.00	762,821,800
JMS	13,400	519.00	6,954,600
クボテック	1,800	230.00	414,000
長野計器	10,600	2,227.00	23,606,200
ブイ・テクノロジー	7,700	2,715.00	20,905,500
スター精密	27,500	1,743.00	47,932,500
東京計器	11,200	2,322.00	26,006,400
愛知時計電機	6,300	2,520.00	15,876,000
インターアクション	8,800	1,244.00	10,947,200
オーバル	5,700	532.00	3,032,400
東京精密	29,900	10,225.00	305,727,500
マニー	58,500	2,061.00	120,568,500
ニコン	211,400	1,527.50	322,913,500
トプコン	71,100	1,780.00	126,558,000
オリンパス	900,000	2,240.00	2,016,000,000
理研計器	10,400	7,720.00	80,288,000
SCREENホールディングス	50,000	19,205.00	960,250,000
キヤノン電子	16,200	2,231.00	36,142,200
タムロン	9,000	6,370.00	57,330,000
HOYA	287,800	19,160.00	5,514,248,000
シード	3,300	711.00	2,346,300
ノーリツ鋼機	13,900	3,140.00	43,646,000
A&Dホロンホールディングス	21,300	2,241.00	47,733,300
朝日インテック	178,200	2,922.50	520,789,500
キヤノン	729,300	4,294.00	3,131,614,200
リコー	366,600	1,249.50	458,066,700
シチズン時計	134,500	1,066.00	143,377,000
リズム	1,500	3,910.00	5,865,000
大研医器	5,600	524.00	2,934,400
メニコン	50,300	1,770.50	89,056,150
シンシア	800	510.00	408,000
KYORITSU	9,700	192.00	1,862,400
中本パックス	2,100	1,737.00	3,647,700
スノーピーク	20,800	1,247.00	25,937,600
パラマウントベッドホールディングス	30,400	2,468.00	75,027,200
トランザクション	9,600	2,433.00	23,356,800
粧美堂	1,800	701.00	1,261,800
ニホンフラッシュ	13,700	966.00	13,234,200
前田工織	12,400	3,540.00	43,896,000
永大産業	7,500	287.00	2,152,500
アートネイチャー	13,200	777.00	10,256,400
フルヤ金属	3,500	10,210.00	35,735,000
バンダイナムコホールディングス	400,600	3,008.00	1,205,004,800
アイフィスジャパン	1,900	636.00	1,208,400
SHOEI	33,100	2,090.00	69,179,000
フランスベッドホールディングス	19,000	1,319.00	25,061,000
マーベラス	23,800	735.00	17,493,000
パイロットコーポレーション	20,600	4,000.00	82,400,000
萩原工業	9,800	1,527.00	14,964,600
エイベックス	25,000	1,331.00	33,275,000

フジシールインターナショナル	29,600	2,130.00	63,048,000
タカラトミー	66,600	2,461.00	163,902,600
広済堂ホールディングス	37,600	660.00	24,816,000
エステールホールディングス	1,700	646.00	1,098,200
レック	18,800	1,087.00	20,435,600
タカノ	2,400	1,055.00	2,532,000
三光合成	18,500	656.00	12,136,000
プロネクス	15,200	1,242.00	18,878,400
ホクシン	4,800	116.00	556,800
ウッドワン	2,400	1,055.00	2,532,000
きもと	10,700	209.00	2,236,300
TOPPANホールディングス	179,700	3,586.00	644,404,200
大日本印刷	159,800	4,516.00	721,656,800
共同印刷	4,100	3,155.00	12,935,500
NISSHA	25,000	1,507.00	37,675,000
光村印刷	500	1,634.00	817,000
藤森工業	11,600	3,920.00	45,472,000
ヴィア・ホールディングス	10,200	137.00	1,397,400
TAKARA & COMPANY	8,600	2,805.00	24,123,000
前澤化成工業	9,400	1,611.00	15,143,400
未来工業	5,300	5,400.00	28,620,000
アシックス	124,600	6,211.00	773,890,600
ツツミ	2,400	2,094.00	5,025,600
ウェーブロックホールディングス	2,400	679.00	1,629,600
JSP	10,300	2,276.00	23,442,800
ニチハ	18,400	3,420.00	62,928,000
ローランド	10,800	4,695.00	50,706,000
エフピコ	27,700	2,779.00	76,978,300
小松ウオール工業	6,000	3,400.00	20,400,000
ヤマハ	92,200	3,205.00	295,501,000
河合楽器製作所	4,400	3,430.00	15,092,000
クリナップ	14,300	753.00	10,767,900
ピジョン	93,100	1,520.00	141,512,000
天馬	10,700	2,380.00	25,466,000
キングジム	13,000	880.00	11,440,000
象印マホービン	39,700	1,443.00	57,287,100
リンテック	29,400	3,020.00	88,788,000
信越ポリマー	31,600	1,607.00	50,781,200
東リ	14,400	393.00	5,659,200
イトーキ	30,000	1,673.00	50,190,000
任天堂	923,100	8,549.00	7,891,581,900
三菱鉛筆	20,800	2,392.00	49,753,600
松風	6,600	2,697.00	17,800,200
タカラスタンダード	30,800	1,848.00	56,918,400
コクヨ	59,900	2,483.00	148,731,700
ナカバヤシ	15,700	531.00	8,336,700
ニフコ	43,900	3,564.00	156,459,600
立川ブラインド工業	6,800	1,485.00	10,098,000
グローブライド	13,100	1,995.00	26,134,500
オカムラ	44,100	2,185.00	96,358,500

バルカー	12,300	4,590.00	56,457,000
MUTOHホールディングス	900	2,247.00	2,022,300
伊藤忠商事	1,039,900	6,653.00	6,918,454,700
丸紅	1,289,800	2,548.50	3,287,055,300
スクロール	23,000	927.00	21,321,000
高島	4,700	1,380.00	6,486,000
ヨンドシーホールディングス	14,600	1,973.00	28,805,800
三陽商会	5,500	2,800.00	15,400,000
長瀬産業	70,900	2,495.00	176,895,500
ナイガイ	2,100	254.00	533,400
蝶理	9,700	3,135.00	30,409,500
豊田通商	135,500	9,330.00	1,264,215,000
オンワードホールディングス	86,300	524.00	45,221,200
三共生興	21,500	772.00	16,598,000
兼松	64,700	2,391.00	154,697,700
美津濃	14,500	5,430.00	78,735,000
ツカモトコーポレーション	1,000	1,295.00	1,295,000
ルックホールディングス	4,100	2,489.00	10,204,900
三井物産	1,165,600	6,590.00	7,681,304,000
日本紙パルプ商事	7,400	5,020.00	37,148,000
東京エレクトロン	309,500	36,000.00	11,142,000,000
カメイ	16,400	1,871.00	30,684,400
東都水産	400	6,260.00	2,504,000
OUGホールディングス	1,000	2,593.00	2,593,000
スターゼン	10,700	2,784.00	29,788,800
セイコーグループ	20,400	3,305.00	67,422,000
山善	46,900	1,279.00	59,985,100
椿本興業	3,100	7,070.00	21,917,000
住友商事	936,300	3,613.00	3,382,851,900
BIPROGY	48,000	4,682.00	224,736,000
内田洋行	6,300	7,800.00	49,140,000
三菱商事	3,065,300	3,300.00	10,115,490,000
第一実業	14,600	1,986.00	28,995,600
キャノンマーケティングジャパン	35,800	4,315.00	154,477,000
西華産業	6,100	2,995.00	18,269,500
佐藤商事	10,900	1,769.00	19,282,100
菱洋エレクトロ	14,700	4,075.00	59,902,500
東京産業	14,100	730.00	10,293,000
ユアサ商事	12,100	5,140.00	62,194,000
神鋼商事	3,900	7,130.00	27,807,000
トルク	3,700	280.00	1,036,000
阪和興業	27,800	5,460.00	151,788,000
正栄食品工業	10,300	4,680.00	48,204,000
カナデン	11,600	1,563.00	18,130,800
RYODEN	12,500	2,662.00	33,275,000
ニプロ	121,900	1,264.00	154,081,600
岩谷産業	35,200	7,357.00	258,966,400
ナイス	2,100	1,587.00	3,332,700
ニチモウ	2,200	2,137.00	4,701,400
極東貿易	9,200	2,169.00	19,954,800

アステナホールディングス	29,000	479.00	13,891,000
三愛オブリ	37,200	1,921.00	71,461,200
稲畑産業	30,600	3,200.00	97,920,000
G S I クレオス	8,300	2,373.00	19,695,900
明和産業	18,300	711.00	13,011,300
クワザワホールディングス	2,500	820.00	2,050,000
キムラタン	42,800	17.00	727,600
ゴールドウイン	25,900	9,045.00	234,265,500
ユニ・チャーム	305,500	5,125.00	1,565,687,500
デサント	25,200	3,200.00	80,640,000
キング	2,500	698.00	1,745,000
ワキタ	25,600	1,592.00	40,755,200
ヤマトインターナショナル	5,100	304.00	1,550,400
東邦ホールディングス	42,800	3,237.00	138,543,600
サンゲツ	35,600	3,530.00	125,668,000
ミツウロコグループホールディングス	19,800	1,476.00	29,224,800
シナネンホールディングス	4,300	4,125.00	17,737,500
伊藤忠エネクス	38,400	1,544.00	59,289,600
サンリオ	43,800	8,233.00	360,605,400
サンワ テクノス	7,900	2,362.00	18,659,800
リョーサン	10,900	5,270.00	57,443,000
新光商事	20,800	1,220.00	25,376,000
トーヨー	6,000	3,045.00	18,270,000
三信電気	6,200	2,343.00	14,526,600
東陽テクニカ	15,700	1,506.00	23,644,200
モスフードサービス	22,800	3,530.00	80,484,000
加賀電子	14,100	6,480.00	91,368,000
三益半導体工業	13,600	3,210.00	43,656,000
都築電気	7,700	2,483.00	19,119,100
ソーダニッカ	13,100	1,186.00	15,536,600
立花エレテック	10,300	3,160.00	32,548,000
木曽路	23,400	2,616.00	61,214,400
S R S ホールディングス	25,500	1,181.00	30,115,500
千趣会	28,400	290.00	8,236,000
リテールパートナーズ	23,000	1,786.00	41,078,000
上新電機	15,300	2,405.00	36,796,500
日本瓦斯	82,000	2,298.00	188,436,000
ロイヤルホールディングス	27,300	2,446.00	66,775,800
東天紅	500	863.00	431,500
いなげや	15,000	1,305.00	19,575,000
チヨダ	14,800	884.00	13,083,200
ライフコーポレーション	16,200	3,720.00	60,264,000
リンガーハット	20,000	2,371.00	47,420,000
MrMaxHD	19,500	629.00	12,265,500
テンアライド	9,100	316.00	2,875,600
AOKIホールディングス	33,200	1,146.00	38,047,200
オークワ	22,200	852.00	18,914,400
コメリ	23,800	3,405.00	81,039,000
青山商事	33,100	1,692.00	56,005,200
しまむら	36,400	8,016.00	291,782,400

はせがわ	3,300	355.00	1,171,500
高島屋	106,900	2,269.00	242,556,100
松屋	26,200	968.00	25,361,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,500	1,786.00	122,341,000
近鉄百貨店	6,600	2,486.00	16,407,600
丸井グループ	102,700	2,451.00	251,717,700
クレディセゾン	91,300	2,875.00	262,487,500
アクシアル リテイリング	10,600	3,980.00	42,188,000
井筒屋	3,200	348.00	1,113,600
イオン	524,400	3,668.00	1,923,499,200
イズミ	27,400	3,619.00	99,160,600
フォーバル	6,100	1,284.00	7,832,400
平和堂	25,900	2,035.00	52,706,500
フジ	23,700	1,962.00	46,499,400
ヤオコー	17,500	8,526.00	149,205,000
ゼビオホールディングス	21,000	968.00	20,328,000
ケーズホールディングス	103,900	1,275.50	132,524,450
PAL TAC	20,900	4,292.00	89,702,800
三谷産業	27,000	388.00	10,476,000
Olympicグループ	3,000	551.00	1,653,000
日産東京販売ホールディングス	10,300	511.00	5,263,300
あおぞら銀行	103,500	2,408.50	249,279,750
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,769,700	1,515.00	13,286,095,500
りそなホールディングス	1,679,200	829.30	1,392,560,560
三井住友トラスト・ホールディングス	517,500	3,011.00	1,558,192,500
三井住友フィナンシャルグループ	1,023,900	8,200.00	8,395,980,000
千葉銀行	401,300	1,203.00	482,763,900
群馬銀行	279,500	795.30	222,286,350
武蔵野銀行	20,100	2,822.00	56,722,200
千葉興業銀行	27,200	887.00	24,126,400
筑波銀行	63,100	253.00	15,964,300
七十七銀行	41,900	3,745.00	156,915,500
秋田銀行	9,600	2,049.00	19,670,400
山形銀行	16,000	1,132.00	18,112,000
岩手銀行	9,100	2,588.00	23,550,800
東邦銀行	113,700	326.00	37,066,200
東北銀行	3,100	1,194.00	3,701,400
ふくおかフィナンシャルグループ	125,400	3,744.00	469,497,600
スルガ銀行	126,900	780.00	98,982,000
八十二銀行	309,000	875.90	270,653,100
山梨中央銀行	16,100	1,754.00	28,239,400
大垣共立銀行	27,400	2,049.00	56,142,600
福井銀行	12,900	1,790.00	23,091,000
清水銀行	5,700	1,558.00	8,880,600
富山銀行	1,100	1,784.00	1,962,400
滋賀銀行	24,000	4,035.00	96,840,000
南都銀行	21,700	2,714.00	58,893,800
百五銀行	135,500	618.00	83,739,000
紀陽銀行	51,500	1,767.00	91,000,500
ほくほくフィナンシャルグループ	89,100	1,670.00	148,797,000

山陰合同銀行	90,200	1,083.00	97,686,600
鳥取銀行	2,200	1,405.00	3,091,000
百十四銀行	14,200	2,692.00	38,226,400
四国銀行	21,200	1,069.00	22,662,800
阿波銀行	20,200	2,552.00	51,550,400
大分銀行	8,700	2,643.00	22,994,100
宮崎銀行	8,700	2,715.00	23,620,500
佐賀銀行	8,500	1,906.00	16,201,000
琉球銀行	30,700	1,130.00	34,691,000
セブン銀行	451,400	300.30	135,555,420
みずほフィナンシャルグループ	1,943,700	2,755.00	5,354,893,500
高知銀行	2,200	993.00	2,184,600
山口フィナンシャルグループ	141,200	1,499.50	211,729,400
芙蓉総合リース	13,300	13,605.00	180,946,500
みずほリース	24,100	5,460.00	131,586,000
東京センチュリー	107,600	1,537.50	165,435,000
SBIホールディングス	211,000	3,945.00	832,395,000
日本証券金融	52,900	1,600.00	84,640,000
アイフル	212,000	411.00	87,132,000
日本アジア投資	4,700	228.00	1,071,600
名古屋銀行	9,300	6,040.00	56,172,000
北洋銀行	218,200	352.00	76,806,400
大光銀行	2,100	1,392.00	2,923,200
愛媛銀行	19,400	1,086.00	21,068,400
トマト銀行	2,300	1,216.00	2,796,800
京葉銀行	60,400	722.00	43,608,800
栃木銀行	71,900	318.00	22,864,200
北日本銀行	4,700	2,133.00	10,025,100
東和銀行	26,400	661.00	17,450,400
福島銀行	6,600	254.00	1,676,400
大東銀行	2,700	746.00	2,014,200
リコーリース	13,700	5,110.00	70,007,000
イオンフィナンシャルサービス	82,700	1,342.00	110,983,400
アコム	257,100	385.50	99,112,050
ジャックス	15,300	5,480.00	83,844,000
オリエントコーポレーション	47,000	1,063.00	49,961,000
オリックス	877,700	3,149.00	2,763,877,300
三菱HCキャピタル	641,600	1,032.50	662,452,000
ジャフコグループ	42,900	1,776.00	76,190,400
九州リースサービス	2,600	1,394.00	3,624,400
トモニホールディングス	136,300	403.00	54,928,900
大和証券グループ本社	1,115,500	1,100.50	1,227,607,750
野村ホールディングス	2,421,500	846.10	2,048,831,150
岡三証券グループ	126,500	742.00	93,863,000
丸三証券	47,900	967.00	46,319,300
東洋証券	38,200	375.00	14,325,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	171,000	577.00	98,667,000
光世証券	1,400	718.00	1,005,200
水戸証券	42,500	476.00	20,230,000

いちよし証券	27,000	797.00	21,519,000
松井証券	70,900	842.00	59,697,800
SOMPOホールディングス	216,600	8,700.00	1,884,420,000
日本取引所グループ	375,700	3,928.00	1,475,749,600
マネックスグループ	141,000	848.00	119,568,000
極東証券	19,700	1,013.00	19,956,100
岩井コスモホールディングス	16,400	2,190.00	35,916,000
アイザワ証券グループ	20,800	1,097.00	22,817,600
フィデアホールディングス	14,900	1,587.00	23,646,300
池田泉州ホールディングス	199,700	364.00	72,690,800
アニコムホールディングス	48,900	578.00	28,264,200
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	322,400	7,170.00	2,311,608,000
マネーパートナーズグループ	6,700	300.00	2,010,000
スパークス・グループ	16,100	1,865.00	30,026,500
小林洋行	2,900	276.00	800,400
第一生命ホールディングス	703,600	3,361.00	2,364,799,600
東京海上ホールディングス	1,423,400	4,344.00	6,183,249,600
アドバンテッジリスクマネジメント	3,400	409.00	1,390,600
イー・ギャランティ	23,400	1,889.00	44,202,600
アサックス	3,000	748.00	2,244,000
NECキャピタルソリューション	7,100	3,730.00	26,483,000
T&Dホールディングス	386,700	2,527.00	977,190,900
アドバンスクリエイト	8,300	1,027.00	8,524,100
三井不動産	665,900	4,140.00	2,756,826,000
三菱地所	941,300	2,184.00	2,055,799,200
平和不動産	23,400	3,950.00	92,430,000
東京建物	125,800	2,173.50	273,426,300
京阪神ビルディング	26,900	1,619.00	43,551,100
住友不動産	208,200	4,615.00	960,843,000
太平洋興発	2,500	823.00	2,057,500
テーオーシー	25,700	670.00	17,219,000
レオパレス21	144,100	424.00	61,098,400
スターツコーポレーション	20,700	2,984.00	61,768,800
フジ住宅	18,100	720.00	13,032,000
空港施設	20,300	601.00	12,200,300
明和地所	8,200	1,068.00	8,757,600
ゴールドクレスト	11,700	2,227.00	26,055,900
リログループ	75,300	1,269.00	95,555,700
エスリード	6,800	3,360.00	22,848,000
日神グループホールディングス	23,100	514.00	11,873,400
日本エスコン	26,900	994.00	26,738,600
MIRARTHホールディングス	66,100	483.00	31,926,300
AVANTIA	3,500	889.00	3,111,500
イオンモール	74,600	1,822.00	135,921,200
毎日コムネット	2,400	734.00	1,761,600
ファースト住建	2,500	1,103.00	2,757,500
ランド	798,500	7.00	5,589,500
カチタス	38,700	1,954.00	75,619,800
東祥	10,500	801.00	8,410,500

トーセイ	24,000	2,011.00	48,264,000
穴吹興産	1,500	2,080.00	3,120,000
サンフロンティア不動産	21,300	1,664.00	35,443,200
FJネクストホールディングス	15,200	1,161.00	17,647,200
インテリックス	1,500	550.00	825,000
ランドビジネス	2,400	265.00	636,000
サンネクスタグループ	2,100	952.00	1,999,200
グランディハウス	10,800	645.00	6,966,000
東武鉄道	160,600	3,802.00	610,601,200
相鉄ホールディングス	52,300	2,724.50	142,491,350
東急	410,000	1,822.50	747,225,000
京浜急行電鉄	180,900	1,319.50	238,697,550
小田急電鉄	241,800	2,107.00	509,472,600
京王電鉄	70,300	4,259.00	299,407,700
京成電鉄	94,300	7,463.00	703,760,900
富士急行	18,000	3,850.00	69,300,000
東日本旅客鉄道	268,600	9,043.00	2,428,949,800
西日本旅客鉄道	173,400	6,262.00	1,085,830,800
東海旅客鉄道	563,200	3,825.00	2,154,240,000
西武ホールディングス	176,900	2,170.00	383,873,000
鴻池運輸	24,900	1,802.00	44,869,800
西日本鉄道	39,100	2,413.00	94,348,300
ハマキョウレックス	12,500	3,820.00	47,750,000
サカイ引越センター	16,200	2,600.00	42,120,000
近鉄グループホールディングス	146,000	4,496.00	656,416,000
阪急阪神ホールディングス	194,700	4,285.00	834,289,500
南海電気鉄道	65,100	2,894.00	188,399,400
京阪ホールディングス	80,500	3,466.00	279,013,000
神戸電鉄	4,000	2,815.00	11,260,000
名古屋鉄道	150,600	2,120.50	319,347,300
山陽電気鉄道	11,000	2,112.00	23,232,000
アルプス物流	11,700	1,945.00	22,756,500
トランコム	4,200	6,280.00	26,376,000
ヤマトホールディングス	186,900	2,335.50	436,504,950
山九	37,100	5,368.00	199,152,800
日新	11,100	2,824.00	31,346,400
丸運	3,700	283.00	1,047,100
丸全昭和運輸	9,000	4,500.00	40,500,000
センコーグループホールディングス	77,300	1,073.00	82,942,900
トナミホールディングス	3,200	4,370.00	13,984,000
ニッコンホールディングス	46,700	3,162.00	147,665,400
日本石油輸送	700	2,850.00	1,995,000
福山通運	16,700	4,045.00	67,551,500
セイノーホールディングス	82,100	2,203.00	180,866,300
エスライングループ本社	1,800	866.00	1,558,800
神奈川中央交通	4,000	3,020.00	12,080,000
AZ-COM丸和ホールディングス	37,300	1,472.00	54,905,600
C&Fロジホールディングス	14,100	1,817.00	25,619,700
日本郵船	418,400	4,797.00	2,007,064,800
商船三井	316,800	5,273.00	1,670,486,400

川崎汽船	117,200	7,107.00	832,940,400
NSユニテッド海運	7,900	5,140.00	40,606,000
明海グループ	7,100	789.00	5,601,900
飯野海運	53,600	1,303.00	69,840,800
共栄タンカー	1,200	1,151.00	1,381,200
九州旅客鉄道	103,200	3,429.00	353,872,800
SGホールディングス	245,100	1,891.00	463,484,100
NIPPON EXPRESSホールディングス	49,500	7,979.00	394,960,500
ID&Eホールディングス	9,100	3,710.00	33,761,000
日本航空	358,500	2,778.00	995,913,000
ANAホールディングス	397,200	3,250.00	1,290,900,000
ビーウィズ	3,100	1,878.00	5,821,800
パスコ	1,300	1,868.00	2,428,400
TREホールディングス	28,800	1,202.00	34,617,600
人・夢・技術グループ	5,700	1,706.00	9,724,200
西本Wismettacホールディングス	3,900	6,460.00	25,194,000
シルバーライフ	3,000	857.00	2,571,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,380.00	1,428,000
Genky Drug Stores	6,800	6,380.00	43,384,000
コア商事ホールディングス	10,900	721.00	7,858,900
KPPグループホールディングス	40,000	630.00	25,200,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,100	1,252.00	1,377,200
ブックオフグループホールディングス	9,000	1,272.00	11,448,000
ギフトホールディングス	6,500	2,953.00	19,194,500
三菱倉庫	35,900	4,563.00	163,811,700
三井倉庫ホールディングス	13,600	4,600.00	62,560,000
住友倉庫	39,400	2,609.00	102,794,600
澁澤倉庫	6,700	3,015.00	20,200,500
ヤマタネ	6,800	2,581.00	17,550,800
東陽倉庫	1,700	1,525.00	2,592,500
乾汽船	17,100	1,048.00	17,920,800
日本トランスシティ	29,400	625.00	18,375,000
ケイヒン	1,100	1,959.00	2,154,900
中央倉庫	7,800	1,141.00	8,899,800
川西倉庫	1,300	1,167.00	1,517,100
安田倉庫	10,000	1,182.00	11,820,000
ファイズホールディングス	900	1,211.00	1,089,900
NISSOホールディングス	13,000	822.00	10,686,000
大栄環境	27,300	2,715.00	74,119,500
日本管財ホールディングス	15,800	2,574.00	40,669,200
東洋埠頭	1,900	1,376.00	2,614,400
上組	67,400	3,410.00	229,834,000
サンリツ	1,600	781.00	1,249,600
キムラユニティー	3,100	1,639.00	5,080,900
キューソー流通システム	6,600	928.00	6,124,800
東海運	3,800	295.00	1,121,000
エーアイティー	9,200	1,870.00	17,204,000
内外トランスライン	5,800	2,380.00	13,804,000

ショーエイコーポレーション	2,100	615.00	1,291,500
日本コンセプト	5,300	1,923.00	10,191,900
TBSホールディングス	73,700	4,182.00	308,213,400
日本テレビホールディングス	129,800	2,173.50	282,120,300
朝日放送グループホールディングス	13,700	696.00	9,535,200
テレビ朝日ホールディングス	35,600	2,045.00	72,802,000
スカパーJ SATホールディングス	113,900	890.00	101,371,000
テレビ東京ホールディングス	10,600	3,040.00	32,224,000
日本BS放送	2,400	891.00	2,138,400
ビジョン	22,100	1,146.00	25,326,600
スマートバリュー	1,900	416.00	790,400
USEN-NEXT HOLDINGS	16,400	4,565.00	74,866,000
ワイヤレスゲート	2,800	212.00	593,600
日本通信	144,300	214.00	30,880,200
クロップス	900	1,002.00	901,800
日本電信電話	43,620,300	182.00	7,938,894,600
KDDI	1,133,200	4,545.00	5,150,394,000
ソフトバンク	2,360,000	1,983.50	4,681,060,000
光通信	14,800	26,530.00	392,644,000
エムティーアイ	10,100	735.00	7,423,500
GMOインターネットグループ	54,200	2,525.50	136,882,100
ファイバーゲート	7,900	999.00	7,892,100
アイドママーケティングコミュニケーション	1,800	233.00	419,400
KADOKAWA	77,500	2,915.00	225,912,500
学研ホールディングス	24,400	992.00	24,204,800
ゼンリン	25,100	854.00	21,435,400
昭文社ホールディングス	2,900	361.00	1,046,900
インプレスホールディングス	6,600	174.00	1,148,400
東京電力ホールディングス	1,318,000	816.10	1,075,619,800
中部電力	538,800	1,879.00	1,012,405,200
関西電力	564,600	1,955.50	1,104,075,300
中国電力	254,000	1,014.00	257,556,000
北陸電力	149,500	744.00	111,228,000
東北電力	384,900	1,003.50	386,247,150
四国電力	136,200	1,064.00	144,916,800
九州電力	337,000	1,190.50	401,198,500
北海道電力	141,200	670.80	94,716,960
沖縄電力	37,300	1,080.00	40,284,000
電源開発	120,100	2,489.00	298,928,900
エフオン	10,600	410.00	4,346,000
イーレックス	26,000	732.00	19,032,000
レノバ	39,000	1,183.00	46,137,000
東京瓦斯	309,100	3,256.00	1,006,429,600
大阪瓦斯	296,200	2,991.00	885,934,200
東邦瓦斯	63,300	2,917.50	184,677,750
北海道瓦斯	8,700	2,271.00	19,757,700
広島ガス	30,900	383.00	11,834,700
西部ガスホールディングス	15,300	1,875.00	28,687,500

静岡ガス	29,200	891.00	26,017,200
メタウォーター	17,500	2,304.00	40,320,000
M&A総研ホールディングス	7,200	6,680.00	48,096,000
アイネット	8,900	2,173.00	19,339,700
松竹	7,600	10,220.00	77,672,000
東宝	81,600	4,959.00	404,654,400
エイチ・アイ・エス	43,700	1,703.00	74,421,100
東映	4,800	20,760.00	99,648,000
ラックランド	6,800	2,588.00	17,598,400
NTTデータグループ	383,400	2,427.50	930,703,500
共立メンテナンス	23,600	6,499.00	153,376,400
イチネンホールディングス	16,000	1,638.00	26,208,000
建設技術研究所	7,700	5,970.00	45,969,000
スペース	9,800	1,005.00	9,849,000
アインホールディングス	21,300	4,789.00	102,005,700
燦ホールディングス	14,100	1,043.00	14,706,300
ピー・シー・エー	8,400	1,698.00	14,263,200
スバル興業	3,000	3,100.00	9,300,000
東京テアトル	2,400	1,138.00	2,731,200
タナベコンサルティンググループ	5,200	1,038.00	5,397,600
ビジネスブレイン太田昭和	5,700	2,281.00	13,001,700
ナガワ	4,700	7,170.00	33,699,000
東京都競馬	12,600	4,240.00	53,424,000
常磐興産	2,500	1,241.00	3,102,500
カナモト	23,300	2,871.00	66,894,300
DTS	30,900	3,940.00	121,746,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,000	6,700.00	448,900,000
シーイーシー	18,500	1,791.00	33,133,500
カブコン	131,100	5,950.00	780,045,000
ニシオホールディングス	14,000	3,815.00	53,410,000
アイ・エス・ビー	7,500	1,402.00	10,515,000
アゴーラ ホスピタリティー グループ	43,400	39.00	1,692,600
日本空港ビルデング	50,900	5,956.00	303,160,400
トランス・コスモス	18,700	2,991.00	55,931,700
乃村工藝社	65,600	889.00	58,318,400
ジャステック	9,000	1,373.00	12,357,000
SCSK	102,600	2,709.00	277,943,400
藤田観光	6,000	6,700.00	40,200,000
KNT-CTホールディングス	9,000	1,213.00	10,917,000
トーカイ	13,300	2,103.00	27,969,900
白洋舎	1,000	2,744.00	2,744,000
セコム	153,100	10,995.00	1,683,334,500
NSW	6,300	3,155.00	19,876,500
セントラル警備保障	8,100	2,585.00	20,938,500
アイネス	11,400	1,505.00	17,157,000
丹青社	29,100	807.00	23,483,700
メイテックグループホールディングス	54,100	3,027.00	163,760,700
TKC	23,300	3,680.00	85,744,000

富士ソフト	29,500	6,090.00	179,655,000
応用地質	14,000	2,312.00	32,368,000
船井総研ホールディングス	31,300	2,626.00	82,193,800
NSD	52,300	2,847.00	148,898,100
進学会ホールディングス	1,700	266.00	452,200
丸紅建材リース	500	2,776.00	1,388,000
オオバ	4,500	993.00	4,468,500
コナミグループ	54,900	10,075.00	553,117,500
いであ	1,800	2,333.00	4,199,400
学究社	6,000	2,125.00	12,750,000
ベネッセホールディングス	50,500	2,595.50	131,072,750
イオンディライト	16,100	3,530.00	56,833,000
ナック	12,800	527.00	6,745,600
福井コンピュータホールディングス	9,100	2,639.00	24,014,900
ダイセキ	30,700	3,945.00	121,111,500
ステップ	5,500	2,061.00	11,335,500
泉州電業	7,200	3,890.00	28,008,000
元気寿司	8,700	3,580.00	31,146,000
トラスコ中山	32,500	2,328.00	75,660,000
ヤマダホールディングス	475,700	430.00	204,551,000
オートバックスセブン	53,900	1,659.00	89,420,100
モリト	11,100	1,398.00	15,517,800
アークランズ	46,000	1,673.00	76,958,000
ニトリホールディングス	56,300	21,945.00	1,235,503,500
グルメ杵屋	12,600	1,118.00	14,086,800
愛眼	5,000	183.00	915,000
ケーユーホールディングス	7,300	1,180.00	8,614,000
吉野家ホールディングス	57,000	3,206.00	182,742,000
加藤産業	19,200	4,930.00	94,656,000
北恵	1,700	865.00	1,470,500
イノテック	9,700	1,924.00	18,662,800
イエローハット	24,600	1,922.00	47,281,200
松屋フーズホールディングス	7,300	5,550.00	40,515,000
JBCホールディングス	9,700	3,595.00	34,871,500
JKホールディングス	11,900	1,030.00	12,257,000
サガミホールディングス	23,200	1,515.00	35,148,000
日伝	10,500	2,718.00	28,539,000
関西フードマーケット	10,500	1,569.00	16,474,500
ミロク情報サービス	13,300	1,932.00	25,695,600
北沢産業	4,200	329.00	1,381,800
杉本商事	7,300	2,254.00	16,454,200
因幡電機産業	40,100	3,525.00	141,352,500
王将フードサービス	11,500	7,800.00	89,700,000
ミニストップ	11,200	1,645.00	18,424,000
アークス	28,400	3,075.00	87,330,000
バローホールディングス	29,500	2,441.00	72,009,500
東テック	5,100	7,110.00	36,261,000
ミスミグループ本社	233,600	2,072.00	484,019,200
アルテック	3,700	265.00	980,500
ベルク	7,700	6,480.00	49,896,000

大 庄	7,400	1,300.00	9,620,000	
タキヒヨー	1,600	1,230.00	1,968,000	
ファーストリテイリング	69,600	43,640.00	3,037,344,000	
ソフトバンクグループ	723,400	8,779.00	6,350,728,600	
蔵王産業	1,200	2,572.00	3,086,400	
スズケン	58,900	4,816.00	283,662,400	
サンドラッグ	52,200	4,652.00	242,834,400	
サックスパー ホールディングス	13,100	882.00	11,554,200	
ジェコス	9,300	1,151.00	10,704,300	
ヤマザワ	1,400	1,270.00	1,778,000	
やまや	1,500	3,330.00	4,995,000	
グローセル	18,100	746.00	13,502,600	
ベルーナ	37,200	618.00	22,989,600	
合計	226,097,200		554,603,550,290	

(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)

2024年2月26日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,932,820,309
コール・ローン	6,456,338,484
株式	1,336,378,100,035
投資信託受益証券	2,173,301,449
投資証券	23,981,067,184
派生商品評価勘定	487,602,031
未収入金	8,009,298
未収配当金	1,471,957,245
差入委託証拠金	10,291,718,301
流動資産合計	1,395,180,914,336
資産合計	1,395,180,914,336
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	333,867
未払解約金	12,393,895,000
流動負債合計	12,394,228,867
負債合計	12,394,228,867
純資産の部	
元本等	
元本	162,160,503,494
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	1,220,626,181,975
元本等合計	1,382,786,685,469
純資産合計	1,382,786,685,469
負債純資産合計	1,395,180,914,336

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月28日 至 2024年2月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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 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 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 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 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	2024年2月26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	137,380,038,509円
同期中追加設定元本額	76,379,732,370円
同期中一部解約元本額	51,599,267,385円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,154,420,152円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,531,018円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	5,858,136円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	15,643,534円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,027,667円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	19,283,292円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,461,739円
たわらノーロード 先進国株式	57,941,719,957円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	58,114,725円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,887,580,268円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	916,899,062円
たわらノーロード バランス(堅実型)	80,325,474円
たわらノーロード バランス(標準型)	753,556,913円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,019,417,623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)	33,321,784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)	204,608,233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)	241,744,930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)	416,921,522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)	124,715円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	12,771,967円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,531,404円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,254,270円
たわらノーロード 全世界株式	2,140,307,375円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,166,412,976円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,376,396,069円
O n e グローバルバランス	24,283,931円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	133,558,960円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	746,042,424円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,008,349,921円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	80,763,954円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	228,321,872円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	237,223,346円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,324,819円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	656,949,333円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	119,023,013円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	154,712,222円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	181,896,073円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	305,524,909円
投資のソムリエ	8,789,096,844円
クルーズコントロール	104,334,373円
投資のソムリエ<DC年金>	869,651,028円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	170,718,841円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	284,773,511円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	988,445,461円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,204,254,277円
ワールドアセットバランス(基本コース)	97,564,574円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	234,745,869円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	57,887,085円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	29,635,686円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	8,910,823円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	191,573,092円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	138,504,634円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	931,825,289円
９資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	123,219,751円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	62,279,509円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	31,482,383円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,331,816円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	137,756,308円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,571,353円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	26,352,616円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	13,347,759円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	13,366,711円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	8,775,720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）	8,093,503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）	236,047円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	34,472,211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）	11,894,466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）	24,997,415円
M S C I 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）	352,358,499円
D I A M 外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	34,973,270円
D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,003,666,343円
D I A M 先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	197,596,901円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,138,764,594円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	285,597,489円
A M O n e 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）（適格機関投資家限定）	897,249円
D I A M ワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	5,291,360円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	22,082,160円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,852,427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）	19,013,111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）	36,934,397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）	1,418,942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）	8,754,286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）	922,489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）	29,206円
D I A M 世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	284,746円
D I A M 世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	14,185,996円
D I A M バランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	100,421,686円
D I A M バランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	189,082,544円

D I A M バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限定)	664, 983, 101円
D I A M グローバル・アセット・バランス V A (適格機関投資家限定)	28, 599, 230円
D I A M グローバル・アセット・バランス V A 2 (適格機関投資家限定)	24, 316, 972円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド 3 0 V A (適格機関投資家限定)	160, 089, 087円
D I A M 世界アセットバランスファンド V A (適格機関投資家向け)	5, 201, 783円
D I A M 世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限定)	131, 734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)	55, 805, 440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)	4, 435, 280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)	20, 959, 688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)	36, 730, 767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)	71, 235, 405円
動的パッケージファンド<DC年金>	12, 852, 907円
コア資産形成ファンド	6, 438, 543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, 031, 898, 296円
MHAM 外国株式インデックスファンド	131, 820, 117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>	1, 037, 980, 593円
MHAM 動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1, 506, 926, 166円
MHAM 外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1, 932, 659, 371円
計	162, 160, 503, 494円
2. 受益権の総数	162, 160, 503, 494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 2023年2月28日 至 2024年2月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年2月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月26日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	23,786,947,353	
投資信託受益証券	48,711,812	
投資証券	515,675,830	
合計	24,351,334,995	

(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(2024年2月16日から2024年2月26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	2024年2月26日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	6,161,615,235	—	6,156,921,004	4,694,231
イギリス・ポンド	4,679,867,040	—	4,677,290,966	2,576,074
オーストラリア・ドル	243,655,167	—	243,867,044	△211,877
カナダ・ドル	181,704,774	—	181,466,285	238,489
ユーロ	198,992,712	—	198,425,043	567,669
買建	857,395,542	—	855,871,666	1,523,876
アメリカ・ドル	1,261,995,492	—	1,261,951,623	△43,869
イギリス・ポンド	993,164,240	—	993,127,901	△36,339
カナダ・ドル	47,972,232	—	47,966,889	△5,343
ユーロ	41,150,660	—	41,147,589	△3,071
合計	179,708,360	—	179,709,244	884
合計	7,423,610,727	—	7,418,872,627	4,650,362

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2024年2月26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	20,769,889,137	—	21,252,506,939	482,617,802
合計	20,769,889,137	—	21,252,506,939	482,617,802

(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)

2024年2月26日現在	
1口当たり純資産額	8.5273円
(1万口当たり純資産額)	(85,273円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年2月26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	1,415,369	174.990	247,675,421.310	
	ABBOTT LABORATORIES	265,014	119.460	31,658,572.440	
	AES CORP	109,122	16.000	1,745,952.000	
	INTL BUSINESS MACHINES	139,028	185.720	25,820,280.160	

CORP				
ADVANCED MICRO DEVICES	246,644	176.520	43,537,598.880	
ADOBE INC	69,437	553.440	38,429,213.280	
CHUBB LTD	62,823	256.010	16,083,316.230	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	34,261	232.790	7,975,618.190	
ALLSTATE CORP	39,652	159.130	6,309,822.760	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	101,335	200.630	20,330,841.050	
AMGEN INC	81,506	289.180	23,569,905.080	
HESS CORP	41,496	149.110	6,187,468.560	
AMERICAN EXPRESS CO	95,449	214.560	20,479,537.440	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,342	82.450	6,376,847.900	
AFLAC INC	84,730	80.410	6,813,139.300	
AMERICAN INTL GROUP	108,150	71.320	7,713,258.000	
ANALOG DEVICES	76,233	190.110	14,492,655.630	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	102,432	58.440	5,986,126.080	
VALERO ENERGY CORP	54,042	141.580	7,651,266.360	
ANSYS INC	13,252	340.890	4,517,474.280	
APPLE INC	2,382,692	182.520	434,888,943.840	
APPLIED MATERIALS INC	128,053	197.160	25,246,929.480	
ALBEMARLE CORP	16,936	120.650	2,043,328.400	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	81,504	53.450	4,356,388.800	
AMEREN CORP	40,644	71.600	2,910,110.400	
AUTODESK INC	32,074	257.200	8,249,432.800	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	62,963	255.870	16,110,342.810	
AUTOZONE INC	2,716	2,756.340	7,486,219.440	
AVERY DENNISON CORP	11,542	214.690	2,477,951.980	
BALL CORP	46,288	62.890	2,911,052.320	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	199,318	417.220	83,159,455.960	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	116,387	55.640	6,475,772.680	
BAXTER INTERNATIONAL INC	80,219	42.550	3,413,318.450	
BECTON DICKINSON & CO	43,938	246.200	10,817,535.600	
AMETEK INC	34,476	178.200	6,143,623.200	
VERIZON COMM INC	641,522	40.660	26,084,284.520	
WR BERKLEY CORP	31,607	85.310	2,696,393.170	
BEST BUY CO INC	30,568	76.280	2,331,727.040	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	337.990	1,021,067.790	
YUM! BRANDS INC	42,053	138.320	5,816,770.960	
FIRSTENERGY CORP	83,697	37.400	3,130,267.800	
BOEING CO	86,601	200.830	17,392,078.830	
ROBERT HALF INC	14,456	80.110	1,158,070.160	
BORGWARNER INC	37,010	30.410	1,125,474.100	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	221,959	67.000	14,871,253.000	

C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	73.350	1,264,040.550	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	26,064	151.010	3,935,924.640	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	3,411	1,209.790	4,126,593.690	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	319,771	51.660	16,519,369.860	
ONEOK INC	86,702	72.970	6,326,644.940	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	126.100	1,224,304.900	
UNITED RENTALS INC	10,788	658.230	7,100,985.240	
SEMPRA	98,372	71.970	7,079,832.840	
FEDEX CORP	36,746	243.460	8,946,181.160	
VERISIGN INC	13,302	196.560	2,614,641.120	
AMPHENOL CORP	91,520	107.470	9,835,654.400	
BROWN-FORMAN CORP	48,308	57.490	2,777,226.920	
QUANTA SERVICES INC	23,271	234.390	5,454,489.690	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.760	484,401.400	
CSX CORP	304,211	38.330	11,660,407.630	
COTERRA ENERGY INC	114,711	25.980	2,980,191.780	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	42.450	1,145,216.100	
CONSTELLATION BRANDS INC	24,629	247.230	6,089,027.670	
CARDINAL HEALTH INC	38,298	108.090	4,139,630.820	
CARLISLE COS INC	7,520	356.270	2,679,150.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	15.230	2,260,253.840	
CATERPILLAR INC	77,969	323.880	25,252,599.720	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	14,608	160.280	2,341,370.240	
JPMORGAN CHASE & CO	442,391	183.990	81,395,520.090	
CHURCH & DWIGHT CO INC	38,911	100.400	3,906,664.400	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,876	112.810	2,580,641.560	
CINTAS CORP	14,169	633.100	8,970,393.900	
CISCO SYSTEMS INC	618,456	48.860	30,217,760.160	
CLEVELAND-CLIFFS INC	83,513	20.220	1,688,632.860	
CLOROX COMPANY	18,305	152.840	2,797,736.200	
COCA-COLA CO/THE	627,348	61.200	38,393,697.600	
COPART INC	128,373	51.380	6,595,804.740	
COLGATE-PALMOLIVE CO	121,309	86.250	10,462,901.250	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	38,376	251.480	9,650,796.480	
MOLINA HEALTHCARE INC	8,928	406.770	3,631,642.560	
NRG ENERGY, INC.	34,874	51.550	1,797,754.700	
COMCAST CORP-CL A	628,171	41.900	26,320,364.900	
CONAGRA BRANDS INC	73,639	28.300	2,083,983.700	
CONSOLIDATED EDISON INC	51,736	87.930	4,549,146.480	
CMS ENERGY CORP	44,128	57.700	2,546,185.600	
COOPER COS INC	31,884	96.750	3,084,777.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	30,436	62.490	1,901,945.640	

CORNING INC	126,561	32.690	4,137,279.090	
HEICO CORP-CL A	11,614	161.370	1,874,151.180	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	9,442	248.900	2,350,113.800	
CUMMINS INC	21,250	263.970	5,609,362.500	
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	42.320	1,007,469.920	
DR HORTON INC	45,784	146.100	6,689,042.400	
DANAHER CORP	107,045	253.840	27,172,302.800	
MOODY'S CORP	24,521	385.510	9,453,090.710	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	75,997	79.820	6,066,080.540	
TARGET CORP	71,189	151.480	10,783,709.720	
DEERE & CO	41,361	364.660	15,082,702.260	
MORGAN STANLEY	189,813	86.550	16,428,315.150	
REPUBLIC SERVICES INC	33,574	184.980	6,210,518.520	
COSTAR GROUP INC	61,975	84.790	5,254,860.250	
DECKERS OUTDOOR CORP	4,174	880.480	3,675,123.520	
THE WALT DISNEY CO	279,406	107.740	30,103,202.440	
DOLLAR TREE INC	31,756	145.880	4,632,565.280	
DOVER CORP	22,599	164.100	3,708,495.900	
OMNICOM GROUP	30,586	88.600	2,709,919.600	
DTE ENERGY CO	33,700	108.450	3,654,765.000	
DUKE ENERGY CORP	118,123	92.730	10,953,545.790	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,701	169.510	3,000,496.510	
EBAY INC	84,227	44.010	3,706,830.270	
BANK OF AMERICA CORP	1,090,810	33.920	37,000,275.200	
CITIGROUP INC	294,170	55.930	16,452,928.100	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	86.610	1,454,181.900	
EATON CORP PLC	61,113	284.930	17,412,927.090	
CADENCE DESIGN SYS INC	41,715	303.530	12,661,753.950	
ECOLAB INC	38,151	222.340	8,482,493.340	
REVVITY INC	17,972	104.440	1,876,995.680	
ELECTRONIC ARTS INC	38,801	142.590	5,532,634.590	
SALESFORCE INC	148,357	292.800	43,438,929.600	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	349.510	1,178,547.720	
EMERSON ELECTRIC CO	87,960	105.910	9,315,843.600	
ATMOS ENERGY CORP	24,532	112.760	2,766,228.320	
ENTERGY CORP	30,736	102.500	3,150,440.000	
EOG RESOURCES INC	90,394	111.860	10,111,472.840	
EQUIFAX INC	18,730	265.980	4,981,805.400	
EQT CORP	59,729	37.010	2,210,570.290	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	35,846	149.990	5,376,541.540	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,415	120.150	2,693,162.250	
EXXON MOBIL CORP	611,607	103.840	63,509,270.880	
FMC CORP	17,711	52.380	927,702.180	
NEXTERA ENERGY INC	309,921	56.780	17,597,314.380	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,019	463.470	2,789,625.930	
FAIR ISAAC CORP	3,775	1,282.330	4,840,795.750	
ASSURANT INC	8,766	178.370	1,563,591.420	

FASTENAL CO	85,603	72.180	6,178,824.540	
FIFTH THIRD BANCORP	105,410	33.520	3,533,343.200	
M&T BANK CORP	24,958	138.100	3,446,699.800	
FISERV INC	91,718	150.760	13,827,405.680	
FORD MOTOR CO	585,908	12.140	7,112,923.120	
FRANKLIN RESOURCES INC	47,477	27.010	1,282,353.770	
FREEPORT-MCMORAN INC	214,628	38.960	8,361,906.880	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,584	1,534.600	2,430,806.400	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	33,344	245.000	8,169,280.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	34,634	273.750	9,481,057.500	
GENERAL MILLS INC	88,517	65.320	5,781,930.440	
GENUINE PARTS CO	20,769	147.880	3,071,319.720	
GILEAD SCIENCES INC	190,011	73.550	13,975,309.050	
GARTNER INC	11,988	460.640	5,522,152.320	
MCKESSON CORP	20,854	516.240	10,765,668.960	
NVIDIA CORP	376,494	788.170	296,741,275.980	
GRACO INC	23,985	90.360	2,167,284.600	
GENERAL ELECTRIC CO	164,658	153.330	25,247,011.140	
WW GRAINGER INC	6,777	958.930	6,498,668.610	
HALLIBURTON CO	139,251	35.210	4,903,027.710	
MONSTER BEVERAGE CORP	117,637	55.290	6,504,149.730	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	50,300	391.050	19,669,815.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	28,728	214.450	6,160,719.600	
HASBRO INC	16,359	49.590	811,242.810	
HENRY SCHEIN INC	17,431	79.860	1,392,039.660	
HEICO CORP	6,878	199.170	1,369,891.260	
HERSHEY FOODS CORP	22,500	193.830	4,361,175.000	
HP INC	134,136	29.270	3,926,160.720	
F5 INC	8,981	185.830	1,668,939.230	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	76.920	1,394,175.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	7,615	227.030	1,728,833.450	
JUNIPER NETWORKS INC	57,881	37.180	2,152,015.580	
HOLOGIC INC	38,399	76.150	2,924,083.850	
HOME DEPOT INC	152,731	371.960	56,809,822.760	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29,668	91.240	2,706,908.320	
HORMEL FOODS CORP	49,054	30.510	1,496,637.540	
CENTERPOINT ENERGY INC	97,776	27.910	2,728,928.160	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,917	459.290	2,258,328.930	
HUBBELL INC	7,820	365.790	2,860,477.800	
HUMANA INC	18,641	362.910	6,765,005.310	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,276	213.070	2,615,647.320	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	215,385	12.860	2,769,851.100	
BIOGEN INC	21,910	223.320	4,892,941.200	
IDEX CORP	11,045	237.050	2,618,217.250	
ILLINOIS TOOL WORKS	46,463	260.130	12,086,420.190	

INTUIT INC	42,734	659.810	28,196,320.540	
IDEXX LABORATORIES INC	12,500	576.290	7,203,625.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	35,154	281.820	9,907,100.280	
INTEL CORP	639,205	42.990	27,479,422.950	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	40,993	80.480	3,299,116.640	
INTERNATIONAL PAPER CO	53,419	34.730	1,855,241.870	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	32.300	1,746,234.900	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,857	175.950	2,086,239.150	
JABIL CIRCUIT INC	19,586	139.520	2,732,638.720	
INCYTE CORP	31,654	60.590	1,917,915.860	
JOHNSON & JOHNSON	366,956	161.840	59,388,159.040	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,659	95.880	4,377,784.920	
KLA CORPORATION	20,432	668.820	13,665,330.240	
DEVON ENERGY CORP	96,985	43.880	4,255,701.800	
KELLANOVA	42,451	56.430	2,395,509.930	
KEYCORP	144,072	14.260	2,054,466.720	
KIMBERLY-CLARK CORP	52,932	121.640	6,438,648.480	
BLACKROCK INC/NEW YORK	22,727	813.590	18,490,459.930	
KROGER CO	103,385	48.210	4,984,190.850	
LAM RESEARCH CORP	20,026	928.500	18,594,141.000	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	7,446	432.870	3,223,150.020	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,451	175.410	2,359,439.910	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	74.750	1,514,435.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,313	108.170	2,521,767.210	
LENNAR CORP	37,667	155.080	5,841,398.360	
ELI LILLY & CO	123,021	769.540	94,669,580.340	
BATH & BODY WORKS INC	34,638	47.250	1,636,645.500	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	110,884	148.630	16,480,688.920	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,825	132.030	5,918,244.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	33,842	431.120	14,589,963.040	
LOEWS CORP	30,289	75.190	2,277,429.910	
LOWE'S COS INC	88,486	232.560	20,578,304.160	
DOMINION ENERGY INC	126,501	47.860	6,054,337.860	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	42.580	1,720,274.580	
MCCORMICK & CO INC	40,279	68.080	2,742,194.320	
MCDONALD'S CORPORATION	111,035	297.750	33,060,671.250	
S&P GLOBAL INC	49,571	438.270	21,725,482.170	
EVEREST GROUP LTD	6,670	370.880	2,473,769.600	
MARKEL GROUP INC	2,013	1,471.520	2,962,169.760	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	91,510	87.740	8,029,087.400	

MARSH & MCLENNAN COS	75,606	203.650	15,397,161.900
MASCO CORP	34,561	74.940	2,590,001.340
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	9,365	548.680	5,138,388.200
METLIFE INC	97,405	69.330	6,753,088.650
MEDTRONIC PLC	202,117	85.670	17,315,363.390
CVS HEALTH CORP	197,356	77.200	15,235,883.200
MERCK & CO. INC.	386,448	129.450	50,025,693.600
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	65,250	76.190	4,971,397.500
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,876	219.160	2,821,904.160
MICROSOFT CORP	1,075,609	410.340	441,365,397.060
MICRON TECH INC	168,037	86.000	14,451,182.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	81,668	82.840	6,765,377.120
3M CO	82,577	92.580	7,644,978.660
ENTEGRIS INC	23,675	132.540	3,137,884.500
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	247.710	1,900,926.540
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,847	330.270	8,206,218.690
ILLUMINA INC	24,379	133.000	3,242,407.000
XCEL ENERGY INC	82,777	59.330	4,911,159.410
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,613	134.180	1,960,772.340
NETAPP INC	32,785	87.400	2,865,409.000
NEWMONT CORP	173,608	31.280	5,430,458.240
NVR INC	483	7,584.750	3,663,434.250
NIKE INC-CL B	187,720	105.630	19,828,863.600
NORDSON CORP	7,548	273.710	2,065,963.080
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,140	258.010	8,808,461.400
EVERSOURCE ENERGY	51,861	58.870	3,053,057.070
NISOURCE INC	64,543	26.120	1,685,863.160
NORTHERN TRUST CORP	32,868	81.480	2,678,084.640
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,098	461.100	10,189,387.800
WELLS FARGO & CO	558,286	53.860	30,069,283.960
NUCOR CORP	37,496	189.990	7,123,865.040
CHENIERE ENERGY INC	36,422	157.730	5,744,842.060
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,630	135.520	7,810,017.600
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	99,774	60.020	5,988,435.480
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,854	440.220	6,539,027.880
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,084	1,058.020	9,611,053.680
ORACLE CORP	250,707	111.950	28,066,648.650
PACCAR INC	77,744	110.780	8,612,480.320
PTC INC	18,085	180.940	3,272,299.900
EXELON CORP	157,197	36.130	5,679,527.610
PARKER HANNIFIN CORP	19,211	531.070	10,202,385.770
PAYCHEX INC	49,152	124.640	6,126,305.280

ALIGN TECHNOLOGY INC	11,452	316.880	3,628,909.760
PPL CORPORATION	113,687	26.800	3,046,811.600
PEPSICO INC	210,584	169.600	35,715,046.400
PENTAIR PLC	25,545	76.760	1,960,834.200
PFIZER INC	862,381	27.760	23,939,696.560
ESSENTIAL UTILITIES INC	40,319	35.130	1,416,406.470
CONOCOPHILLIPS	183,994	111.510	20,517,170.940
PG&E CORP	306,139	17.030	5,213,547.170
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	36,219	232.480	8,420,193.120
ALTRIA GROUP INC	271,033	41.130	11,147,587.290
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,805	146.120	8,738,706.600
BROWN & BROWN INC	36,907	84.240	3,109,045.680
GARMIN LTD	23,281	135.510	3,154,808.310
PPG INDUSTRIES INC	35,748	144.370	5,160,938.760
COSTCO WHOLESALE CORP	67,603	737.930	49,886,281.790
T ROWE PRICE GROUP INC	34,293	110.990	3,806,180.070
QUEST DIAGNOSTICS	16,574	127.080	2,106,223.920
PROCTER & GAMBLE CO	359,441	161.030	57,880,784.230
PROGRESSIVE CORP	89,808	191.300	17,180,270.400
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,243	60.750	4,510,262.250
PULTE GROUP INC	33,950	105.740	3,589,873.000
GLOBAL PAYMENTS INC	40,068	133.100	5,333,050.800
QUALCOMM INC	170,286	154.910	26,379,004.260
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,141	118.580	3,455,539.780
EXACT SCIENCES CORP	26,045	57.530	1,498,368.850
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	8,747	324.120	2,835,077.640
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,052	981.200	15,750,222.400
REPLIGEN CORP	8,576	196.520	1,685,355.520
RESMED INC	22,899	184.040	4,214,331.960
US BANCORP	229,227	41.360	9,480,828.720
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,309	87.290	4,915,212.610
ROSS STORES INC	50,878	148.030	7,531,470.340
ROLLINS INC	45,708	42.580	1,946,246.640
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,344	556.870	9,101,483.280
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,327	280.510	4,860,396.770
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	37,464	121.910	4,567,236.240
RPM INTERNATIONAL INC	19,258	112.720	2,170,761.760
ACCENTURE PLC-CL A	95,612	377.320	36,076,319.840
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	208,847	73.980	15,450,501.060
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,217	277.570	4,501,352.690
AXON ENTERPRISE INC	11,039	270.630	2,987,484.570
THE TRAVELERS COMPANIES	34,835	220.960	7,697,141.600

INC				
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	89,354	64.280	5,743,675.120	
BOOKING HOLDINGS INC	5,452	3,505.960	19,114,493.920	
SCHLUMBERGER LTD	217,990	48.820	10,642,271.800	
SCHWAB (CHARLES) CORP	230,145	64.440	14,830,543.800	
POOL CORP	6,305	387.610	2,443,881.050	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	32,114	129.180	4,148,486.520	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	67.290	974,157.330	
ELEVANCE HEALTH INC	36,139	514.090	18,578,698.510	
CENCORA INC	25,701	237.270	6,098,076.270	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,591	80.240	2,855,821.840	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	37,500	322.030	12,076,125.000	
CENTENE CORP	82,487	80.220	6,617,107.140	
SMITH (A. O.) CORP	19,563	81.400	1,592,428.200	
SNAP-ON INC	8,204	270.950	2,222,873.800	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	54,392	108.070	5,878,143.440	
EDISON INTERNATIONAL	57,612	68.260	3,932,595.120	
SOUTHERN CO	166,722	67.690	11,285,412.180	
TRUIST FINANCIAL CORP	198,729	35.240	7,003,209.960	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	33.780	665,466.000	
AT&T INC	1,094,228	16.800	18,383,030.400	
CHEVRON CORP	277,081	154.660	42,853,347.460	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,592	89.140	2,013,850.880	
STATE STREET CORP	50,416	73.580	3,709,609.280	
STARBUCKS CORP	175,161	95.620	16,748,894.820	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	127.010	2,913,228.370	
STRYKER CORP	51,849	355.030	18,407,950.470	
NETFLIX INC	67,648	583.560	39,476,666.880	
GEN DIGITAL INC	92,583	22.140	2,049,787.620	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	27,400	58.220	1,595,228.000	
SYNOPSIS INC	23,314	575.650	13,420,704.100	
SYSCO CORP	76,419	80.820	6,176,183.580	
INTUITIVE SURGICAL INC	53,463	389.770	20,838,273.510	
TELEFLEX INC	6,985	237.750	1,660,683.750	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	12.890	2,181,632.500	
TERADYNE INC	22,066	100.140	2,209,689.240	
TEXAS INSTRUMENTS INC	138,908	163.690	22,737,850.520	
TEXTRON INC	29,841	85.970	2,565,430.770	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	58,851	564.710	33,233,748.210	
GLOBE LIFE INC	14,973	126.900	1,900,073.700	
TORO CO	14,644	93.210	1,364,967.240	
DAVITA INC	6,813	125.260	853,396.380	

TRACTOR SUPPLY CO	16,808	243.070	4,085,520.560	
BIO-TECHNE CORP	25,934	71.620	1,857,393.080	
TRIMBLE INC	37,504	61.460	2,304,995.840	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,175	437.480	2,701,439.000	
TYSON FOODS INC	41,316	53.810	2,223,213.960	
MARATHON OIL CORP	92,952	23.780	2,210,398.560	
UNION PACIFIC CORP	93,133	256.910	23,926,799.030	
RTX CORP	223,486	90.010	20,115,974.860	
UNITEDHEALTH GROUP INC	141,390	527.240	74,546,463.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	9,903	164.310	1,627,161.930	
VF CORP	51,762	15.980	827,156.760	
PARAMOUNT GLOBAL	81,326	11.210	911,664.460	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	39,411	430.110	16,951,065.210	
VULCAN MATERIALS CO	20,095	257.230	5,169,036.850	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,124	21.730	2,327,804.520	
WALMART INC	226,180	175.560	39,708,160.800	
WASTE MANAGEMENT INC	62,122	208.050	12,924,482.100	
WATERS CORP	8,786	331.250	2,910,362.500	
WATSCO INC	4,889	384.980	1,882,167.220	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,464	367.440	4,212,332.160	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,604	125.920	1,964,855.680	
VAIL RESORTS INC	6,523	234.980	1,532,774.540	
WESTERN DIGITAL CORP	49,451	56.060	2,772,223.060	
WABTEC CORP	28,400	138.290	3,927,436.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,319	103.850	2,629,378.150	
WYNN RESORTS LTD	15,379	104.160	1,601,876.640	
NASDAQ INC	52,969	56.650	3,000,693.850	
CME GROUP INC	54,132	217.960	11,798,610.720	
WILLIAMS COS INC	180,781	34.940	6,316,488.140	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	172.670	1,476,501.170	
LKQ CORP	43,882	52.180	2,289,762.760	
ALLIANT ENERGY CORP	40,524	48.700	1,973,518.800	
WEC ENERGY GROUP INC	47,882	78.860	3,775,974.520	
CARMAX INC	22,414	73.330	1,643,618.620	
TJX COMPANIES INC	172,469	99.380	17,139,969.220	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,785	274.990	2,140,797.150	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.270	510,280.230	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	41.610	979,000.080	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	19,271	157.650	3,038,073.150	
CBRE GROUP INC	48,577	90.110	4,377,273.470	
REGIONS FINANCIAL CORP	152,588	18.280	2,789,308.640	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	433.650	2,227,660.050	

MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	7,127	721.130	5,139,493.510	
WESTLAKE CORP	6,030	136.790	824,843.700	
T-MOBILE US INC	80,697	164.340	13,261,744.980	
LAS VEGAS SANDS CORP	59,474	54.750	3,256,201.500	
MOSAIC CO/THE	48,502	31.480	1,526,842.960	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,126	214.920	1,316,599.920	
CELANESE CORP	16,273	149.380	2,430,860.740	
DEXCOM INC	58,553	116.260	6,807,371.780	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	19,554	188.670	3,689,253.180	
EXPEDIA GROUP INC	21,978	136.300	2,995,601.400	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	30,969	80.410	2,490,217.290	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,536	407.120	6,325,016.320	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	87,385	138.380	12,092,336.300	
LIVE NATION	23,597	95.320	2,249,266.040	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,226	2,646.720	11,185,038.720	
TRANSDIGM GROUP INC	8,496	1,199.890	10,194,265.440	
MASTERCARD INC	128,261	473.420	60,721,322.620	
CELSIUS HOLDINGS INC	23,623	64.050	1,513,053.150	
OWENS CORNING	13,227	147.370	1,949,262.990	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,679	126.060	2,606,794.740	
AERCAP HOLDINGS NV	30,064	77.850	2,340,482.400	
FIRST SOLAR INC	15,579	142.890	2,226,083.310	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	18,398	201.490	3,707,013.020	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,263	860.010	6,246,252.630	
AECOM TECHNOLOGY CORP	21,094	89.530	1,888,545.820	
DELTA AIR LINES INC	21,592	41.720	900,818.240	
INSULET CORP	10,158	184.210	1,871,205.180	
DISCOVER FINANCIAL	39,188	121.710	4,769,571.480	
TE CONNECTIVITY LTD	47,054	143.110	6,733,897.940	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,255	457.890	7,900,891.950	
MERCADOLIBRE INC	6,913	1,629.320	11,263,489.160	
ULTA BEAUTY INC	7,263	549.780	3,993,052.140	
MSCI INC	11,948	568.970	6,798,053.560	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	236,746	91.560	21,676,463.760	
VISA INC	244,821	283.600	69,431,235.600	
KEURIG DR PEPPER INC	160,760	30.190	4,853,344.400	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	31,751	118.960	3,777,098.960	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,528	169.540	10,431,457.120	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	21,430	80.760	1,730,686.800	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	298,312	17.250	5,145,882.000	
XYLEM INC	36,891	125.630	4,634,616.330	

LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	40,421	99.270	4,012,592.670
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,481	288.140	1,867,435.340
SPLUNK INC	24,788	155.550	3,855,773.400
EPAM SYSTEMS INC	8,162	301.800	2,463,291.600
HCA HEALTHCARE INC	30,702	315.360	9,682,182.720
VERISK ANALYTICS INC	21,663	244.830	5,303,752.290
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,706	132.280	1,416,189.680
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,295	281.200	2,894,954.000
NXP SEMICONDUCTOR NV	38,938	238.850	9,300,341.300
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,242	148.910	2,865,326.220
TARGA RESOURCES CORP	33,263	97.030	3,227,508.890
LEAR CORP	9,398	135.200	1,270,609.600
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,608	197.150	3,077,117.200
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,295	64.900	2,225,745.500
DOLLAR GENERAL CORP	33,444	140.400	4,695,537.600
FORTINET INC	100,599	67.640	6,804,516.360
HYATT HOTELS CORP	6,647	150.170	998,179.990
TESLA INC	435,758	191.970	83,652,463.260
ENPHASE ENERGY INC	21,539	118.190	2,545,694.410
GENERAL MOTORS CO	208,056	39.630	8,245,259.280
ALLY FINANCIAL INC	39,230	36.210	1,420,518.300
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	11,895	263.360	3,132,667.200
APTIV PLC	43,097	77.230	3,328,381.310
PHILLIPS 66	68,358	147.110	10,056,145.380
META PLATFORMS INC	338,766	484.030	163,972,906.980
IQVIA HOLDINGS INC	27,848	247.260	6,885,696.480
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,850	176.360	4,382,546.000
SERVICENOW INC	31,178	770.970	24,037,302.660
PALO ALTO NETWORKS INC	46,854	282.090	13,217,044.860
WORKDAY INC	31,060	305.880	9,500,632.800
ABBVIE INC	268,895	178.090	47,887,510.550
ZOETIS INC	70,224	197.210	13,848,875.040
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	26.430	1,432,796.730
CDW CORP	20,262	247.110	5,006,942.820
HOWMET AEROSPACE INC	63,110	65.870	4,157,055.700
TWILIO INC	25,710	58.010	1,491,437.100
SNAP INC	152,250	10.800	1,644,300.000
TRADE DESK INC A	66,855	81.440	5,444,671.200
OKTA INC	21,831	83.240	1,817,212.440
BAKER HUGHES CO	152,160	29.890	4,548,062.400
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,785	102.670	2,236,665.950
CNH INDUSTRIAL NV	161,962	12.220	1,979,175.640
BROADCOM INC	67,679	1,296.370	87,737,025.230
ARES MANAGEMENT CORP	23,161	131.900	3,054,935.900

MONGODB INC	10,906	451.520	4,924,277.120	
BURLINGTON STORES INC	10,565	199.400	2,106,661.000	
VEEVA SYSTEMS INC	23,273	221.640	5,158,227.720	
EVERGY INC	33,192	50.570	1,678,519.440	
ALLEGION PLC	13,423	129.090	1,732,775.070	
DAYFORCE INC	22,002	71.420	1,571,382.840	
STERIS PLC	15,540	235.850	3,665,109.000	
DOCUSIGN INC	31,974	51.730	1,654,015.020	
WIX.COM LTD	8,997	134.220	1,207,577.340	
DROPBOX INC	41,801	24.000	1,003,224.000	
KKR & CO INC	90,373	95.800	8,657,733.400	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	50.550	255,277.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	63.400	2,146,533.800	
MODERNA INC	50,006	96.460	4,823,578.760	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	40,232	204.540	8,229,053.280	
CIGNA GROUP	45,163	344.240	15,546,911.120	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,669	90.350	3,493,744.150	
DOW INC	106,037	56.390	5,979,426.430	
OVINTIV INC	39,160	45.970	1,800,185.200	
AMCOR PLC	223,348	9.270	2,070,435.960	
PINTEREST INC	90,936	35.860	3,260,964.960	
FOX CORP-A	36,501	30.230	1,103,425.230	
FOX CORP-B	27,507	27.680	761,393.760	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	33,813	311.490	10,532,411.370	
AVANTOR INC	97,157	24.350	2,365,772.950	
DYNATRACE INC	39,362	50.010	1,968,493.620	
CLOUDFLARE INC	43,284	98.450	4,261,309.800	
TRADEWEB MARKETS INC	16,918	105.090	1,777,912.620	
CARRIER GLOBAL CORP	124,379	54.200	6,741,341.800	
OTIS WORLDWIDE CORP	62,600	93.520	5,854,352.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	281,119	78.200	21,983,505.800	
CORTEVA INC	108,001	54.900	5,929,254.900	
MATCH GROUP INC	44,764	36.860	1,650,001.040	
FERGUSON PLC	30,868	207.560	6,406,962.080	
BILL HOLDINGS INC	16,243	63.290	1,028,019.470	
BLACKSTONE INC	108,546	125.110	13,580,190.060	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,809	173.420	1,007,396.780	
CARLYLE GROUP INC	34,847	44.640	1,555,570.080	
DATADOG INC	38,635	129.510	5,003,618.850	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	30,890	87.980	2,717,702.200	
VERTIV HOLDINGS CO	53,234	62.700	3,337,771.800	
INGERSOLL RAND INC	61,976	90.530	5,610,687.280	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	62,373	89.070	5,555,563.110	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,941	184.670	1,651,134.470	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	10.070	940,799.820	
DRAFTKINGS INC	63,900	41.280	2,637,792.000	

UNITY SOFTWARE INC	40,967	31.260	1,280,628.420
AON PLC	31,309	315.320	9,872,353.880
WARNER BROS DISCOVERY INC	351,421	8.610	3,025,734.810
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,561.360	1,414,592.160
BENTLEY SYSTEMS INC	33,634	52.180	1,755,022.120
COINBASE GLOBAL INC	26,305	165.980	4,366,103.900
UIPATH INC	53,439	23.330	1,246,731.870
AIRBNB INC	64,456	152.660	9,839,852.960
CONSTELLATION ENERGY CORP	48,214	133.990	6,460,193.860
MONDAY.COM LTD	4,308	207.900	895,633.200
ROYALTY PHARMA PLC	62,173	31.030	1,929,228.190
ROBLOX CORP	66,477	41.460	2,756,136.420
VIATRIS INC	184,148	13.530	2,491,522.440
CAESARS ENTERTAINMENT INC	34,604	41.650	1,441,256.600
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	81.930	1,298,262.780
HF SINCLAIR CORP	25,560	57.830	1,478,134.800
SNOWFLAKE INC	42,608	229.340	9,771,718.720
DOORDASH INC	39,376	121.760	4,794,421.760
ARISTA NETWORKS INC	39,238	267.660	10,502,443.080
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	59,548	111.610	6,646,152.280
GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	33.110	526,217.230
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	273,108	22.970	6,273,290.760
FNF GROUP	38,907	50.060	1,947,684.420
JACOBS SOLUTIONS INC	18,723	146.990	2,752,093.770
MARVELL TECHNOLOGY INC	129,101	67.580	8,724,645.580
APA CORP	49,146	30.030	1,475,854.380
CONFLUENT INC	27,524	33.180	913,246.320
LINDE PLC	74,454	447.560	33,322,632.240
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	14.480	1,065,235.680
LUCID GROUP INC	143,927	3.020	434,659.540
U-HAUL HOLDING CO	11,981	63.550	761,392.550
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	183.760	683,770.960
TOAST INC	45,399	21.090	957,464.910
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.160	883,267.400
CATALENT INC	27,357	58.770	1,607,770.890
SYNCHRONY FINANCIAL	68,701	40.120	2,756,284.120
VERALTO CORP	37,086	86.710	3,215,727.060
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	19,871	30.160	599,309.360
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	28,191	68.750	1,938,131.250
BUNGE GLOBAL SA	21,715	93.650	2,033,609.750
KENVUE INC	264,038	19.180	5,064,248.840
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	73,013	31.150	2,274,354.950

	CYBERARK SOFTWARE LTD	6,799	255.910	1,739,932.090	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,713	149.970	4,156,118.610	
	HUBSPOT INC	7,360	605.410	4,455,817.600	
	QORVO INC	14,144	112.800	1,595,443.200	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,444	62.000	1,143,528.000	
	LIBERTY GLOBAL LTD	36,034	19.220	692,573.480	
	GODADDY INC	19,713	114.910	2,265,220.830	
	ETSY INC	18,558	73.980	1,372,920.840	
	TRANSUNION	31,262	77.440	2,420,929.280	
	ALBERTSONS COS INC	54,086	21.440	1,159,603.840	
	BLOCK INC	84,306	78.920	6,653,429.520	
	DUPONT DE NEMOURS INC	68,235	69.960	4,773,720.600	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,012	68.560	2,126,182.720	
	WESTROCK CO	34,286	43.910	1,505,498.260	
	KRAFT HEINZ CO	129,447	36.050	4,666,564.350	
	FORTIVE CORP	55,370	86.110	4,767,910.700	
	WASTE CONNECTIONS INC	38,848	170.150	6,609,987.200	
	ALPHABET INC-CL A	907,230	143.960	130,604,830.800	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	186,711	15.110	2,821,203.210	
	PAYPAL HOLDINGS INC	158,507	59.160	9,377,274.120	
	SEA LTD ADR	58,070	45.020	2,614,311.400	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	56,329	34.680	1,953,489.720	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	53.530	1,197,680.220	
	ALPHABET INC-CL C	792,918	145.290	115,203,056.220	
	ZSCALER INC	14,051	235.230	3,305,216.730	
	ATLASSIAN CORP PLC	23,713	204.440	4,847,885.720	
	ROKU INC	19,331	64.480	1,246,462.880	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,049	299.420	4,505,971.580	
	VISTRA CORP	49,633	48.620	2,413,156.460	
アメリカ・ドル	小計	51,718,146		6,703,660,642.350 (1,007,962,414,184)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	17.965	1,101,164.670	
	ASHTED GROUP	66,851	54.660	3,654,075.660	
	SEVERN TRENT PLC	45,548	25.290	1,151,908.920	
	BARCLAYS PLC	2,229,023	1.637	3,648,910.650	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.785	594,277.860	
	BT GROUP PLC	904,198	1.069	966,587.660	
	BUNZL PLC	53,979	33.060	1,784,545.740	
	CRH PLC	108,593	62.140	6,747,969.020	
	AVIVA PLC	429,205	4.522	1,940,865.010	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	49.250	1,013,220.250	
	DIAGEO PLC	346,858	29.860	10,357,179.880	
	SCHRODERS PLC	110,366	3.975	438,704.850	
	DCC PLC	17,471	57.820	1,010,173.220	

NATIONAL GRID PLC	547,462	10.345	5,663,494.390
KINGFISHER PLC	336,026	2.293	770,507.610
BAE SYSTEMS PLC	457,388	12.405	5,673,898.140
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	325,671	23.880	7,777,023.480
HALMA PLC	62,208	23.620	1,469,352.960
NEXT PLC	18,588	84.440	1,569,570.720
IMPERIAL BRANDS PLC	126,179	18.290	2,307,813.910
ANGLO AMERICAN PLC	193,117	17.860	3,449,069.620
COMPASS GROUP PLC	259,074	21.810	5,650,403.940
HSBC HOLDINGS PLC	2,973,100	5.972	17,755,353.200
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.420	2,072,485.580
CENTRICA PLC	793,776	1.276	1,012,858.170
UNILEVER PLC	382,437	40.020	15,305,128.740
UNITED UTILITIES GROUP PLC	115,134	10.345	1,191,061.230
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	55,043	22.910	1,261,035.130
PEARSON PLC	84,159	9.532	802,203.580
PERSIMMON PLC	56,989	14.125	804,969.620
PRUDENTIAL PLC	418,146	8.196	3,427,124.610
RIO TINTO PLC	173,077	51.970	8,994,811.690
VODAFONE GROUP PLC	3,582,903	0.662	2,371,881.780
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	107,096	58.220	6,235,129.120
RELX PLC	289,143	35.000	10,120,005.000
RENTOKIL INITIAL PLC	374,845	4.288	1,607,335.360
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,303,232	3.531	4,601,712.190
NATWEST GROUP PLC	896,355	2.315	2,075,061.820
ST JAMES' S PLACE PLC	89,082	6.430	572,797.260
SSE PLC	168,922	15.865	2,679,947.530
BP PLC	2,571,529	4.661	11,985,896.660
SAGE GROUP PLC (THE)	152,196	12.155	1,849,942.380
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.345	844,954.770
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	104.550	1,124,017.050
STANDARD CHARTERED PLC	362,528	6.350	2,302,052.800
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,868,076	0.454	4,480,106.500
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.460	831,999.980
TESCO PLC	1,030,735	2.797	2,882,965.790
3I GROUP PLC	149,486	24.360	3,641,478.960
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	11.345	1,428,675.850
GSK PLC	626,067	16.724	10,470,344.500
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63,356	89.220	5,652,622.320
WPP PLC	176,061	7.300	1,285,245.300
ASTRAZENECA PLC	236,572	102.200	24,177,658.400
WHITBREAD PLC	31,475	35.090	1,104,457.750
INTERTEK GROUP PLC	23,309	46.450	1,082,703.050

	BURBERRY GROUP PLC	52,229	13.040	681,066.160	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	26,874	87.520	2,352,012.480	
	SAINSBURY (J) PLC	265,807	2.540	675,149.780	
	ADMIRAL GROUP PLC	40,084	25.330	1,015,327.720	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	47.140	777,291.460	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	20.740	382,756.700	
	ABRDN PLC	285,831	1.640	468,762.840	
	EXPERIAN PLC	140,133	34.320	4,809,364.560	
	MONDI PLC	67,554	14.255	962,982.270	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.490	276,695.580	
	OCADO GROUP PLC	69,766	5.284	368,643.540	
	INFORMA PLC	223,961	8.246	1,846,782.400	
	GLENCORE PLC	1,570,188	3.758	5,900,766.500	
	ENTAIN PLC	96,924	9.112	883,171.480	
	COCA-COLA HBC AG	31,035	24.950	774,323.250	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	135,828	5.040	684,573.120	
	M&G PLC	270,401	2.246	607,320.640	
	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	12.630	354,587.250	
	WISE PLC	96,207	8.590	826,418.130	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.154	440,909.930	
	HALEON PLC	836,729	3.273	2,738,614.010	
	SHELL PLC	1,011,099	24.940	25,216,809.060	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	7.346	1,051,859.040	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	27,104	166.700	4,518,236.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	216,124	6.162	1,331,756.080	
	イギリス・ポンド 小計	41,702,434		286,722,922.610 (54,592,044,465)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	33.540	6,285,530.160	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	239,083	29.120	6,962,096.960	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	759.800	2,530,134.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.240	2,972,098.560	
	ICL GROUP LTD	103,067	18.870	1,944,874.290	
	NICE LTD	9,053	876.600	7,935,859.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	29,444	141.000	4,151,604.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	254.900	1,190,892.800	
	イスラエル・シュケル 小計	738,997		33,973,090.570 (1,406,424,798)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	50.750	1,436,529.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	520,190	25.940	13,493,728.600	
	FORTESCUE LTD	253,090	28.210	7,139,668.900	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.880	2,327,429.640	
	ASX LTD	31,215	65.110	2,032,408.650	
	BHP GROUP LTD	775,707	44.550	34,557,746.850	

AMPOL LTD	31,828	38.610	1,228,879.080
COMPUTERSHARE LT	91,624	25.720	2,356,569.280
CSL LIMITED	73,693	285.340	21,027,560.620
REA GROUP LTD	9,317	187.440	1,746,378.480
TRANSURBAN GROUP	476,258	13.380	6,372,332.040
COCHLEAR LTD	10,446	343.730	3,590,603.580
ORIGIN ENERGY LTD	257,692	9.070	2,337,266.440
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	255,604	114.830	29,351,007.320
RIO TINTO LIMITED	56,991	124.400	7,089,680.400
APA GROUP	222,829	8.180	1,822,741.220
ARISTOCRAT LEISU	86,829	44.840	3,893,412.360
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	6.090	2,192,899.380
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	69,336	58.880	4,082,503.680
IGO LTD	91,947	7.230	664,776.810
ORICA LTD	63,862	16.930	1,081,183.660
BLUESCOPE STEEL LTD	76,587	23.450	1,795,965.150
MACQUARIE GROUP LTD	56,701	193.080	10,947,829.080
SUNCORP GROUP LTD	199,628	15.130	3,020,371.640
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	465,095	33.860	15,748,116.700
QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.300	597,092.700
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	219,807	16.850	3,703,747.950
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	12.770	2,076,772.330
REECE LTD	31,558	24.090	760,232.220
SANTOS LTD	478,809	7.420	3,552,762.780
SONIC HEALTHCARE	64,897	29.300	1,901,482.100
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	39,420	34.740	1,369,450.800
WESFARMERS LTD	172,824	64.980	11,230,103.520
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	282,153	30.510	8,608,488.030
WOOLWORTHS GROUP LTD	183,840	32.780	6,026,275.200
SEEK LTD	58,513	25.370	1,484,474.810
MINERAL RESOURCES LTD	28,865	62.320	1,798,866.800
BRAMBLES LTD	220,767	15.270	3,371,112.090
PILBARA MINERALS LTD	404,496	3.670	1,484,500.320
CAR GROUP LTD	58,310	35.360	2,061,841.600
AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.950	880,253.550
TREASURY WINE ESTATES LTD	134,910	12.190	1,644,552.900
XERO LTD	23,149	119.910	2,775,796.590
IDP EDUCATION LTD	44,923	18.550	833,321.650
LOTTERY CORP LTD	291,270	5.090	1,482,564.300
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.260	1,228,946.400

	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	443,450	28.290	12,545,200.500	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.630	1,498,286.130	
	SOUTH32 LTD (AUD)	682,738	2.890	1,973,112.820	
	COLES GROUP LTD	197,589	15.730	3,108,074.970	
	WISETECH GLOBAL LTD	27,325	87.950	2,403,233.750	
オーストラリア・ドル	小計	10,398,851		261,738,135.870 (25,789,058,527)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	75,291	67.000	5,044,497.000	
	BARRICK GOLD CORP	267,495	19.900	5,323,150.500	
	BANK OF MONTREAL	109,727	128.140	14,060,417.780	
	BANK OF NOVA SCOTIA	183,639	64.260	11,800,642.140	
	NATIONAL BANK OF CANADA	51,706	104.670	5,412,067.020	
	BCE INC	14,197	50.760	720,639.720	
	BROOKFIELD CORP	211,045	55.720	11,759,427.400	
	SAPUTO INC	34,582	28.080	971,062.560	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	8.060	744,026.660	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	116.650	1,342,408.200	
	CGI INC	31,091	156.950	4,879,732.450	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	68.940	1,451,738.520	
	CAE INC	40,808	25.840	1,054,478.720	
	CAMECO CORP	66,084	54.270	3,586,378.680	
	ROGERS COMM-CL B	53,375	61.860	3,301,777.500	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	143,011	63.380	9,064,037.180	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	164,344	88.190	14,493,497.360	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,911	141.910	1,264,560.010	
	CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	30.780	502,637.400	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	83,693	177.690	14,871,409.170	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	30,142	47.890	1,443,500.380	
	OPEN TEXT CORP	40,459	52.240	2,113,578.160	
	EMPIRE CO LTD	20,608	34.800	717,158.400	
	KINROSS GOLD CORP	192,737	6.730	1,297,120.010	
	RB GLOBAL INC	26,641	103.520	2,757,876.320	
	FORTIS INC	72,078	53.170	3,832,387.260	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	12.420	1,060,928.820	
	TELUS CORP	31,890	24.320	775,564.800	
	GREAT WEST LIFECO INC	43,551	42.580	1,854,401.580	
	IMPERIAL OIL LTD	27,434	83.240	2,283,606.160	
	ENBRIDGE INC	326,190	47.000	15,330,930.000	
	IGM FINANCIAL INC	12,478	35.830	447,086.740	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	271,363	32.810	8,903,420.030	
	LOBLAW CO LTD	24,803	144.600	3,586,513.800	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	116,251	86.270	10,028,973.770	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	42,279	73.370	3,102,010.230	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	90,324	74.430	6,722,815.320	

FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,133	1,410.000	4,417,530.000	
METRO INC	35,059	73.690	2,583,497.710	
EMERA INC	44,643	48.560	2,167,864.080	
ONEX CORP	10,157	101.800	1,033,982.600	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	17.360	961,275.280	
POWER CORP OF CANADA	89,864	39.900	3,585,573.600	
QUEBECOR INC-B	30,598	30.230	924,977.540	
ROYAL BANK OF CANADA	213,523	133.220	28,445,534.060	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	144,017	116.830	16,825,506.110	
STANTEC INC	18,358	112.250	2,060,685.500	
SUNCOR ENERGY INC	198,439	45.790	9,086,521.810	
LUNDIN MINING CORP	119,660	10.940	1,309,080.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	65,896	53.500	3,525,436.000	
THOMSON REUTERS CORP	24,837	213.840	5,311,144.080	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	13,097	125.580	1,644,721.260	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	279,545	81.620	22,816,462.900	
TC ENERGY CORP	157,154	53.700	8,439,169.800	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	103.960	842,283.920	
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	180.610	1,777,021.790	
INTACT FINANCIAL CORP	26,758	234.550	6,276,088.900	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	73,865	53.820	3,975,414.300	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,041	3,750.000	11,403,750.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	29,420	145.430	4,278,550.600	
TOURMALINE OIL CORP	49,085	59.310	2,911,231.350	
KEYERA CORP	39,997	34.050	1,361,897.850	
PARKLAND CORP	24,129	47.760	1,152,401.040	
ALTAGAS LTD	47,249	28.910	1,365,968.590	
PEMBINA PIPELINE CORP	82,164	46.840	3,848,561.760	
DOLLARAMA INC	41,508	105.690	4,386,980.520	
MEG ENERGY CORP	47,181	27.030	1,275,302.430	
CENOVUS ENERGY INC W/I	226,767	23.780	5,392,519.260	
ARC RESOURCES LTD	96,301	22.670	2,183,143.670	
NORTHLAND POWER INC	34,152	23.060	787,545.120	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	23.210	1,189,350.030	
TMX GROUP LTD	46,884	34.200	1,603,432.800	
BRP INC	4,307	89.500	385,476.500	
IVANHOE MINES LTD	98,820	14.650	1,447,713.000	
NUTRIEN LTD	77,339	71.910	5,561,447.490	
TFI INTERNATIONAL INC	11,591	200.680	2,326,081.880	
WSP GLOBAL INC	20,394	212.460	4,332,909.240	
IA FINANCIAL CORP INC	16,448	86.050	1,415,350.400	
GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	48.100	1,715,582.700	
BROOKFIELD RENEWABLE	16,103	33.160	533,975.480	

	CORP				
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	55.630	2,906,611.870	
	AIR CANADA	41,858	18.170	760,559.860	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	45,113	102.810	4,638,067.530	
	SHOPIFY INC	184,248	102.930	18,964,646.640	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	222.470	1,165,075.390	
	HYDRO ONE LTD	46,225	41.150	1,902,158.750	
カナダ・ドル 小計		6,231,492		397,112,521.140 (44,174,796,852)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.970	682,046.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	162,200	5.220	846,684.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	268,710	33.830	9,090,459.300	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	101,000	6.040	610,040.000	
	SEATRIUM LTD	7,235,222	0.093	672,875.640	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	26.080	404,240.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	139,900	9.570	1,338,843.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.930	707,909.490	
	KEPPEL LTD	249,600	7.260	1,812,096.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	502,098	13.370	6,713,050.260	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,340,830	2.370	3,177,767.100	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.550	1,598,200.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	191,566	28.250	5,411,739.500	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.340	276,424.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.390	876,315.000		
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	405,290	2.780	1,126,706.200		
シンガポール・ドル 小計		12,091,009		35,345,395.490 (3,952,675,578)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	78.800	1,870,239.200	
	NESTLE SA-REGISTERED	407,736	95.350	38,877,627.600	
	CIE FINANC RICHEMONT	80,541	137.600	11,082,441.600	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	107,011	232.400	24,869,356.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	234.200	1,243,836.200	
	SIKA INHABER	23,397	258.800	6,055,143.600	
	SGS SA-REG	22,978	85.860	1,972,891.080	
	NOVARTIS AG-REG SHS	312,075	91.630	28,595,432.250	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	143.200	834,856.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,320.000	607,200.000	
	CLARIANT AG-REG	22,909	11.240	257,497.160	
	SWISSCOM AG-REG	4,457	516.200	2,300,703.400	
	ABB LTD	247,495	40.370	9,991,373.150	
ADECCO GROUP AG-REG	26,454	37.310	986,998.740		

	GEBERIT AG	5,105	523.800	2,673,999.000	
	LONZA GROUP AG-REG	11,536	463.600	5,348,089.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	161	10,930.000	1,759,730.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	110,400.000	1,766,400.000	
	GIVAUDAN-REG	1,392	3,791.000	5,277,072.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	22,160	463.000	10,260,080.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	247.800	1,191,918.000	
	HOLCIM LTD	77,519	69.320	5,373,617.080	
	TEMENOS GROUP	10,930	64.280	702,580.400	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	68.150	318,464.950	
	SONOVA HOLDING AG	8,100	290.900	2,356,290.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	287.900	2,271,531.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,475	146.600	2,415,235.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,300	209.200	899,560.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	40.750	377,304.250	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	125.400	615,212.400	
	SCHINDLER NAMEN	4,209	226.800	954,601.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,503	648.800	2,921,546.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	108.700	532,956.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	1,245	637.000	793,065.000	
	SWISS PRIME SITE AG	13,356	86.100	1,149,951.600	
	AVOLTA AG	12,933	35.720	461,966.760	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,433	1,252.500	4,299,832.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,114	47.310	1,519,313.340	
	SWISS RE LTD	45,502	106.500	4,845,963.000	
	BKW AG	3,194	131.800	420,969.200	
	SIG GROUP AG	50,969	17.800	907,248.200	
	ALCON INC	74,922	70.500	5,282,001.000	
	SANDOZ GROUP AG	57,347	28.060	1,609,156.820	
	UBS GROUP AG	503,306	24.720	12,441,724.320	
	VAT GROUP AG	4,131	443.000	1,830,033.000	
スイス・フラン	小計	2,295,687		213,123,008.500 (36,352,391,560)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	396,072	178.400	70,659,244.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	241,869	154.350	37,332,480.150	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	56.450	23,596,100.000	
	GETINGE AB-B SHS	38,925	209.300	8,147,002.500	
	LUNDBERGS B	14,872	563.400	8,378,884.800	
	SKF AB-B SHS	46,594	221.600	10,325,230.400	
	SANDVIK AB	169,218	230.600	39,021,670.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	250,203	150.450	37,643,041.350	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	185.150	8,134,935.550	
	SWEDBANK AB	132,581	221.400	29,353,433.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,795	141.150	13,098,014.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	218,846	121.300	26,546,019.800	

SHS				
VOLVO AB-A SHS	24,198	284.200	6,877,071.600	
VOLVO AB-B SHS	237,569	280.800	66,709,375.200	
HOLMEN AB-B SHS	17,320	404.800	7,011,136.000	
TELE2 AB-B SHS	67,654	83.420	5,643,696.680	
INDUSTRIVARDEN A	15,292	349.800	5,349,141.600	
INDUSTRIVARDEN C	21,325	350.400	7,472,280.000	
SAAB AB-B	11,789	789.800	9,310,952.200	
SECURITAS AB-B SHS	76,085	107.800	8,201,963.000	
INVESTOR AB-B SHS	271,548	259.950	70,588,902.600	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	104,669	141.200	14,779,262.800	
ASSA ABLOY AB-B	153,368	294.600	45,182,212.800	
TELIA CO AB	344,810	24.520	8,454,741.200	
BOLIDEN AB	36,260	264.100	9,576,266.000	
ALFA LAVAL AB	44,407	382.100	16,967,914.700	
FASTIGHETS AB BALDER	72,942	65.480	4,776,242.160	
INDUTRADE AB	39,178	280.500	10,989,429.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	81.700	3,902,727.300	
NIBE INDUSTRIER AB	212,832	56.960	12,122,910.720	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,381	262.400	9,546,374.400	
HEXAGON AB-B SHS	307,116	121.750	37,391,373.000	
SAGAX AB	28,022	250.200	7,011,104.400	
EPIROC AB-A	103,115	194.350	20,040,400.250	
EPIROC AB-B	61,487	172.800	10,624,953.600	
ESSITY AB-B	86,900	243.600	21,168,840.000	
EQT AB	55,194	293.400	16,193,919.600	
VOLVO CAR AB	63,710	35.620	2,269,350.200	
BEIJER REF AB	50,493	146.000	7,371,978.000	
LIFCO AB	39,631	278.500	11,037,233.500	
EVOLUTION AB	28,266	1,355.400	38,311,736.400	
INVESTMENT AB LATOUR	27,638	268.800	7,429,094.400	
スウェーデン・クローナ 小計	4,750,880		814,548,641.110 (11,859,828,215)	
デンマーク・クローネ				
CARLSBERG AS-B	15,167	960.600	14,569,420.200	
A P MOLLER A/S	663	10,145.000	6,726,135.000	
AP MOLLER MAERSK A	543	9,950.000	5,402,850.000	
DANSKE BANK A/S	102,303	194.000	19,846,782.000	
GENMAB A/S	9,783	2,013.000	19,693,179.000	
NOVOZYMES-B SHS	54,795	387.800	21,249,501.000	
ROCKWOOL AS	873	2,258.000	1,971,234.000	
NOVO NORDISK A/S-B	498,024	849.000	422,822,376.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	154,521	177.460	27,421,296.660	
COLOPLAST-B	21,291	913.400	19,447,199.400	
DSV A/S	28,190	1,120.500	31,586,895.000	
DEMANT A/S	17,700	369.000	6,531,300.000	
TRYG A/S	58,222	146.300	8,517,878.600	
PANDORA A/S	12,473	1,151.500	14,362,659.500	
ORSTED A/S	26,911	377.100	10,148,138.100	

デンマーク・クローネ 小計		1,001,459		630,296,844.460 (13,753,077,146)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	229,726	8.130	1,867,672.380	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.910	920,409.210	
	FISHER & PAYKEL	78,460	24.600	1,930,116.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	312,723	5.155	1,612,087.060	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.990	439,209.660	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.900	1,411,917.200	
ニュージーランド・ドル 小計		948,682		8,181,411.510 (758,253,219)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	73,118	200.300	14,645,535.400	
	NORSK HYDRO ASA	221,182	56.160	12,421,581.120	
	TELENOR ASA	119,576	115.850	13,852,879.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	670.000	7,493,950.000	
	ORKLA ASA	116,068	76.200	8,844,381.600	
	EQUINOR ASA	129,895	265.400	34,474,133.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,414	345.600	10,165,478.400	
	AKER BP ASA	40,933	257.400	10,536,154.200	
	SALMAR ASA	12,897	649.200	8,372,732.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	172.700	4,442,016.700	
	ADEVINTA ASA	54,715	112.800	6,171,852.000	
DNB BANK ASA	143,909	207.300	29,832,335.700		
ノルウェー・クローネ 小計		978,613		161,253,030.120 (2,297,855,679)	
ユーロ	KERRY GROUP PLC-A	25,025	81.760	2,046,044.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	84.940	1,856,788.400	
	UMICORE	33,545	19.940	668,887.300	
	AIR LIQUIDE	79,831	189.500	15,127,974.500	
	AIRBUS SE	90,775	147.960	13,431,069.000	
	AXA SA	271,713	32.300	8,776,329.900	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	98,192	30.190	2,964,416.480	
	ADIDAS AG	24,550	188.780	4,634,549.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	22.140	3,201,731.820	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	182.300	568,776.000	
	DANONE	96,532	60.710	5,860,457.720	
	SAFRAN SA	51,062	193.020	9,855,987.240	
	INTESA SANPAOLO	2,330,103	2.939	6,848,172.710	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,783	106.720	5,312,841.760	
	ACCOR SA	31,427	41.030	1,289,449.810	
	BOUYGUES	29,123	34.260	997,753.980	
	BNP PARIBAS	160,893	56.390	9,072,756.270	
	THALES SA	15,023	135.600	2,037,118.800	
	CAPGEMINI SA	25,063	225.900	5,661,731.700	
	LOTUS BAKERIES NV	77	8,860.000	682,220.000	
UNICREDIT SPA	244,666	31.010	7,587,092.660		
BE SEMICONDUCTOR	12,403	153.450	1,903,240.350		

INDUSTRIES NV				
D' IETEREN TRDG	2,736	178.100	487,281.600	
COMMERZBANK AG	158,792	10.720	1,702,250.240	
EIFFAGE	12,706	98.600	1,252,811.600	
FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	25.670	1,509,755.380	
PUBLICIS GROUPE	33,467	98.440	3,294,491.480	
IBERDROLA SA	939,014	10.630	9,981,718.820	
ENI SPA	353,207	14.256	5,035,318.990	
JERONIMO MARTINS	45,606	22.220	1,013,365.320	
KESKO OYJ-B	35,252	17.750	625,723.000	
KBC GROUPE	35,962	64.080	2,304,444.960	
HANNOVER RUECK SE	9,638	236.200	2,276,495.600	
WARTSILA OYJ	77,148	14.500	1,118,646.000	
L' OREAL	36,699	450.200	16,521,889.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	42,243	850.100	35,910,774.300	
GEA GROUP AG	25,513	37.630	960,054.190	
BOLLORE	114,808	6.250	717,550.000	
MEDIOBANCA SPA	86,792	12.945	1,123,522.440	
MICHELIN (CGDE) -B	98,359	34.170	3,360,927.030	
CONTINENTAL AG	17,635	74.360	1,311,338.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	151,735	43.455	6,593,644.420	
OMV AG	23,354	40.590	947,938.860	
VERBUND AG	10,663	63.950	681,898.850	
PERNOD-RICARD	30,948	157.950	4,888,236.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	48.830	1,138,276.130	
RENAULT SA	27,902	37.605	1,049,254.710	
REPSOL SA	195,049	14.560	2,839,913.440	
REMY COINTREAU	2,866	99.560	285,338.960	
MERCK KGAA	20,216	159.000	3,214,344.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	69,501	70.190	4,878,275.190	
RWE AG	98,751	30.970	3,058,318.470	
SEB SA	2,596	114.200	296,463.200	
SOCIETE GENERALE-A	116,635	22.495	2,623,704.320	
VINCI S. A.	76,313	116.760	8,910,305.880	
SODEXO	12,910	73.600	950,176.000	
SOFINA	2,281	215.000	490,415.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	83,164	209.800	17,447,807.200	
VIVENDI SE	98,944	10.230	1,012,197.120	
SAP SE	159,438	169.800	27,072,572.400	
TELEFONICA S. A	755,720	3.776	2,853,598.720	
TOTALENERGIES SE	349,395	59.660	20,844,905.700	
E. ON SE	339,366	11.800	4,004,518.800	
VOEST-ALPINE AG	18,032	25.140	453,324.480	
HENKEL AG & CO KGAA	17,886	63.460	1,135,045.560	
SIEMENS AG-REG	116,150	175.300	20,361,095.000	
UPM-KYMMENE OYJ	77,973	29.750	2,319,696.750	
ING GROEP NV-CVA	540,815	12.700	6,868,350.500	

PUMA AG	17,210	42.310	728,155.100
BAYER AG	147,329	28.815	4,245,285.130
STORA ENSO OYJ-R SHS	95,980	11.200	1,074,976.000
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	70.280	1,700,143.480
MERCEDES-BENZ GROUP AG	123,737	71.680	8,869,468.160
BASF SE	135,442	46.600	6,311,597.200
BEIERSDORF AG	15,743	140.750	2,215,827.250
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	84.780	1,830,061.080
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	33,632	35.450	1,192,254.400
ASM INTERNATIONAL NV	7,273	554.800	4,035,060.400
ORANGE	286,957	10.768	3,089,952.970
SAMPO OYJ-A SHS	70,999	41.185	2,924,093.810
RANDSTAD NV	15,584	51.520	802,887.680
ALLIANZ SE	61,413	246.500	15,138,304.500
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	505,441	3.723	1,881,756.840
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	146,667	27.655	4,056,075.880
HERMES INTL	4,880	2,301.000	11,228,880.000
ENDESA S. A.	50,946	16.725	852,071.850
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	108,647	7.381	801,923.500
ERSTE GROUP BANK AG	56,574	39.370	2,227,318.380
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	20,996	423.400	8,889,706.400
ARCELOR MITTAL (NL)	81,129	24.315	1,972,651.630
DASSAULT SYSTEMES SA	101,597	43.330	4,402,198.010
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,836	37.160	1,294,505.760
RHEINMETALL STAMM	6,662	410.300	2,733,418.600
HEINEKEN NV	43,759	89.120	3,899,802.080
AKZO NOBEL	26,032	68.480	1,782,671.360
ASML HOLDING NV	61,491	865.000	53,189,715.000
AEGON LTD	232,433	5.400	1,255,138.200
VOLKSWAGEN AG	5,460	141.350	771,771.000
VOLKSWAGEN AG PFD	30,425	124.000	3,772,700.000
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	914,652	9.430	8,625,168.360
KERING	11,443	425.650	4,870,712.950
ACCIONA S. A.	5,005	104.650	523,773.250
FORTUM OYJ	73,699	11.070	815,847.930
AGEAS	24,086	40.010	963,680.860
UCB SA	20,020	96.420	1,930,328.400
NEMETSCHEK SE	10,222	87.400	893,402.800
CARREFOUR SA	90,642	16.415	1,487,888.430
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	23.140	409,045.780
NOKIA OYJ	827,068	3.275	2,708,647.700
KONINKLIJKE PHILIPS NV	121,772	18.650	2,271,047.800
WOLTERS KLUWER-CVA	38,724	148.200	5,738,896.800
SANOFI	174,457	89.710	15,650,537.470

STMICROELECTRONICS NV	104,058	41.545	4,323,089.610
ELISA OYJ	20,242	42.810	866,560.020
BANCO SANTANDER SA	2,484,377	3.834	9,525,101.410
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	65,589	14.790	970,061.310
QIAGEN N.V.	34,544	40.135	1,386,423.440
DEUTSCHE BANK AG-REG	282,637	12.390	3,501,872.430
BMW VORZUG	7,821	100.600	786,792.600
ENEL SPA	1,202,825	5.958	7,166,431.350
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	482,293	22.130	10,673,144.090
SARTORIUS AG	3,651	341.100	1,245,356.100
LEONARDO SPA	64,915	19.000	1,233,385.000
INFINEON TECHNOLOGIES AG	197,936	33.100	6,551,681.600
RATIONAL AG	542	768.500	416,527.000
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	113.450	552,047.700
BECHTLE AG	14,521	48.850	709,350.850
KONINKLIJKE KPN NV	496,095	3.398	1,685,730.810
EUROFINS SCIENTIFIC	23,038	58.020	1,336,664.760
TELEPERFORMANCE	9,581	132.750	1,271,877.750
DEUTSCHE BOERSE AG	28,751	191.300	5,500,066.300
EURAZEO	5,673	78.400	444,763.200
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	71.240	920,278.320
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	74.050	1,309,944.500
INDITEX	162,141	41.010	6,649,402.410
ESSILORLUXOTTICA	45,265	194.320	8,795,894.800
SNAM SPA	317,518	4.368	1,386,918.620
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	12.550	2,094,858.550
ENAGAS	38,270	14.365	549,748.550
TENARIS SA	76,002	16.420	1,247,952.840
TELECOM ITALIA SPA	1,970,516	0.285	561,597.060
TERNA SPA	207,655	7.400	1,536,647.000
BIOMERIEUX	4,870	105.150	512,080.500
GRIFOLS SA	31,982	11.495	367,633.090
NESTE OYJ	66,248	26.910	1,782,733.680
RECORDATI SPA	18,197	52.880	962,257.360
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	83,940	9.770	820,093.800
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	8,692	215.500	1,873,126.000
KONE OYJ	49,300	46.700	2,302,310.000
ELIA GROUP	4,078	102.300	417,179.400
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	251.200	968,376.000
ENGIE	277,054	14.840	4,111,481.360
ALSTOM	47,494	11.790	559,954.260
IPSEN SA	5,964	104.800	625,027.200
ARKEMA SA	10,489	100.800	1,057,291.200
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	97.660	292,101.060
LEGRAND SA	41,105	90.180	3,706,848.900
AMPLIFON SPA	20,249	32.280	653,637.720
ADP	6,104	131.500	802,676.000

ORION OYJ	13,559	38.500	522,021.500
METSO CORPORATION	102,831	10.040	1,032,423.240
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	79,585	14.570	1,159,553.450
SYMRISE AG	19,547	97.080	1,897,622.760
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	39,869	38.070	1,517,812.830
PRYSMIAN SPA	38,343	45.230	1,734,253.890
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	92.640	225,022.560
CAIXABANK	630,095	4.104	2,585,909.880
BUREAU VERITAS SA	39,729	27.370	1,087,382.730
GETLINK	63,968	15.610	998,540.480
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	13.330	529,041.040
AMADEUS IT GROUP SA	68,848	60.260	4,148,780.480
BRENTAG SE	21,559	84.000	1,810,956.000
EVONIK INDUSTRIES AG	42,836	17.300	741,062.800
EDENRED	35,618	50.240	1,789,448.320
TALANX AG	10,349	67.300	696,487.700
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	70.800	843,582.000
VONOVIA SE	107,478	26.440	2,841,718.320
BANK OF IRELAND GROUP PLC	164,156	9.096	1,493,162.970
KNORR-BREMSE AG	10,342	62.860	650,098.120
OCI NV	12,329	25.100	309,457.900
SIEMENS HEALTHINEERS AG	44,962	54.620	2,455,824.440
FERRARI NV	18,850	386.000	7,276,100.000
ASR NEDERLAND NV	27,365	43.020	1,177,242.300
AIB GROUP PLC	226,914	4.402	998,875.420
NORDEA BANK ABP	492,403	11.176	5,503,095.920
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	39.300	679,614.900
MONCLER SPA	29,763	64.100	1,907,808.300
NEXI SPA	83,576	7.130	595,896.880
PROSUS NV	220,842	28.330	6,256,453.860
DR ING HC F PORSCHE AG	18,371	82.660	1,518,546.860
JDE PEET'S BV	14,385	22.200	319,347.000
EXOR NV	14,142	101.100	1,429,756.200
SIEMENS ENERGY AG	74,892	13.730	1,028,267.160
EURONEXT NV	14,077	85.250	1,200,064.250
IMCD NV	9,332	143.200	1,336,342.400
WORLDLINE SA	36,232	11.605	420,472.360
NN GROUP NV	43,478	37.610	1,635,207.580
FINECOBANK SPA	96,393	13.150	1,267,567.950
ARGENX SE	9,078	377.600	3,427,852.800
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	125,611	26.940	3,383,960.340
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	83,468	36.670	3,060,771.560
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	19.780	194,279.160
DSM-FIRMENICH AG	28,846	97.140	2,802,100.440
SYENSQO SA	11,217	84.000	942,228.000
ZALANDO SE	31,321	19.380	607,000.980

	STELLANTIS NV	341,919	24.610	8,414,626.590	
	FERROVIAL SE	73,817	34.900	2,576,213.300	
	AENA SME SA	11,603	176.000	2,042,128.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	81,974	34.150	2,799,412.100	
	BANCO BPM SPA	202,727	5.464	1,107,700.320	
	ABN AMRO BANK NV	75,982	14.750	1,120,734.500	
	SCOUT24 SE	10,048	66.300	666,182.400	
	COVESTRO AG	27,558	50.000	1,377,900.000	
	HELLOFRESH SE	17,856	12.605	225,074.880	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	129,506	58.470	7,572,215.820	
	POSTE ITALIANE SPA	88,762	10.300	914,248.600	
	AMUNDI SA	11,288	61.500	694,212.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.680	447,267.720	
	ADYEN NV	3,378	1,467.600	4,957,552.800	
	DELIVERY HERO SE	22,564	22.240	501,823.360	
	ユーロ 小計	28,060,232		776,644,001.120 (126,336,679,662)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	8.600	2,210,200.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	63.550	15,366,135.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	46.800	4,367,095.200	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	183,491	253.200	46,459,921.200	
	MTR CORP	207,441	26.350	5,466,070.350	
	HANG SENG BANK LTD	122,096	90.600	11,061,897.600	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	297,972	21.950	6,540,485.400	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	47.000	10,002,540.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	202,000	27.800	5,615,600.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	6.040	9,279,892.240	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	336,904	43.450	14,638,478.800	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	680,495	20.450	13,916,122.750	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	9.740	1,685,662.840	
	SINO LAND CO	659,200	8.500	5,603,200.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	76.050	15,557,168.250	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	63.900	3,387,978.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	215,156	85.450	18,385,080.200	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	7.360	1,310,080.000	
	AIA GROUP LTD	1,778,516	64.750	115,158,911.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	797,136	9.430	7,516,992.480	
	SANDS CHINA LTD	335,800	23.550	7,908,090.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	13.340	1,867,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	15.720	3,169,152.000	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	25.900	6,633,896.500	
	ESR GROUP LTD	465,200	10.100	4,698,520.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	13.780	3,651,700.000	
	WH GROUP LTD	1,001,000	4.840	4,844,840.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	42.200	15,590,579.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	36.550	9,729,427.250	
香港・ドル	小計	11,730,769		371,623,316.860 (7,142,600,150)	
合計		172,647,251		1,336,378,100,035 (1,336,378,100,035)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月26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	DEXUS	163,989.000	1,210,238.820	
		GOODMAN GROUP	255,895.000	7,354,422.300	
		GPT GROUP	349,447.000	1,513,105.510	
		MIRVAC GROUP	700,332.000	1,554,737.040	
		SCENTRE GROUP	825,454.000	2,550,652.860	
		STOCKLAND	369,843.000	1,653,198.210	
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,091,290.000	
	オーストラリア・ドル	小計	3,210,605.000	16,927,644.740 (1,667,880,836)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,535,100.450	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	611,078.000	1,704,907.620	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	715,891.000	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		405,500.000	563,645.000		
シンガポール・ドル	小計	2,277,909.000	4,519,544.070 (505,420,613)		
投資信託受益証券 合計			5,488,514	2,173,301,449 (2,173,301,449)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,234.000	2,954,851.620	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	50,995.000	1,797,063.800	
		AMERICAN TOWER CORP	71,260.000	13,534,411.800	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,213.000	1,514,421.440	
		AVALONBAY COMMUNITIES	21,518.000	3,774,257.200	

	INC			
	BOSTON PROPERTIES INC	24,473.000	1,591,479.190	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	16,851.000	1,598,317.350	
	CROWN CASTLE INC	65,066.000	7,072,023.540	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	45,607.000	6,286,468.880	
	EQUINIX INC	14,299.000	12,615,864.710	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,290.000	1,823,517.800	
	EQUITY RESIDENTIAL	54,104.000	3,257,060.800	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,893.000	2,268,860.620	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	34,180.000	4,787,250.800	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	41,252.000	1,874,490.880	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,133.000	1,498,911.790	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,415.000	2,238,112.050	
	INVITATION HOMES INC	96,467.000	3,210,421.760	
	IRON MOUNTAIN INC	43,616.000	3,272,508.480	
	KIMCO REALTY	95,524.000	1,866,538.960	
	MID AMERICA	17,537.000	2,215,273.840	
	PROLOGIS INC	139,674.000	18,605,973.540	
	PUBLIC STORAGE	23,534.000	6,702,012.520	
	REALTY INCOME CORP	129,955.000	6,879,817.700	
	REGENCY CENTERS CORP	21,907.000	1,330,412.110	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,539.000	3,522,145.440	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	48,901.000	7,352,265.350	
	SUN COMMUNITIES INC	18,509.000	2,431,897.510	
	UDR INC	50,449.000	1,808,596.650	
	VENTAS INC	60,757.000	2,683,029.120	
	VICI PROPERTIES INC	152,711.000	4,588,965.550	
	WELLTOWER INC	77,707.000	7,258,610.870	
	WEYERHAEUSER CO	114,764.000	3,830,822.320	
	WP CAREY INC	32,996.000	1,847,116.080	
アメリカ・ドル	小計	1,923,330.000	149,893,772.070 (22,538,027,569)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	121,345.000	756,950.110	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,426,630.000	
イギリス・ポンド	小計	286,426.000	2,183,580.110 (415,753,653)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	438,106.060	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	267,565.200	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	705,671.260 (78,498,871)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	216,824.800	
	GECINA SA	8,697.000	815,343.750	
	KLEPIERRE	36,407.000	874,496.140	
	UNIBAIL-RODAMCO-	18,477.000	1,269,369.900	

		WESTFIELD		
		WAREHOUSES DE PAUW	31,043.000	790,975.640
	ユーロ	小計	99,690.000	3,967,010.230 (645,313,554)
	香港・ドル	LINK REIT	410,116.000	15,789,466.000
	香港・ドル	小計	410,116.000	15,789,466.000 (303,473,537)
投資証券	合計		2,742,708	23,981,067,184 (23,981,067,184)
合計				26,154,368,633 (26,154,368,633)

(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 588銘柄 投資証券 34銘柄	72.89 —	— —	— —	— 1.63	75.63
イギリス・ポンド	株式 81銘柄 投資証券 2銘柄	3.95 —	— —	— —	— 0.03	4.04
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	—	—	—	0.10
オーストラリア・ドル	株式 51銘柄 投資信託受益証 券 7銘柄	1.87 —	— —	— 0.12	— —	2.02
カナダ・ドル	株式 86銘柄 新株予約権証券 1銘柄 投資証券 2銘柄	3.19 — —	— 0.00 —	— — —	— — 0.01	3.25
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資信託受益証 券 4銘柄	0.29 —	— —	— 0.04	— —	0.33
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.63	—	—	—	2.67
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	0.86	—	—	—	0.87
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.99	—	—	—	1.01
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.05	—	—	—	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.17	—	—	—	0.17
ユーロ	株式 220銘柄 投資証券 5銘柄	9.14 —	— —	— —	— 0.05	9.32
香港・ドル	株式 29銘柄 投資証券 1銘柄	0.52 —	— —	— —	— 0.02	0.55

(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)

2024年2月26日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,855,888,759
国債証券	449,851,928,950
地方債証券	29,098,170,976
特殊債券	28,742,473,471
社債券	23,718,614,800
未収利息	910,476,478
前払費用	199,876,293
流動資産合計	540,377,429,727
資産合計	540,377,429,727
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,031,868,000
流動負債合計	7,031,868,000
負債合計	7,031,868,000
純資産の部	
元本等	
元本	429,366,789,140
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	103,978,772,587
元本等合計	533,345,561,727
純資産合計	533,345,561,727
負債純資産合計	540,377,429,727

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月28日
	至 2024年2月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。時価評価にあつては、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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年2月26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	424,094,237,578円
同期中追加設定元本額	580,810,508,516円
同期中一部解約元本額	575,537,956,954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	26,493,292,856円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	56,606,049円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	82,559,567円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	46,315,205円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	777,318,271円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	271,566,704円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	40,009,486円
たわらノーロード 国内債券	19,283,324,396円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,726,901,293円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,564,401,052円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,048,114,312円
たわらノーロード バランス（積極型）	418,452,135円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	190,794,345円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	2,452,127,061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）	2,752,310,360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）	835,047,462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）	37,003,829円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	20,989,719円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	190,982,785円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	6,691,617円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,254,045,205円
O n eグローバルバランス	109,311,398円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	11,158,997,183円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	16,433,739,226円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	7,579,122,762円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,661,941,245円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,760,892,923円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	520,501,398円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	74,055,112円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,816,801,094円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,416,875円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	5,297,839,731円

D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,353,396,499円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	482,650,017円
投資のソムリエ	89,627,892,685円
クルーズコントロール	1,306,022,948円
投資のソムリエ<DC年金>	8,867,738,067円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,325,921,180円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,227,286,165円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,420,751,107円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	33,877,500,830円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	514,904,079円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	264,258,876円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	91,237,587円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,029,090,803円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,587,238,485円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,558,314,912円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,180,949,155円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	679,094,815円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	280,353,329円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	172,141,111円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,285,390,263円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	42,270,786円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	163,513,136円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,175,511,500円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,179,794,365円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,143,992,121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)	710,351,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,124,592,274円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	2,999,863,396円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,992,568,129円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,046,998,554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)	2,040,423,193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)	1,306,399,065円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,164,095,023円
O n e コアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,179,872,920円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,899,325,828円
A M O n e 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)(適格機関投資家限定)	597,580,172円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	267,019,349円
O n e 収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	2,397,299,626円
O n e 収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII(適格機関投資家限定)	2,408,636,925円
O n e 収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限	2,381,224,582円

定)	
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,950,010,153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）	38,996,223円
AMOn eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	465,443,530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）	149,736,384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）	96,780,040円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	21,757,666円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	57,519,512円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	30,341,811円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	383,617円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	2,811,312円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	93,208,060円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	2,655,717,094円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,130,820,663円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,372,788,534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）	56,186,546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）	133,021,861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）	1,579,405,555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）	102,719,792円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	576,326円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	1,483,015,383円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	29,144,983円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	275,571,658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）	482,972,481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）	782,386,100円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	204,793,727円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	58,717,183円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	387,569,601円
動的パッケージファンド<DC年金>	220,521,827円
コア資産形成ファンド	111,732,658円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	17,293,563,247円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	25,906,815,969円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	18,747,608,788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]	123,906,397円
計	429,366,789,140円
2. 受益権の総数	429,366,789,140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 2023年2月28日 至 2024年2月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目

	的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年2月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月26日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
国債証券	3,126,333,950	
地方債証券	97,379,019	
特殊債券	148,976,627	
社債券	77,607,000	
合計	3,450,296,596	

(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（2024年2月15日から2024年2月26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)

	2024年2月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2422円 (12,422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

2024年2月26日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	446回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,499,685,000	
	447回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	999,670,000	
	448回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	1,999,060,000	
	449回 利付国庫債券(2年)	1,800,000,000	1,798,866,000	
	451回 利付国庫債券(2年)	12,500,000,000	12,485,750,000	
	455回 利付国庫債券(2年)	2,900,000,000	2,893,127,000	
	456回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,199,004,000	
	143回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,702,923,000	
	145回 利付国庫債券(5年)	7,300,000,000	7,300,000,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	4,700,000,000	4,696,992,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	5,750,000,000	5,733,440,000	
	148回 利付国庫債券(5年)	3,610,000,000	3,597,942,600	
	149回 利付国庫債券(5年)	1,680,000,000	1,673,565,600	
	150回 利付国庫債券(5年)	1,470,000,000	1,463,620,200	
	151回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,890,747,000	
	152回 利付国庫債券(5年)	1,890,000,000	1,886,257,800	
	153回 利付国庫債券(5年)	5,210,000,000	5,179,104,700	
	154回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,394,792,000	
	155回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,709,768,000	

1 5 6回 利付国庫債券 (5年)	4,300,000,000	4,295,098,000	
1 5 7回 利付国庫債券 (5年)	4,400,000,000	4,390,276,000	
1 5 8回 利付国庫債券 (5年)	3,600,000,000	3,577,572,000	
1 5 9回 利付国庫債券 (5年)	2,100,000,000	2,083,893,000	
1 6 0回 利付国庫債券 (5年)	900,000,000	896,931,000	
1 6 1回 利付国庫債券 (5年)	1,700,000,000	1,701,445,000	
1 6 2回 利付国庫債券 (5年)	1,600,000,000	1,599,280,000	
1 6 3回 利付国庫債券 (5年)	3,000,000,000	3,012,120,000	
1 6 4回 利付国庫債券 (5年)	1,700,000,000	1,688,729,000	
1回 利付国庫債券 (40年)	110,000,000	129,098,200	
2回 利付国庫債券 (40年)	330,000,000	373,088,100	
3回 利付国庫債券 (40年)	540,000,000	609,670,800	
4回 利付国庫債券 (40年)	720,000,000	811,533,600	
5回 利付国庫債券 (40年)	710,000,000	767,964,400	
6回 利付国庫債券 (40年)	940,000,000	994,943,000	
7回 利付国庫債券 (40年)	880,000,000	887,946,400	
8回 利付国庫債券 (40年)	990,000,000	924,927,300	
9回 利付国庫債券 (40年)	1,890,000,000	1,291,720,500	
1 0回 利付国庫債券 (40年)	1,930,000,000	1,545,968,600	
1 1回 利付国庫債券 (40年)	1,040,000,000	799,312,800	
1 2回 利付国庫債券 (40年)	1,420,000,000	968,070,800	
1 3回 利付国庫債券 (40年)	2,090,000,000	1,406,695,400	
1 4回 利付国庫債券 (40年)	2,100,000,000	1,507,716,000	
1 5回 利付国庫債券 (40年)	2,340,000,000	1,854,356,400	
1 6回 利付国庫債券 (40年)	1,800,000,000	1,563,120,000	
3 3 8回 利付国庫債券 (1	3,230,000,000	3,242,790,800	

0年)			
339回 利付国庫債券(10年)	3,980,000,000	3,997,432,400	
340回 利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,315,411,000	
341回 利付国庫債券(10年)	3,620,000,000	3,630,787,600	
342回 利付国庫債券(10年)	3,520,000,000	3,516,726,400	
343回 利付国庫債券(10年)	4,090,000,000	4,085,255,600	
344回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,564,966,300	
345回 利付国庫債券(10年)	4,890,000,000	4,881,784,800	
346回 利付国庫債券(10年)	4,540,000,000	4,531,010,800	
347回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,487,400,000	
348回 利付国庫債券(10年)	4,070,000,000	4,054,859,600	
349回 利付国庫債券(10年)	5,850,000,000	5,821,218,000	
350回 利付国庫債券(10年)	6,600,000,000	6,558,882,000	
351回 利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,381,592,000	
352回 利付国庫債券(10年)	4,950,000,000	4,903,222,500	
353回 利付国庫債券(10年)	3,690,000,000	3,648,930,300	
354回 利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,430,037,200	
355回 利付国庫債券(10年)	4,130,000,000	4,077,218,600	
356回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,663,172,000	
357回 利付国庫債券(10年)	5,800,000,000	5,715,784,000	
358回 利付国庫債券(10年)	5,150,000,000	5,069,093,500	
359回 利付国庫債券(10年)	4,050,000,000	3,981,312,000	
360回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,022,633,000	
361回 利付国庫債券(10年)	5,500,000,000	5,385,215,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,210,000,000	4,113,422,600	
363回 利付国庫債券(10年)	5,070,000,000	4,940,917,800	

3 6 4回 利付国庫債券 (10年)	5,850,000,000	5,685,673,500	
3 6 5回 利付国庫債券 (10年)	5,430,000,000	5,262,756,000	
3 6 6回 利付国庫債券 (10年)	4,880,000,000	4,755,511,200	
3 6 7回 利付国庫債券 (10年)	4,600,000,000	4,470,280,000	
3 6 8回 利付国庫債券 (10年)	4,750,000,000	4,602,750,000	
3 6 9回 利付国庫債券 (10年)	5,220,000,000	5,178,448,800	
3 7 0回 利付国庫債券 (10年)	3,700,000,000	3,663,481,000	
3 7 1回 利付国庫債券 (10年)	5,200,000,000	5,090,332,000	
3 7 2回 利付国庫債券 (10年)	5,300,000,000	5,371,550,000	
3 7 3回 利付国庫債券 (10年)	1,600,000,000	1,587,488,000	
1回 利付国庫債券 (30年)	110,000,000	124,837,900	
2回 利付国庫債券 (30年)	100,000,000	112,074,000	
4回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	233,142,000	
6回 利付国庫債券 (30年)	200,000,000	228,958,000	
1 1回 利付国庫債券 (30年)	250,000,000	274,125,000	
1 2回 利付国庫債券 (30年)	230,000,000	260,843,000	
1 3回 利付国庫債券 (30年)	150,000,000	168,753,000	
1 4回 利付国庫債券 (30年)	340,000,000	395,981,000	
1 5回 利付国庫債券 (30年)	260,000,000	305,734,000	
1 6回 利付国庫債券 (30年)	240,000,000	282,763,200	
1 7回 利付国庫債券 (30年)	270,000,000	315,813,600	
1 8回 利付国庫債券 (30年)	400,000,000	464,252,000	
1 9回 利付国庫債券 (30年)	280,000,000	325,413,200	
2 0回 利付国庫債券 (30年)	330,000,000	391,023,600	
2 1回 利付国庫債券 (30年)	310,000,000	360,762,500	
2 2回 利付国庫債券 (30年)	290,000,000	344,212,600	

年)			
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	415,744,000	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	384,836,100	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	730,794,000	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	739,449,200	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	918,579,200	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,014,972,000	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,025,015,200	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	827,978,400	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,128,080,900	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,316,785,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,372,824,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,177,024,000	
36回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,520,247,900	
37回 利付国庫債券(30年)	1,360,000,000	1,486,452,800	
38回 利付国庫債券(30年)	850,000,000	912,815,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,317,980,400	
40回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,102,573,800	
41回 利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,114,505,200	
42回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,050,260,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,410,000,000	1,479,216,900	
44回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,184,115,700	
45回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,161,971,500	
46回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	1,886,586,900	
47回 利付国庫債券(30年)	1,340,000,000	1,374,947,200	
48回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,698,895,600	

4 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,300,000,000	1,281,787,000	
5 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,150,000,000	1,002,455,000	
5 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,520,000,000	1,177,696,000	
5 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,500,000,000	1,214,385,000	
5 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,220,000,000	1,007,695,600	
5 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,790,000,000	1,543,588,600	
5 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,080,000,000	928,573,200	
5 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,040,000,000	891,529,600	
5 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,430,000,000	1,222,206,700	
5 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,660,000,000	1,414,552,400	
5 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,120,000,000	928,939,200	
6 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,330,000,000	1,153,628,700	
6 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,160,000,000	955,898,000	
6 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	720,000,000	561,268,800	
6 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,100,000,000	830,775,000	
6 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,300,000,000	977,951,000	
6 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,300,000,000	974,103,000	
6 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,090,000,000	813,543,300	
6 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,270,000,000	998,791,500	
6 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,340,000,000	1,049,153,000	
6 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,360,000,000	1,090,448,000	
7 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,400,000,000	1,118,768,000	
7 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,480,000,000	1,178,686,800	
7 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,290,000,000	1,023,873,000	
7 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,390,000,000	1,100,504,700	
7 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1,390,000,000	1,191,577,500	

年)			
75回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,219,086,000	
76回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,247,452,800	
77回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,584,368,000	
78回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,131,072,000	
79回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,432,288,000	
80回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,757,647,000	
81回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	197,016,000	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	256,002,500	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,265,500	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	92,395,800	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	411,848,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	144,365,200	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	72,484,300	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	175,727,300	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	613,659,000	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	125,304,000	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	125,058,000	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	619,264,000	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,473,000	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	494,585,700	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	116,034,600	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,223,138,800	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	390,712,600	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	709,543,400	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	588,357,000	

9 6回 利付国庫債券（20年）	120,000,000	127,579,200	
9 7回 利付国庫債券（20年）	660,000,000	706,675,200	
9 8回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	170,750,400	
9 9回 利付国庫債券（20年）	750,000,000	803,130,000	
1 0 0回 利付国庫債券（20年）	830,000,000	895,188,200	
1 0 1回 利付国庫債券（20年）	230,000,000	249,911,100	
1 0 2回 利付国庫債券（20年）	500,000,000	545,365,000	
1 0 3回 利付国庫債券（20年）	160,000,000	173,835,200	
1 0 4回 利付国庫債券（20年）	110,000,000	118,574,500	
1 0 5回 利付国庫債券（20年）	640,000,000	691,840,000	
1 0 6回 利付国庫債券（20年）	500,000,000	542,750,000	
1 0 7回 利付国庫債券（20年）	600,000,000	650,442,000	
1 0 8回 利付国庫債券（20年）	690,000,000	741,474,000	
1 0 9回 利付国庫債券（20年）	350,000,000	377,331,500	
1 1 0回 利付国庫債券（20年）	440,000,000	478,737,600	
1 1 1回 利付国庫債券（20年）	460,000,000	504,882,200	
1 1 2回 利付国庫債券（20年）	740,000,000	808,346,400	
1 1 3回 利付国庫債券（20年）	1,370,000,000	1,502,013,200	
1 1 4回 利付国庫債券（20年）	410,000,000	451,246,000	
1 1 5回 利付国庫債券（20年）	360,000,000	398,268,000	
1 1 6回 利付国庫債券（20年）	530,000,000	588,331,800	
1 1 7回 利付国庫債券（20年）	470,000,000	518,941,100	
1 1 8回 利付国庫債券（20年）	555,000,000	611,338,050	
1 1 9回 利付国庫債券（20年）	470,000,000	511,754,800	
1 2 1回 利付国庫債券（20年）	640,000,000	702,502,400	
1 2 2回 利付国庫債券（20年）	570,000,000	622,012,500	

0年)			
1 2 3回 利付国庫債券 (20年)	650,000,000	723,742,500	
1 2 5回 利付国庫債券 (20年)	600,000,000	673,662,000	
1 2 6回 利付国庫債券 (20年)	510,000,000	565,615,500	
1 2 7回 利付国庫債券 (20年)	540,000,000	595,188,000	
1 2 8回 利付国庫債券 (20年)	370,000,000	408,398,600	
1 3 0回 利付国庫債券 (20年)	910,000,000	999,107,200	
1 3 2回 利付国庫債券 (20年)	30,000,000	32,755,500	
1 3 3回 利付国庫債券 (20年)	630,000,000	692,603,100	
1 3 4回 利付国庫債券 (20年)	200,000,000	220,138,000	
1 3 5回 利付国庫債券 (20年)	130,000,000	142,027,600	
1 3 6回 利付国庫債券 (20年)	360,000,000	390,520,800	
1 3 7回 利付国庫債券 (20年)	480,000,000	524,904,000	
1 3 8回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,141,832,000	
1 3 9回 利付国庫債券 (20年)	980,000,000	1,063,878,200	
1 4 0回 利付国庫債券 (20年)	850,000,000	929,925,500	
1 4 1回 利付国庫債券 (20年)	1,060,000,000	1,160,488,000	
1 4 2回 利付国庫債券 (20年)	430,000,000	474,569,500	
1 4 3回 利付国庫債券 (20年)	1,230,000,000	1,336,813,200	
1 4 4回 利付国庫債券 (20年)	750,000,000	808,680,000	
1 4 5回 利付国庫債券 (20年)	2,250,000,000	2,467,125,000	
1 4 6回 利付国庫債券 (20年)	2,240,000,000	2,457,257,600	
1 4 7回 利付国庫債券 (20年)	1,290,000,000	1,402,371,900	
1 4 8回 利付国庫債券 (20年)	2,730,000,000	2,940,728,700	
1 4 9回 利付国庫債券 (20年)	2,290,000,000	2,466,146,800	
1 5 0回 利付国庫債券 (20年)	2,930,000,000	3,125,548,200	

1 5 1回 利付国庫債券 (20年)	3,160,000,000	3,303,843,200	
1 5 2回 利付国庫債券 (20年)	2,440,000,000	2,548,189,600	
1 5 3回 利付国庫債券 (20年)	2,740,000,000	2,888,069,600	
1 5 4回 利付国庫債券 (20年)	3,020,000,000	3,146,145,400	
1 5 5回 利付国庫債券 (20年)	2,280,000,000	2,320,424,400	
1 5 6回 利付国庫債券 (20年)	2,280,000,000	2,159,502,000	
1 5 7回 利付国庫債券 (20年)	2,580,000,000	2,374,580,400	
1 5 8回 利付国庫債券 (20年)	2,140,000,000	2,037,643,800	
1 5 9回 利付国庫債券 (20年)	1,840,000,000	1,768,460,800	
1 6 0回 利付国庫債券 (20年)	1,820,000,000	1,766,109,800	
1 6 1回 利付国庫債券 (20年)	1,760,000,000	1,680,254,400	
1 6 2回 利付国庫債券 (20年)	1,930,000,000	1,836,703,800	
1 6 3回 利付国庫債券 (20年)	2,130,000,000	2,019,240,000	
1 6 4回 利付国庫債券 (20年)	2,750,000,000	2,561,570,000	
1 6 5回 利付国庫債券 (20年)	2,250,000,000	2,086,942,500	
1 6 6回 利付国庫債券 (20年)	1,540,000,000	1,464,509,200	
1 6 7回 利付国庫債券 (20年)	2,350,000,000	2,162,141,000	
1 6 8回 利付国庫債券 (20年)	1,590,000,000	1,434,180,000	
1 6 9回 利付国庫債券 (20年)	1,720,000,000	1,519,774,800	
1 7 0回 利付国庫債券 (20年)	1,900,000,000	1,671,373,000	
1 7 1回 利付国庫債券 (20年)	1,740,000,000	1,522,778,400	
1 7 2回 利付国庫債券 (20年)	1,380,000,000	1,222,307,400	
1 7 3回 利付国庫債券 (20年)	2,360,000,000	2,079,773,600	
1 7 4回 利付国庫債券 (20年)	2,400,000,000	2,104,200,000	
1 7 5回 利付国庫債券 (20年)	2,020,000,000	1,793,335,800	
1 7 6回 利付国庫債券 (20年)	2,300,000,000	2,031,751,000	

	0年)			
	177回 利付国庫債券 (20年)	1,750,000,000	1,512,490,000	
	178回 利付国庫債券 (20年)	1,900,000,000	1,663,640,000	
	179回 利付国庫債券 (20年)	2,200,000,000	1,919,082,000	
	180回 利付国庫債券 (20年)	2,520,000,000	2,312,049,600	
	181回 利付国庫債券 (20年)	1,900,000,000	1,769,280,000	
	182回 利付国庫債券 (20年)	2,150,000,000	2,067,139,000	
	183回 利付国庫債券 (20年)	1,700,000,000	1,715,317,000	
	184回 利付国庫債券 (20年)	1,980,000,000	1,893,474,000	
	185回 利付国庫債券 (20年)	2,100,000,000	2,002,707,000	
	186回 利付国庫債券 (20年)	1,900,000,000	1,936,594,000	
	187回 利付国庫債券 (20年)	500,000,000	491,100,000	
	国債証券 合計	459,295,000,000	449,851,928,950	
地方債証券	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,428,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	109,183,800	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	195,392,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	391,768,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	292,971,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	226,168,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	109,430,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,096,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	103,043,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	210,008,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	315,705,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,750,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,854,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	207,536,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,489,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	396,956,000	

30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	395,088,000	
令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	97,202,000	
36回2号 宮城県公募公債10年	250,000,000	243,722,500	
213回 神奈川県公募公債	100,000,000	100,431,000	
237回 神奈川県公募公債	200,000,000	197,078,000	
251回 神奈川県公募公債10年	200,000,000	195,158,000	
258回 神奈川県公募公債10年	300,000,000	291,033,000	
3回 神奈川県公募公債30年	100,000,000	118,879,000	
11回 神奈川県公募公債20年	100,000,000	108,578,000	
16回 神奈川県公募公債20年	300,000,000	331,377,000	
19回 神奈川県公募公債20年	100,000,000	109,120,000	
413回 大阪府公募公債10年	100,000,000	99,315,000	
419回 大阪府公募公債10年	100,000,000	99,691,000	
464回 大阪府公募公債10年	200,000,000	193,558,000	
467回 大阪府公募公債10年	200,000,000	194,368,000	
469回 大阪府公募公債10年	200,000,000	193,506,000	
472回 大阪府公募公債10年	200,000,000	192,534,000	
474回 大阪府公募公債10年	300,000,000	288,672,000	
10回 大阪府公募公債20年	200,000,000	216,918,000	
13回 大阪府公募公債20年	100,000,000	102,694,000	
14回 大阪府公募公債20年	100,000,000	94,178,000	
190回 大阪府公募公債5年	300,000,000	297,621,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	108,566,876	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	391,476,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	195,244,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	195,288,000	
令和3年度2回 兵庫県公募	100,000,000	97,261,000	

公債			
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	114,943,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	206,656,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	311,391,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	102,879,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	101,256,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	195,500,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	97,591,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	194,356,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	103,643,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	104,006,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	204,098,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	103,066,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	325,755,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	330,924,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	110,891,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	213,712,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	150,336,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	100,420,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	196,574,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	218,004,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	99,276,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	195,364,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	83,466,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	87,127,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	196,142,000	

6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	174,522,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	222,651,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	110,162,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	107,595,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	320,796,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	102,819,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	99,895,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	197,690,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	195,520,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	97,525,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	103,667,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	147,942,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	107,613,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	110,312,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	323,424,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	201,170,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	99,659,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	192,756,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	103,523,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	102,414,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	92,870,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	194,940,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	106,787,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,452,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	602,928,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,580,000	

150回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	301,413,000	
153回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	100,416,000	
157回 共同発行市場公募 地方債	120,000,000	119,536,800	
159回 共同発行市場公募 地方債	200,000,000	199,098,000	
160回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,430,000	
166回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	498,670,000	
169回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	498,760,000	
173回 共同発行市場公募 地方債	400,000,000	398,664,000	
174回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,381,000	
178回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	99,517,000	
179回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	497,635,000	
189回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	98,891,000	
194回 共同発行市場公募 地方債	300,000,000	294,618,000	
196回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	489,435,000	
203回 共同発行市場公募 地方債	100,000,000	97,786,000	
227回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	484,940,000	
228回 共同発行市場公募 地方債	500,000,000	482,705,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	98,776,000	
令和2年度1回 福島県公募 公債	200,000,000	194,850,000	
29年度4回 大阪市公募公 債	200,000,000	198,730,000	
令和2年 2回 大阪市公募 公債	300,000,000	293,277,000	
6回 大阪市公募公債 20 年	200,000,000	216,632,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	195,224,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	106,690,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	103,044,000	
4回 京都市公募公債 20 年	100,000,000	105,665,000	

9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	221,238,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	217,034,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	297,837,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	155,248,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	390,920,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	116,687,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	107,707,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	106,743,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	110,546,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	281,064,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	197,940,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	218,010,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	110,483,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	107,468,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	330,897,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	106,642,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	113,770,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	186,990,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	86,481,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	188,106,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	298,464,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	93,843,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	297,600,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	195,976,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	194,850,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	196,920,000	
地方債証券 合計	29,139,330,000	29,098,170,976	

特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	206,338,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	205,084,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	298,893,000	
	125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	428,810,000	
	127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,649,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	78,203,000	
	156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	386,924,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,773,000	
	1回 高速道路機構債	300,000,000	371,721,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	179,490,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	235,870,000	
	36回 高速道路機構債	300,000,000	364,578,000	
	50回 高速道路機構債	300,000,000	264,954,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,508,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,995,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,049,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,876,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,525,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	92,219,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	181,310,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	92,491,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,534,000	
	116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,973,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	542,660,000	
	153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,166,000	
	188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,112,000	
	239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	309,075,000	
	241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	501,895,000	
	250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,153,000	
	254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,405,000	
	260回 政保日本高速道路保	200,000,000	194,200,000	

有・債務返済機構			
第262回 政保道路債	500,000,000	510,035,000	
268回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	94,876,000	
271回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	300,000,000	298,749,000	
286回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	184,162,000	
300回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	99,660,000	
309回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	800,000,000	797,368,000	
319回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	189,350,000	
337回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	100,000,000	93,514,000	
398回 政保道路債	300,000,000	221,457,000	
413回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	139,938,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	152,634,000	
420回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構	200,000,000	154,496,000	
28回 日本道路・機構承継 債	500,000,000	590,895,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	200,000,000	214,808,000	
1回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	327,417,000	
2回 地方公共団体金融機構 債券 20年	300,000,000	328,179,000	
13回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	110,387,000	
79回 政保地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	309,552,000	
19回 地方公共団体金融機 構債券	200,000,000	217,708,000	
23回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	107,736,000	
24回 地方公共団体金融機 構債券 20年	200,000,000	215,948,000	
F147回 地方公共団体金 融機構債券	200,000,000	205,916,000	
F174回 地方公共団体金 融機構債券	300,000,000	326,454,000	
36回 地方公共団体金融機 構債券 20年	100,000,000	106,306,000	
39回 地方公共団体金融機 構債券	500,000,000	524,135,000	
42回 地方公共団体金融機 構債券 20年	300,000,000	300,900,000	
71回 政保地方公共団体金	100,000,000	100,320,000	

融機構債券			
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	200,000,000	206,278,000	
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,207,000	
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 1 0 年	400,000,000	398,148,000	
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,585,000	
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	100,000,000	94,185,000	
9 6 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,835,000	
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,652,000	
1 0 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,454,000	
1 1 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,260,000	
7 7 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	300,000,000	253,164,000	
1 0 回 地方公共団体金融機構債券 3 0 年	300,000,000	224,001,000	
F 5 3 8 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,590,000	
1 5 回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	217,154,000	
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,580,790	
2 3 回 国際協力銀行債券	100,000,000	103,242,000	
9 3 回 都市再生債券	100,000,000	103,003,000	
1 0 9 回 都市再生機構債券	200,000,000	204,416,000	
1 6 5 回 都市再生機構債券	200,000,000	156,718,000	
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	104,615,000	
2 1 回 政保中部国際空港債券	100,000,000	100,372,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	217,624,000	
6 1 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,774,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	385,392,000	
8 0 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,247,000	
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,686,000	
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,880,000	
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	266,455,000	

1 5 9回 住宅金融支援機構 債券	100,000,000	101,268,000	
1 7 2回 住宅金融支援機構 債券	100,000,000	100,372,000	
1 8 7回 住宅金融支援機構 債券	100,000,000	99,541,000	
2 2 2回 住宅金融支援機構 債券	300,000,000	297,960,000	
2 3 0回 住宅金融支援機構 債券	300,000,000	298,122,000	
2 3 3回 住宅金融支援機構 債券	100,000,000	91,711,000	
3 2 1回 住宅金融支援機構 債券	500,000,000	496,125,000	
3 2 5回 住宅金融支援機構 債券	500,000,000	496,125,000	
4 0回貸付債権担保住宅金融 公庫債券	39,840,000	39,907,329	
2 7回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	14,543,000	15,064,221	
2 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	91,485,000	95,785,709	
3 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	137,552,000	142,884,891	
3 8回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	19,385,000	20,082,278	
4 9回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	16,717,000	17,323,827	
5 2回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	19,533,000	20,165,283	
5 3回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	20,588,000	21,254,433	
6 0回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	25,093,000	25,847,797	
6 4回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	61,990,000	63,256,455	
7 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	27,869,000	28,521,970	
8 2回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	34,215,000	34,628,317	
8 4回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	34,841,000	35,263,621	
8 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	38,462,000	38,844,696	
9 0回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	39,819,000	39,913,371	
9 3回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	45,186,000	44,456,246	
9 6回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	50,831,000	50,305,407	
9 9回貸付債権担保住宅金融	52,733,000	52,493,592	

支援機構債券			
1 1 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,941,000	191,597,462	
1 1 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,846,000	65,350,624	
1 1 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,335,000	64,949,320	
1 1 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,696,000	65,224,419	
1 2 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,506,000	202,512,764	
1 2 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,575,000	202,466,696	
1 3 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,312,000	137,950,727	
1 3 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	215,997,000	205,963,939	
1 3 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	214,077,000	204,190,924	
1 3 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	373,440,000	357,221,500	
1 3 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,406,000	71,119,486	
1 4 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,806,000	72,557,092	
1 5 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	248,163,000	232,737,187	
1 5 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	330,528,000	310,894,636	
1 6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,616,000	239,825,356	
1 6 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,364,000	245,340,997	
1 7 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	794,556,000	746,668,109	
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	409,524,000	
2 1回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,518,000	
い第8 4 3号 利付商工債	100,000,000	99,686,000	
い第8 5 1号 利付商工債	300,000,000	297,939,000	
い第8 5 4号 利付商工債	300,000,000	297,525,000	
い第8 5 5号 利付商工債	200,000,000	198,268,000	
3 6 9回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	398,684,000	
3 7 7回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	298,128,000	
1 5回 国際協力機構債	100,000,000	107,994,000	
7 2回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,302,000	
7 7回 東日本高速道路社債	300,000,000	296,343,000	
8 5回 中日本高速道路債券	300,000,000	298,818,000	

	87回 中日本高速道路債券	400,000,000	397,712,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	100,000,000	101,505,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設 整備支援機構債券	200,000,000	193,882,000	
特殊債券 合計		28,836,846,000	28,742,473,471	
社債券	25回 フランス相互信用連 合銀行（BFCM）円貨社債 （2017）	300,000,000	295,734,000	
	11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債（2 016）	100,000,000	99,105,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,052,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	85,689,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,461,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	195,822,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,969,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,646,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,586,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	496,070,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	100,462,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	299,301,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	199,876,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,505,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,065,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,434,000	
	10回 キリンホールディン グス社債	100,000,000	100,376,000	
	3回 ダイドーグループHD 社債	300,000,000	292,629,000	
	9回 野村不動産ホールディ ングス社債	100,000,000	94,173,000	
	12回 セブン&アイ・ホー ルディングス社債	100,000,000	100,613,000	
	14回 セブン&アイ・ホー ルディングス社債	200,000,000	199,262,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	298,320,000	
	42回 王子ホールディング ス社債	200,000,000	198,462,000	
	23回 三菱ケミカルホール ディングス社債	200,000,000	183,656,000	
	40回 三菱ケミカルホール ディングス社債	100,000,000	99,128,000	
	17回 ダイセル社債	300,000,000	291,372,000	
	16回 武田薬品工業社債	500,000,000	475,425,000	
	4回 ENEOSホールディ ングス社債	300,000,000	292,434,000	
	14回 プリヂストン社債	300,000,000	294,912,000	
	35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	297,447,000	
	17回 パナソニック社債	100,000,000	99,867,000	

19回	パナソニック社債	100,000,000	97,173,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	192,756,000	
58回	川崎重工業社債	300,000,000	285,297,000	
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	98,874,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	198,572,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	92,170,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	390,796,000	
12回	新生銀行社債	400,000,000	398,556,000	
88回	三菱東京UFJ銀行 社債	100,000,000	105,683,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,187,000	
20回	三井住友信託銀行社 債	300,000,000	297,294,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,612,000	
17回	NTTファイナンス 社債	300,000,000	296,943,000	
18回	NTTファイナンス 社債	400,000,000	389,724,000	
69回	ホンダファイナンス 社債	300,000,000	297,606,000	
81回	トヨタファイナンス 社債	100,000,000	99,157,000	
96回	トヨタファイナンス 社債	100,000,000	99,260,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	193,752,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	288,972,000	
23回	三井住友ファイナン ス&リース社債	100,000,000	98,117,000	
27回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	198,686,000	
29回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	199,520,000	
31回	三井住友ファイナン ス&リース社債	200,000,000	193,816,000	
56回	三菱UFJリース社 債	300,000,000	297,918,000	
3回	野村ホールディングス 社債	300,000,000	296,418,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	99,835,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	199,276,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	102,791,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	89,377,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	307,002,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	205,594,000	
65回	東日本旅客鉄道普通 社債	100,000,000	108,642,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,886,000	
73回	東日本旅客鉄道普通 社債	200,000,000	218,588,000	

1 0 7回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	93,764,000	
1 2 5回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,387,000	
1 2 7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,615,000	
1 4 7回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,677,000	
1 6 0回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,904,000	
1 6 3回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,969,000	
1 6 5回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	170,856,000	
1 7 1回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	151,326,000	
2 1回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,064,000	
6 0回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,132,000	
7 0回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,165,000	
7 1回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,315,000	
7 4回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,483,000	
7 5回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	170,356,000	
3 2回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,527,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	125,536,800	
4 7回 東京地下鉄社債	100,000,000	69,581,000	
7回 ニッコンHD社債	300,000,000	290,664,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	194,408,000	
1 2回 ソフトバンク社債	400,000,000	389,628,000	
3 0回 光通信社債	200,000,000	188,000,000	
5 2 7回 中部電力社債	100,000,000	91,992,000	
5 3 2回 中部電力社債	200,000,000	194,884,000	
4 9 7回 関西電力社債	100,000,000	100,812,000	
5 0 8回 関西電力社債	300,000,000	299,259,000	
5 3 0回 関西電力社債	400,000,000	392,436,000	
5 3 1回 関西電力社債	200,000,000	172,942,000	
5 4 1回 関西電力社債	300,000,000	287,532,000	
3 9 6回 中国電力社債	200,000,000	194,108,000	
4 2 5回 中国電力社債	100,000,000	97,410,000	
3 0 7回 北陸電力社債	100,000,000	101,369,000	
3 1 1回 北陸電力社債	100,000,000	100,988,000	
4 8 8回 東北電力社債	100,000,000	99,502,000	
5 2 1回 東北電力社債	400,000,000	391,648,000	
5 2 5回 東北電力社債	200,000,000	197,420,000	
5 3 6回 東北電力社債	300,000,000	286,116,000	
3 2 0回 四国電力社債	300,000,000	290,127,000	
4 6 3回 九州電力社債	100,000,000	90,067,000	
4 6 6回 九州電力社債	100,000,000	88,883,000	
4 9 1回 九州電力社債	300,000,000	288,645,000	
4 9 2回 九州電力社債	100,000,000	84,127,000	
4 9 3回 九州電力社債	200,000,000	198,336,000	

	5 0 7 回 九州電力社債	200,000,000	194,290,000	
	3 4 0 回 北海道電力社債	300,000,000	299,586,000	
	3 5 0 回 北海道電力社債	200,000,000	179,456,000	
	1 3 回 電源開発社債	200,000,000	204,450,000	
	5 4 回 電源開発社債	100,000,000	99,258,000	
	7 5 回 電源開発社債	200,000,000	191,400,000	
	4 1 回 東京瓦斯社債	200,000,000	184,154,000	
	5 2 回 東京瓦斯社債	100,000,000	87,000,000	
	5 5 回 東京瓦斯社債	100,000,000	83,634,000	
	5 7 回 東京瓦斯社債	300,000,000	199,329,000	
	7 回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	198,244,000	
	8 回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	184,150,000	
社債券	合計	24,520,000,000	23,718,614,800	
	合計		531,411,188,197	

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)

2024年2月26日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,417,979,053
コール・ローン	1,405,461,290
国債証券	255,953,711,162
派生商品評価勘定	1,910,781
未収入金	1,614,670,471
未収利息	1,839,219,045
前払費用	214,926,563
流動資産合計	263,447,878,365
資産合計	263,447,878,365
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	85,979
未払金	1,055,133,699
未払解約金	2,570,129,000
流動負債合計	3,625,348,678
負債合計	3,625,348,678
純資産の部	
元本等	
元本	111,583,962,350
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	148,238,567,337
元本等合計	259,822,529,687
純資産合計	259,822,529,687
負債純資産合計	263,447,878,365

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月28日
	至 2024年2月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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. 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 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	2024年2月26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	106,807,686,183円
同期中追加設定元本額	43,421,045,954円
同期中一部解約元本額	38,644,769,787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	6,944,749,459円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,145,444円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	13,074,073円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	33,055,375円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	29,463,237円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,209,559円
たわらノーロード 先進国債券	20,328,536,828円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	129,335円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,183,153,026円
たわらノーロード バランス（堅実型）	70,372,889円
たわらノーロード バランス（標準型）	393,159,511円
たわらノーロード バランス（積極型）	90,074,981円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	17,504,252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）	1,060,417,766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）	1,873,128,797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）	938,814,444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）	722,676,978円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,166,104円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	12,367,147円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	190,300,680円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	22,226,866円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	37,678,814円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,857,780,849円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	1,448,288,461円

One グローバルバランス	62,867,616円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,916,905,681円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	415,782,480円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	824,001,501円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,358,394円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	887,363,869円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,215,627円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,329,380円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	160,868,965円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	260,318,009円
クルーズコントロール	1,073,014,665円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	862,358,185円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,400,751円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	492,432,280円
One グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5,191,217円
One グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	95,063,139円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	237,386,300円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	238,317,641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)	95,585,889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)	143,381,639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)	544,565円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	621,159,184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)	543,853,224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)	211,165,647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)	866,888,247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)	634,044,700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)	4,923,663,250円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,364,728,567円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,512,131,335円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,272,436,982円
AMOne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)(適格機関投資家限定)	222,937,463円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	43,680,338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)	393,718,174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)	322,665,524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)	208,816,275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)	11,704,671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)	20,619,600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)	6,524,169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)	51,265円
D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,512,264円
D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	33,413,721円
D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,250,390,839円
D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,241,860,455円
D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,352,401,710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)	50,385,127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)	100,205,864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)	1,139,586,017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)	202,871,976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)	155,039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)	199,396,876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)	259,826,276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)	336,700,092円
D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,317,749円
動的パッケージファンド<DC年金>	50,865,289円
コア資産形成ファンド	25,616,459円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	3,547,014,331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>	12,279,286,560円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,972,362,832円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,945,252,690円
計	111,583,962,350円
2. 受益権の総数	111,583,962,350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 2023年2月28日 至 2024年2月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等

を行うことにより、適切な管理を行います。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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年2月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月26日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	194,561,597	
合計	194,561,597	

(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(2024年2月22日から2024年2月26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	2024年2月26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 売建					
	1,712,000,000	—	1,710,175,198	1,824,802	
アメリカ・ドル	870,964,000	—	870,484,570	479,430	
イギリス・ポンド	98,876,000	—	98,961,979	△85,979	
オフショア・人民元	143,657,000	—	143,289,388	367,612	
ユーロ	598,503,000	—	597,439,261	1,063,739	
合計	1,712,000,000	—	1,710,175,198	1,824,802	

(注)時価の算定方法
為替予約取引

1. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - ①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
 2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年2月26日現在
1口当たり純資産額	2,3285円
(1万口当たり純資産額)	(23,285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

2024年2月26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 0.25 05/31/25	1,690,000.000	1,594,673.430	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,292,187.500	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,561,386.710	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,352,793.550	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,463,087.500	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,711,406.240	
		US T N/B 0.375 01/31/26	5,700,000.000	5,250,791.020	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,427,900.000	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,300,191.020	
		US T N/B 0.375 09/30/27	3,810,000.000	3,308,151.550	
		US T N/B 0.375 11/30/25	5,190,000.000	4,810,582.600	
		US T N/B 0.375 12/31/25	4,000,000.000	3,697,890.640	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,170,000.000	4,761,549.760	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,725,714.070	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,097,264.850	
		US T N/B 0.5 05/31/27	2,980,000.000	2,628,569.510	
		US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,445,639.830	
		US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,676,782.790	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,182,770.330	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,200,000.000	2,852,437.500	
US T N/B 0.625 05/15/30	7,050,000.000	5,653,218.750			

US T N/B 0.625 07/31/26	5,100,000.000	4,644,984.360	
US T N/B 0.625 08/15/30	7,740,000.000	6,153,300.000	
US T N/B 0.625 11/30/27	3,900,000.000	3,399,169.910	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,020,000.000	3,493,160.130	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,814,706.240	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,720,000.000	5,283,738.270	
US T N/B 0.75 04/30/26	6,000,000.000	5,525,859.350	
US T N/B 0.75 05/31/26	5,630,000.000	5,171,132.980	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,950,000.000	4,510,880.840	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,510,000.000	4,146,381.250	
US T N/B 0.875 09/30/26	5,510,000.000	5,026,798.830	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,680,000.000	6,979,601.520	
US T N/B 1.0 07/31/28	9,270,000.000	8,039,371.240	
US T N/B 1.125 02/15/31	9,690,000.000	7,896,025.170	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,866,760.860	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	998,271.480	
US T N/B 1.125 02/29/28	4,690,000.000	4,138,466.960	
US T N/B 1.125 05/15/40	3,300,000.000	2,032,851.540	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,060,000.000	2,475,569.110	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,245,682.800	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,490,000.000	4,111,068.550	
US T N/B 1.25 03/31/28	4,610,000.000	4,079,309.740	
US T N/B 1.25 04/30/28	5,100,000.000	4,501,746.080	
US T N/B 1.25 05/15/50	8,380,000.000	4,246,630.430	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,140,000.000	3,647,404.660	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,261,249.410	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,960,000.000	7,247,275.030	
US T N/B 1.25 09/30/28	4,980,000.000	4,348,162.500	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,700,000.000	4,309,863.290	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,560,641.580	
US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	725,101.100	
US T N/B 1.375 08/15/50	6,870,000.000	3,597,089.040	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,800,000.000	2,592,406.250	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,710,000.000	4,128,793.340	
US T N/B 1.375 11/15/31	8,590,000.000	6,966,288.630	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,320,000.000	2,739,656.240	
US T N/B 1.375 12/31/28	4,600,000.000	4,016,105.470	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,740,000.000	5,279,006.240	
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,397,000.150	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,830,000.000	4,127,574.580	
US T N/B 1.5 08/15/26	6,030,000.000	5,605,073.430	
US T N/B 1.5 11/30/28	5,000,000.000	4,400,292.950	
US T N/B 1.625 02/15/26	6,090,000.000	5,744,106.990	
US T N/B 1.625 05/15/26	5,170,000.000	4,849,298.420	
US T N/B 1.625 05/15/31	8,740,000.000	7,319,067.210	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,360,000.000	2,937,243.750	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,442,529.280	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,410,000.000	2,236,969.510	
US T N/B 1.625 11/15/50	5,280,000.000	2,957,934.340	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,677,431.630	

US T N/B 1.75 01/31/29	4,500,000.000	3,994,277.350	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,866,562.480	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,310,000.000	3,527,831.250	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,850,000.000	2,496,978.500	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,958,838.290	
US T N/B 1.875 02/15/32	8,280,000.000	6,945,658.610	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,100,000.000	3,508,441.390	
US T N/B 1.875 02/15/51	5,780,000.000	3,450,727.730	
US T N/B 1.875 02/28/27	5,210,000.000	4,835,632.980	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,700,000.000	4,192,179.660	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,880,000.000	2,711,362.480	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,500,000.000	2,348,339.850	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,370,000.000	3,188,856.980	
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,980,965.110	
US T N/B 2.0 02/15/50	4,420,000.000	2,746,356.620	
US T N/B 2.0 08/15/25	3,550,000.000	3,408,762.680	
US T N/B 2.0 08/15/51	5,810,000.000	3,568,156.970	
US T N/B 2.0 11/15/26	7,030,000.000	6,585,407.390	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	2,938,725.560	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,820,853.520	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,250,000.000	2,132,226.550	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,780,000.000	3,550,246.870	
US T N/B 2.25 02/15/52	5,000,000.000	3,261,230.440	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,300,000.000	3,145,054.690	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,420,000.000	3,219,434.770	
US T N/B 2.25 08/15/27	4,240,000.000	3,948,665.600	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,270,000.000	1,537,969.310	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,140,000.000	2,737,494.120	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,120,000.000	4,910,400.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,033,627.520	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,649,613.070	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,650,624.990	
US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	1,965,288.280	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,159,268.160	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,770,000.000	3,435,412.500	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	3,742,683.570	
US T N/B 2.375 11/15/49	3,690,000.000	2,506,893.750	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,810,000.000	2,031,981.250	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,370,000.000	980,647.060	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,280,000.000	2,186,573.430	
US T N/B 2.5 03/31/27	4,000,000.000	3,779,296.870	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,730,000.000	1,235,294.330	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,367,653.900	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,471,712.080	
US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,745,879.280	
US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,923,828.140	
US T N/B 2.625 05/31/27	4,910,000.000	4,644,265.430	
US T N/B 2.625 07/31/29	3,070,000.000	2,824,879.680	
US T N/B 2.625 12/31/25	3,000,000.000	2,890,898.430	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,540,000.000	4,276,289.830	

US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,916,452.940	
US T N/B 2.75 04/30/27	6,000,000.000	5,703,984.360	
US T N/B 2.75 05/15/25	2,200,000.000	2,143,968.750	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,300,000.000	3,061,974.590	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,011,785.930	
US T N/B 2.75 07/31/27	3,820,000.000	3,620,419.930	
US T N/B 2.75 08/15/32	7,840,000.000	6,992,606.220	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,240,000.000	962,332.020	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,230,000.000	1,654,337.680	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,775,064.250	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,056,000.000	816,543.750	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,250,000.000	1,666,845.680	
US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,953,281.240	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,800,000.000	3,551,367.160	
US T N/B 2.875 05/15/28	3,560,000.000	3,360,167.190	
US T N/B 2.875 05/15/32	8,050,000.000	7,270,156.250	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,797,605.260	
US T N/B 2.875 05/15/49	4,600,000.000	3,473,988.260	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,387,080.440	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,531,363.260	
US T N/B 2.875 06/15/25	2,420,000.000	2,359,074.610	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,141,003.890	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,030,000.000	4,735,469.890	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,363,798.820	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	824,807.800	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,360,000.000	3,254,409.370	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,160,000.000	1,684,335.940	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,056,389.620	
US T N/B 3.0 02/15/49	4,610,000.000	3,567,977.890	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	873,724.220	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,017,537.880	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,261,480.070	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,121,499.990	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,810,000.000	2,951,708.190	
US T N/B 3.0 08/15/52	5,540,000.000	4,271,318.310	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,701,669.910	
US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,205,535.530	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,960,000.000	1,551,462.490	
US T N/B 3.0 11/15/45	460,000.000	361,477.330	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,360,000.000	1,125,745.310	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,540,000.000	1,260,724.590	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,245,593.920	
US T N/B 3.125 08/15/25	3,030,000.000	2,957,623.230	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,692,655.060	
US T N/B 3.125 08/31/27	3,940,000.000	3,777,936.710	
US T N/B 3.125 08/31/29	3,110,000.000	2,933,726.160	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,480,000.000	5,204,929.690	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	847,496.480	
US T N/B 3.25 05/15/42	3,760,000.000	3,157,959.350	
US T N/B 3.25 06/30/27	4,200,000.000	4,050,621.070	

US T N/B 3. 25 06/30/29	3,500,000.000	3,326,230.450	
US T N/B 3. 375 05/15/33	7,500,000.000	6,990,820.340	
US T N/B 3. 375 05/15/44	1,430,000.000	1,206,813.860	
US T N/B 3. 375 08/15/42	2,920,000.000	2,492,835.940	
US T N/B 3. 375 11/15/48	3,450,000.000	2,862,219.710	
US T N/B 3. 5 01/31/28	2,380,000.000	2,306,182.820	
US T N/B 3. 5 01/31/30	3,400,000.000	3,259,882.800	
US T N/B 3. 5 02/15/33	6,900,000.000	6,503,250.000	
US T N/B 3. 5 02/15/39	1,000,000.000	908,613.270	
US T N/B 3. 5 04/30/28	3,100,000.000	3,000,400.370	
US T N/B 3. 5 04/30/30	3,000,000.000	2,871,386.730	
US T N/B 3. 5 09/15/25	3,000,000.000	2,941,464.840	
US T N/B 3. 625 02/15/44	1,630,000.000	1,430,356.820	
US T N/B 3. 625 02/15/53	3,800,000.000	3,313,941.380	
US T N/B 3. 625 03/31/28	3,800,000.000	3,697,132.810	
US T N/B 3. 625 03/31/30	3,300,000.000	3,182,437.500	
US T N/B 3. 625 05/15/26	3,500,000.000	3,429,042.960	
US T N/B 3. 625 05/15/53	3,510,000.000	3,064,188.860	
US T N/B 3. 625 05/31/28	2,500,000.000	2,431,298.820	
US T N/B 3. 625 08/15/43	1,470,000.000	1,292,480.260	
US T N/B 3. 75 04/15/26	6,000,000.000	5,894,179.680	
US T N/B 3. 75 05/31/30	3,500,000.000	3,395,546.870	
US T N/B 3. 75 06/30/30	5,700,000.000	5,527,886.730	
US T N/B 3. 75 08/15/41	1,220,000.000	1,110,700.380	
US T N/B 3. 75 11/15/43	1,460,000.000	1,305,217.180	
US T N/B 3. 875 01/15/26	4,300,000.000	4,236,339.830	
US T N/B 3. 875 02/15/43	3,500,000.000	3,199,423.810	
US T N/B 3. 875 03/31/25	1,050,000.000	1,037,961.910	
US T N/B 3. 875 05/15/43	800,000.000	730,453.120	
US T N/B 3. 875 08/15/33	8,000,000.000	7,755,000.000	
US T N/B 3. 875 08/15/40	1,290,000.000	1,204,865.020	
US T N/B 3. 875 09/30/29	4,550,000.000	4,455,889.650	
US T N/B 3. 875 11/30/27	3,300,000.000	3,242,314.440	
US T N/B 3. 875 11/30/29	2,800,000.000	2,740,664.040	
US T N/B 3. 875 12/31/27	4,600,000.000	4,519,500.000	
US T N/B 3. 875 12/31/29	2,800,000.000	2,739,570.310	
US T N/B 4. 0 01/15/27	3,000,000.000	2,962,265.640	
US T N/B 4. 0 02/15/26	4,000,000.000	3,949,609.360	
US T N/B 4. 0 02/28/30	3,000,000.000	2,952,890.640	
US T N/B 4. 0 02/29/28	3,200,000.000	3,157,750.010	
US T N/B 4. 0 06/30/28	2,000,000.000	1,973,867.180	
US T N/B 4. 0 07/31/30	2,500,000.000	2,458,886.720	
US T N/B 4. 0 10/31/29	2,700,000.000	2,659,869.140	
US T N/B 4. 0 11/15/42	3,120,000.000	2,908,059.350	
US T N/B 4. 0 11/15/52	4,760,000.000	4,447,717.950	
US T N/B 4. 0 12/15/25	4,140,000.000	4,087,603.120	
US T N/B 4. 125 01/31/25	1,800,000.000	1,784,752.030	
US T N/B 4. 125 06/15/26	4,700,000.000	4,653,459.000	
US T N/B 4. 125 07/31/28	2,500,000.000	2,479,980.470	
US T N/B 4. 125 08/15/53	1,600,000.000	1,529,375.000	

US T N/B 4.125 09/30/27	3,220,000.000	3,191,699.220		
US T N/B 4.125 10/31/27	3,340,000.000	3,310,122.650		
US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,514,796.840		
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	938,607.410		
US T N/B 4.25 10/15/25	4,000,000.000	3,966,328.110		
US T N/B 4.25 11/15/40	1,300,000.000	1,268,820.290		
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	606,351.540		
US T N/B 4.375 05/15/40	1,210,000.000	1,204,091.790		
US T N/B 4.375 05/15/41	1,630,000.000	1,609,497.650		
US T N/B 4.375 08/15/26	4,000,000.000	3,984,296.880		
US T N/B 4.375 08/15/43	2,000,000.000	1,955,468.760		
US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	998,652.340		
US T N/B 4.375 12/15/26	4,800,000.000	4,786,874.970		
US T N/B 4.5 02/15/36	500,000.000	517,031.250		
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	612,761.710		
US T N/B 4.5 07/15/26	4,100,000.000	4,094,314.440		
US T N/B 4.5 08/15/39	1,480,000.000	1,501,448.420		
US T N/B 4.5 11/15/25	3,570,000.000	3,554,660.130		
US T N/B 4.5 11/15/33	2,000,000.000	2,036,250.000		
US T N/B 4.625 02/15/40	1,690,000.000	1,733,801.360		
US T N/B 4.625 03/15/26	3,630,000.000	3,628,156.640		
US T N/B 4.625 09/15/26	3,500,000.000	3,507,724.600		
US T N/B 4.625 09/30/30	3,000,000.000	3,055,605.480		
US T N/B 4.625 10/15/26	3,400,000.000	3,409,031.250		
US T N/B 4.625 11/15/26	3,900,000.000	3,912,111.330		
US T N/B 4.75 02/15/41	1,230,000.000	1,274,419.330		
US T N/B 4.75 11/15/43	500,000.000	513,789.060		
US T N/B 5.0 05/15/37	355,000.000	382,775.970		
US T N/B 5.25 11/15/28	1,350,000.000	1,404,949.210		
US T N/B 5.375 02/15/31	1,860,000.000	1,991,580.470		
US T N/B 6.0 02/15/26	2,400,000.000	2,459,812.500		
US T N/B 6.125 11/15/27	2,200,000.000	2,329,765.630		
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	839,169.370		
アメリカ・ドル 小計	910,350,000.000 (136,880,226,000)	805,628,635.310 (121,134,321,607)		
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,750,000.000	1,618,137.500	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,340,000.000	1,151,578.580	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	1,700,000.000	1,632,236.640	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,240,000.000	1,709,355.200	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	2,430,000.000	2,201,507.100	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,390,000.000	1,103,687.800	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,880,000.000	1,588,569.920	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,880,000.000	554,750.400	
	UK TREASURY 0.625	1,060,000.000	1,009,003.400	

06/07/25			
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,650,000.000	1,121,175.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,640,000.000	654,876.270	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,350,000.000	664,605.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,100,000.000	1,578,633.000	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,330,000.000	1,125,242.230	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	2,470,000.000	1,970,566.000	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	2,110,000.000	1,355,960.840	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	740,000.000	267,806.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,100,000.000	1,002,342.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,730,000.000	839,742.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,750,000.000	1,064,350.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,900,000.000	1,785,806.200	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,200,000.000	672,600.000	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,210,000.000	613,591.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,030,000.000	929,688.300	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,270,000.000	660,019.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	380,721.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	1,130,000.000	659,004.700	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,260,000.000	665,028.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,890,000.000	1,396,521.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,069,906.800	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,250,000.000	791,000.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,640,000.000	1,357,346.000	
UK TREASURY 3.25 01/31/33	2,500,000.000	2,351,500.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,550,000.000	1,324,940.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,480,000.000	1,209,456.000	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	1,500,000.000	1,475,342.100	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	1,650,000.000	1,544,812.500	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	970,000.000	842,251.000	
UK TREASURY 3.75	1,800,000.000	1,555,130.310	

	10/22/53			
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	816,930.000	
	UK TREASURY 4.0 10/22/63	820,000.000	741,526.000	
	UK TREASURY 4.125 01/29/27	2,340,000.000	2,333,565.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,300,000.000	1,303,770.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,570,000.000	1,599,908.500	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,060,000.000	1,038,614.500	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,310,000.000	1,318,060.940	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,520,000.000	1,479,568.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,280,000.000	1,217,792.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,317,000.000	1,247,857.500	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,112,000.000	1,051,952.000	
	UK TREASURY 4.5 06/07/28	1,750,000.000	1,777,545.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,200,000.000	1,236,252.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,745,000.000	1,738,903.310	
	UK TREASURY 4.625 01/31/34	400,000.000	416,358.960	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,495,000.000	1,566,774.950	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,380,000.000	1,435,146.450	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,485,000.000	1,489,524.490	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	980,000.000	1,065,554.000	
	イギリス・ポンド 小計	85,774,000.000 (16,331,369,600)	70,374,392.390 (13,399,284,311)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,430,000.000	1,340,502.020	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,819,438.740	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,398,879.340	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	2,300,000.000	1,840,834.900	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,420,000.000	1,693,929.820	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,000,000.000	1,941,224.000	
	ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	960,000.000	659,352.960	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	1,660,000.000	1,572,981.140	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25	2,360,000.000	2,198,009.600	

	09/28/28			
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,810,000.000	1,550,654.150	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,410,000.000	1,554,131.610	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	1,220,000.000	1,294,398.040	
イスラエル・シケル 小計		22,320,000.000 (924,007,824)	19,864,336.320 (822,347,768)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,460,000.000	1,372,295.130	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,615,000.000	2,407,122.560	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,470,000.000	1,967,243.460	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,372,915.130	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,130,000.000	1,704,914.240	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,010,000.000	1,687,569.980	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,520,000.000	1,419,299.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,850,000.000	1,525,395.420	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,780,000.000	1,672,599.990	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,660,000.000	1,527,776.530	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	960,000.000	762,137.410	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	563,080.400	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,430,000.000	1,378,554.140	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	450,000.000	429,173.670	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,400,000.000	1,317,418.340	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,090,000.000	848,640.450	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,670,000.000	1,511,869.330	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,100,000.000	1,090,471.070	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,400,000.000	1,360,168.950	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	820,000.000	715,657.000	
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	1,500,000.000	1,405,727.460		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	830,000.000	782,846.520		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	1,800,000.000	1,732,339.880		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,600,000.000	1,614,128.000		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,660,000.000	1,700,630.640		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,540,000.000	1,583,609.410		
オーストラリア・ドル 小計		40,065,000.000 (3,947,604,450)	35,453,584.110 (3,493,241,642)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	42,000,000.000	42,016,203.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	20,000,000.000	20,032,948.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,508,966.660	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	40,500,000.000	40,660,477.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	31,800,000.000	31,919,157.780	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	39,500,000.000	39,653,208.650	

CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26	22,000,000.000	22,158,591.400	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	25,000,000.000	25,134,977.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	21,000,000.000	21,162,691.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	25,100,000.000	25,322,935.690	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	20,410,000.000	20,603,786.820	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30	3,000,000.000	3,032,144.100	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	18,300,000.000	18,515,288.520	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30	3,000,000.000	3,038,403.900	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	10,000,000.000	10,135,443.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	18,000,000.000	18,261,372.600	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	14,500,000.000	14,768,814.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	64,600,000.000	65,704,362.840	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	60,600,000.000	61,452,593.520	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	20,000,000.000	20,415,770.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,500,000.000	15,835,923.750	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	22,000,000.000	22,482,198.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	9,000,000.000	9,213,364.800	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	22,000,000.000	22,550,583.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,259,580.200	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	10,000,000.000	10,241,329.000	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	31,300,000.000	32,179,082.410	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	23,500,000.000	24,007,184.050	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	11,200,000.000	11,597,173.280	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	15,100,000.000	15,594,686.570	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	29,100,000.000	29,972,615.880	
CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000.000	51,561,825.000	

	3. 01 05/13/28			
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,500,000.000	19,314,338.550	
	3. 02 05/27/31			
	CHINA GOVERNMENT BOND	54,000,000.000	55,121,563.800	
	3. 03 03/11/26			
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,500,000.000	10,403,317.950	
	3. 12 10/25/52			
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.000	8,327,834.400	
	3. 13 11/21/29			
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,500,000.000	9,555,376.150	
	3. 19 04/15/53			
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,450,000.000	18,966,136.900	
	3. 25 06/06/26			
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.000	3,175,899.000	
	3. 27 11/19/30			
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,500,000.000	19,310,547.900	
	3. 28 12/03/27			
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.000	4,201,476.400	
	3. 29 05/23/29			
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,820,000.000	17,907,044.000	
	3. 32 04/15/52			
	CHINA GOVERNMENT BOND	19,100,000.000	21,695,976.500	
	3. 39 03/16/50			
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,450,000.000	14,560,253.830	
	3. 53 10/18/51			
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.000	5,268,585.000	
	3. 59 08/03/27			
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.000	9,149,241.760	
	3. 72 04/12/51			
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,500,000.000	21,305,907.000	
	3. 81 09/14/50			
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.000	7,065,851.160	
	3. 86 07/22/49			
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.000	12,841,141.840	
	4. 08 10/22/48			
	オフショア・人民元 小計	993,520,000.000 (20,720,356,360)	1,027,164,175.310 (21,422,022,458)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,410,000.000	1,307,059.480	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,310,000.000	2,181,445.990	
	CANADA 0.5 12/01/30	2,600,000.000	2,139,089.700	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	505,292.810	
	CANADA 1.0 09/01/26	2,670,000.000	2,485,077.210	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	677,190.100	
	CANADA 1.25 03/01/27	910,000.000	844,726.670	
	CANADA 1.25 06/01/30	2,350,000.000	2,057,076.590	
	CANADA 1.5 04/01/25	1,100,000.000	1,063,889.830	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,608,827.130	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,470,000.000	2,156,530.420	
	CANADA 1.5 12/01/31	2,420,000.000	2,094,951.680	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,180,000.000	1,535,573.220	
	CANADA 2.0 06/01/28	930,000.000	873,055.060	

	CANADA 2.0 06/01/32	1,590,000.000	1,421,620.490	
	CANADA 2.0 12/01/51	3,460,000.000	2,620,667.680	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,320,000.000	1,284,414.980	
	CANADA 2.25 06/01/29	530,000.000	499,172.610	
	CANADA 2.25 12/01/29	700,000.000	656,553.110	
	CANADA 2.5 12/01/32	1,520,000.000	1,407,841.890	
	CANADA 2.75 06/01/33	1,180,000.000	1,113,130.640	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,050,000.000	1,017,428.340	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	763,662.290	
	CANADA 2.75 12/01/55	300,000.000	266,924.310	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	344,554.860	
	CANADA 3.0 04/01/26	1,400,000.000	1,370,069.840	
	CANADA 3.0 10/01/25	1,660,000.000	1,625,363.930	
	CANADA 3.25 09/01/28	1,200,000.000	1,182,928.200	
	CANADA 3.25 12/01/33	2,100,000.000	2,063,222.230	
	CANADA 3.5 03/01/28	1,630,000.000	1,621,583.360	
	CANADA 3.5 08/01/25	400,000.000	394,803.110	
	CANADA 3.5 12/01/45	800,000.000	813,007.150	
	CANADA 3.75 02/01/25	1,160,000.000	1,149,994.390	
	CANADA 4.0 06/01/41	740,000.000	794,884.610	
	CANADA 5.0 06/01/37	630,000.000	731,905.100	
	CANADA 5.75 06/01/29	740,000.000	819,563.690	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	718,644.400	
	カナダ・ドル 小計	50,260,000.000 (5,590,922,400)	46,211,727.100 (5,140,592,523)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	280,000.000	267,012.200	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	510,000.000	485,431.040	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	840,000.000	756,569.950	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	840,000.000	660,499.700	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	510,000.000	404,700.300	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	590,000.000	575,694.620	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	890,000.000	808,757.620	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	780,000.000	769,622.120	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	190,000.000	172,895.250	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	340,000.000	334,068.990	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	460,000.000	435,456.940	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	660,000.000	630,841.200	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	640,000.000	633,010.840	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	200,000.000	198,559.570	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	610,559.130	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	125,000.000	124,808.930	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	580,000.000	591,252.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	808,845.990	
	シンガポール・ドル 小計	9,855,000.000 (1,102,084,650)	9,268,586.390 (1,036,506,016)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	4,920,000.000	4,183,748.340	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,390,000.000	3,154,480.310	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,960,000.000	3,614,800.160	

	SWEDEN 1.0 11/12/26	8,210,000.000	7,843,993.660	
	SWEDEN 1.75 11/11/33	2,700,000.000	2,544,113.380	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	4,050,000.000	3,997,300.900	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	5,920,000.000	5,868,222.830	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,990,000.000	4,433,209.200	
スウェーデン・クローナ 小計		37,140,000.000 (540,758,400)	35,639,868.780 (518,916,489)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	5,080,000.000	4,243,859.030	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,560,000.000	2,478,813.700	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,850,000.000	4,512,535.050	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,140,000.000	4,626,463.620	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,740,000.000	3,672,158.640	
	DENMARK 2.25 11/15/33	1,700,000.000	1,669,182.400	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,650,000.000	9,567,489.310	
デンマーク・クローネ 小計		32,720,000.000 (713,950,400)	30,770,501.750 (671,412,348)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	650,000.000	540,130.650	
	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	580,000.000	526,300.780	
	NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	880,000.000	705,760.000	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	400,000.000	248,181.960	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	910,000.000	739,609.500	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	670,000.000	650,466.840	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	810,000.000	636,600.600	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	540,000.000	356,625.580	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	750,000.000	692,176.300	
	NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	450,000.000	406,597.100	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	130,000.000	123,678.620	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	800,000.000	792,972.840	
	ニュージーランド・ドル 小計		7,570,000.000 (701,587,600)	6,419,100.770 (594,922,259)
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,950,000.000	2,461,804.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,610,000.000	3,981,496.560	
	NORWAY 1.5 02/19/26	6,710,000.000	6,389,718.280	
	NORWAY 1.75 02/17/27	5,100,000.000	4,793,337.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	1,130,000.000	1,100,280.660	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,920,000.000	2,629,220.560	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,924,375.500	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,030,000.000	1,789,648.000	
	NORWAY 3.0 08/15/33	2,900,000.000	2,714,285.160	
NORWAY 3.5 10/06/42	2,200,000.000	2,176,380.800		
ノルウェー・クローネ 小計		32,620,000.000 (464,835,000)	29,960,547.020 (426,937,795)	

ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,663,922.200	
	POLAND 0.75 04/25/25	4,170,000.000	3,976,128.360	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,720,000.000	3,706,403.600	
	POLAND 1.75 04/25/32	5,440,000.000	4,209,123.840	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,290,000.000	3,109,155.280	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	2,179,582.720	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,460,000.000	3,171,782.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	2,000,000.000	1,776,220.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	1,590,000.000	1,552,038.750	
	POLAND 3.75 05/25/27	3,650,000.000	3,518,928.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	3,190,000.000	3,277,492.130	
	POLAND 7.5 07/25/28	3,400,000.000	3,722,153.400	
ポーランド・ズロチ 小計		39,150,000.000 (1,478,625,030)	35,862,930.780 (1,354,478,342)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,100,000.000	1,019,539.870	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	650,000.000	649,171.000	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,372,262.660	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,009,395.600	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,500,000.000	1,449,184.220	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,808,224.680	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,650,853.200	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	700,000.000	706,889.470	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,000,000.000	1,010,502.400	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,730,000.000	1,751,167.060	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,677,606.120	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,920,000.000	1,939,388.540	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,950,000.000	1,965,036.450	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	1,700,000.000	1,661,197.530	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	670,000.000	686,756.220	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	1,400,000.000	1,437,938.040	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,069,142.970	
	MALAYSIA 4.457 03/31/53	2,000,000.000	2,072,085.400	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,249,399.440	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	2,950,000.000	3,065,716.110	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,450,000.000	1,537,288.690	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	960,000.000	1,035,301.130	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	324,451.260	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,829,858.410		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	2,202,251.800		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,767,736.800		
マレーシア・リンギット 小計		38,060,000.000 (1,198,307,682)	38,948,345.070 (1,226,276,960)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/01/29	9,500,000.000	9,209,490.000	
	MEXICAN BONDS 03/04/27	25,080,000.000	22,540,399.200	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	3,680,000.000	3,501,593.600	
	MEXICAN BONDS 05/26/33	19,290,000.000	17,304,866.100	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	13,290,000.000	11,421,824.700	
	MEXICAN BONDS 09/03/26	8,000,000.000	7,520,400.000	

	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,485,000.000	5,829,622.550	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	36,282,000.000	33,523,130.490	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	28,146,000.000	26,723,219.700	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,148,000.000	27,920,062.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	24,707,000.000	21,194,652.880	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	10,035,000.000	9,071,740.350	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,561,000.000	17,031,175.870	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	24,159,000.000	23,520,719.220	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,661,403.020	
	メキシコ・ペソ 小計	273,005,000.000 (2,398,267,024)	250,974,300.480 (2,204,733,937)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,180,000.000	1,004,833.720	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,410,000.000	1,165,453.830	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	620,000.000	547,237.420	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	450,000.000	272,610.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	840,000.000	599,844.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	1,520,000.000	1,364,869.550	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,190,000.000	1,109,657.150	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	360,000.000	164,142.360	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	935,000.000	866,383.150	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	590,000.000	346,651.550	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,261,394.610	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	310,000.000	143,235.500	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	600,000.000	519,694.800	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	890,000.000	863,985.300	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	740,000.000	551,917.160	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	190,000.000	115,292.000	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	590,000.000	466,127.140	
	AUSTRIA 2.0 07/15/26	460,000.000	450,917.760	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	298,002.900	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	870,000.000	833,260.770	
	AUSTRIA 2.9 02/20/33	1,300,000.000	1,306,472.700	
	AUSTRIA 2.9 02/20/34	150,000.000	150,480.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	550,000.000	555,145.250	
	AUSTRIA 3.15 10/20/53	420,000.000	425,789.280	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	310,000.000	359,651.460	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,133,545.220	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,210,000.000	1,254,642.950	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	615,000.000	682,526.380	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,080,000.000	979,380.440	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	1,040,000.000	845,908.960	

BELGIUM 0.1 06/22/30	1,200,000.000	1,021,800.000	
BELGIUM 0.35 06/22/32	1,050,000.000	862,260.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	930,000.000	604,216.350	
BELGIUM 0.65 06/22/71	870,000.000	373,021.200	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,380,000.000	1,336,730.100	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,210,000.000	1,136,490.080	
BELGIUM 0.8 06/22/28	940,000.000	863,954.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,350,000.000	1,234,298.250	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,460,000.000	1,399,134.060	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,570,000.000	1,392,652.800	
BELGIUM 1.25 04/22/33	860,000.000	755,318.220	
BELGIUM 1.4 06/22/53	1,390,000.000	896,312.200	
BELGIUM 1.45 06/22/37	780,000.000	643,794.840	
BELGIUM 1.6 06/22/47	920,000.000	668,932.920	
BELGIUM 1.7 06/22/50	960,000.000	691,190.400	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	525,373.480	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	337,860.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	306,290.790	
BELGIUM 2.75 04/22/39	320,000.000	305,630.400	
BELGIUM 3.0 06/22/33	1,200,000.000	1,215,807.600	
BELGIUM 3.0 06/22/34	580,000.000	585,521.020	
BELGIUM 3.3 06/22/54	270,000.000	266,787.540	
BELGIUM 3.45 06/22/43	240,000.000	246,427.680	
BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	686,920.960	
BELGIUM 4.0 03/28/32	930,000.000	1,013,177.340	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,280,000.000	1,457,167.360	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,070,000.000	1,103,374.370	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,570,000.000	1,872,002.510	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,600,000.000	1,772,720.000	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,510,000.000	3,311,018.100	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,533,930.240	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,060,000.000	1,902,935.490	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	2,760,000.000	2,576,460.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,650,000.000	2,526,430.500	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,350,000.000	1,289,020.500	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,280,000.000	2,186,702.400	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	1,050,000.000	1,007,590.500	
BUNDESOBL 2.2 04/13/28	2,100,000.000	2,078,811.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,720,000.000	1,499,478.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,340,000.000	1,996,605.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,500,000.000	2,084,790.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,760,000.000	1,345,449.600	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,880,000.000	1,396,877.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	3,030,000.000	2,613,526.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	890,000.000	767,358.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,890,000.000	2,439,622.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,100,000.000	929,161.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,140,000.000	1,642,954.760	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,010,000.000	529,633.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,540,000.000	1,265,580.400	

DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,478,817.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,560,000.000	2,291,982.330	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,420,000.000	2,260,304.200	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,430,000.000	1,290,760.900	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,570,000.000	2,339,188.300	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,650,000.000	1,605,268.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,860,000.000	3,687,882.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,120,000.000	1,966,300.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,610,000.000	2,439,629.640	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,590,000.000	3,362,465.800	
DEUTSCHLAND 08/15/29	2,290,000.000	2,019,431.920	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,660,000.000	1,360,834.800	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,420,000.000	2,347,279.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,820,000.000	2,174,482.260	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	2,330,000.000	2,220,187.100	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	1,850,000.000	1,577,754.000	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	2,000,000.000	1,971,860.000	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	3,050,000.000	3,041,002.500	
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	700,000.000	697,788.000	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	300,000.000	300,912.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,320,000.000	2,295,129.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,224,351.360	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,460,898.600	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,030,000.000	2,368,742.040	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,730,000.000	2,102,780.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,180,000.000	1,289,692.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,020,000.000	2,447,977.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,610,000.000	2,080,087.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,620,000.000	3,132,419.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,456,340.100	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	840,000.000	1,014,274.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	650,000.000	730,034.500	
FINLAND 0.0 09/15/26	100,000.000	93,055.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	510,000.000	428,301.060	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	199,868.690	
FINLAND 0.125 04/15/52	640,000.000	301,055.460	
FINLAND 0.125 09/15/31	700,000.000	576,452.100	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	185,756.890	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	437,534.640	

FINLAND 0.5 04/15/43	380,000.000	241,004.070	
FINLAND 0.5 09/15/27	400,000.000	370,055.790	
FINLAND 0.5 09/15/28	650,000.000	589,777.500	
FINLAND 0.5 09/15/29	800,000.000	710,436.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	600,000.000	524,196.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	810,000.000	783,478.170	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	407,984.640	
FINLAND 1.375 04/15/27	210,000.000	201,290.040	
FINLAND 1.375 04/15/47	380,000.000	278,190.150	
FINLAND 1.5 09/15/32	700,000.000	632,555.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	330,000.000	310,777.830	
FINLAND 2.75 04/15/38	370,000.000	358,016.440	
FINLAND 2.75 07/04/28	320,000.000	320,860.160	
FINLAND 4.0 07/04/25	220,000.000	222,274.360	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	3,530,000.000	3,331,938.760	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	3,700,000.000	3,408,014.500	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,790,000.000	2,232,837.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	3,590,000.000	3,087,378.460	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,280,000.000	3,578,674.920	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,670,000.000	2,981,930.050	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,020,000.000	3,751,673.040	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,430,000.000	3,316,202.890	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	4,960,000.000	4,707,402.080	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,214,654.730	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,950,000.000	1,305,550.350	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	310,418.650	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,490,000.000	899,468.300	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,780,000.000	3,503,942.820	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,090,000.000	4,699,474.840	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,470,000.000	1,895,674.880	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	3,660,000.000	1,956,471.300	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,100,000.000	3,752,279.000	
FRANCE OAT 03/25/25	1,570,000.000	1,514,909.480	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,560,000.000	3,368,774.600	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,646,675.600	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	3,560,000.000	3,054,323.360	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,680,000.000	3,033,792.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	900,000.000	712,170.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,780,000.000	5,334,575.860	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,720,000.000	2,587,167.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	643,330.360	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,450,000.000	2,062,770.150	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,549,343.250	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	3,850,000.000	3,623,096.400	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,650,000.000	4,605,881.050	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	1,200,000.000	1,079,210.400	
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	4,120,000.000	4,084,127.160	
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	3,100,000.000	3,107,963.900	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,240,000.000	3,241,613.520	
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	3,000,000.000	3,047,937.000	

FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,540,000.000	2,556,870.680	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,850,000.000	3,896,977.700	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,530,000.000	1,741,250.160	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,460,000.000	1,686,022.600	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,040,000.000	2,264,145.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,690,000.000	3,175,141.500	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,330,000.000	2,731,850.440	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,100,000.000	3,512,210.100	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,610,000.000	3,196,062.450	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,271,289.090	
IRISH 0.0 10/18/31	670,000.000	550,290.430	
IRISH 0.2 05/15/27	420,000.000	388,770.480	
IRISH 0.2 10/18/30	350,000.000	299,986.370	
IRISH 0.35 10/18/32	600,000.000	494,980.200	
IRISH 0.4 05/15/35	370,000.000	286,453.260	
IRISH 0.55 04/22/41	250,000.000	170,431.750	
IRISH 0.9 05/15/28	710,000.000	662,959.660	
IRISH 1.0 05/15/26	1,120,000.000	1,077,177.240	
IRISH 1.1 05/15/29	730,000.000	677,525.530	
IRISH 1.3 05/15/33	290,000.000	257,937.310	
IRISH 1.35 03/18/31	660,000.000	607,902.900	
IRISH 1.5 05/15/50	650,000.000	475,277.400	
IRISH 1.7 05/15/37	780,000.000	679,746.600	
IRISH 2.0 02/18/45	840,000.000	712,714.800	
IRISH 2.4 05/15/30	960,000.000	949,534.080	
IRISH 3.0 10/18/43	210,000.000	212,136.960	
IRISH 5.4 03/13/25	590,000.000	602,410.650	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,020,000.000	1,891,326.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,850,000.000	1,713,655.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,296,918.000	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,800,000.000	1,566,810.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,527,890.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	978,340.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,920,000.000	1,557,396.480	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,710,000.000	1,601,244.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,110,000.000	1,769,690.760	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,480,000.000	1,030,228.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,580,000.000	1,286,910.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,157,760.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,680,000.000	1,554,672.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,700,000.000	1,404,239.100	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,300,000.000	1,220,635.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,360,000.000	1,317,894.400	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,180,000.000	2,070,509.500	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,550,000.000	1,376,188.420	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,320,000.000	1,008,480.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	930,000.000	908,773.810	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,110,000.000	699,522.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,560,000.000	1,523,652.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	2,850,000.000	2,750,820.000	

ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,290,000.000	1,988,292.500	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,140,000.000	1,905,824.080	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,120,000.000	681,643.200	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,150,000.000	822,825.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,240,000.000	1,215,076.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,540,000.000	2,428,372.080	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,660,000.000	1,624,502.560	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,700,000.000	1,638,082.600	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,790,000.000	1,745,624.110	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	217,692.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	960,000.000	636,864.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,590,000.000	1,542,141.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,360,000.000	1,132,336.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,198,725.010	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,200,000.000	869,520.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,550,000.000	1,530,556.800	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,340,000.000	1,228,780.000	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,720,000.000	1,686,976.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,270,000.000	1,001,649.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	400,000.000	291,280.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,168,560.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,940,000.000	1,901,529.800	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,520,000.000	1,315,408.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,210,000.000	2,173,473.120	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,060,000.000	931,084.280	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	547,860.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,380,000.000	1,191,583.080	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	2,120,000.000	2,019,623.020	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	1,150,000.000	1,157,245.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,440,000.000	1,277,556.480	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	1,310,000.000	1,315,109.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,170,000.000	2,184,039.900	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	1,400,000.000	1,419,320.000	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	1,500,000.000	1,517,320.500	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,380,000.000	1,297,442.880	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	1,500,000.000	1,523,250.000	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,700,000.000	1,740,290.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,470,000.000	1,478,820.000	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	1,160,000.000	1,175,892.000	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	1,400,000.000	1,446,060.000	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	400,000.000	413,760.000	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	1,600,000.000	1,689,440.000	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	800,000.000	822,320.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,159,585.000	
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	670,000.000	690,033.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,180,000.000	2,314,497.280	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,560,000.000	1,665,888.120	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,360,000.000	2,599,776.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,890,000.000	2,072,574.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,650,000.000	1,811,370.000	

ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,640,000.000	2,900,568.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,660,000.000	3,077,088.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,260,000.000	2,623,860.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,010,000.000	2,239,542.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,250,000.000	1,379,250.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	2,180,000.000	2,063,485.540	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,280,000.000	1,185,616.640	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	1,030,000.000	909,582.700	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	990,000.000	677,231.280	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,430,000.000	691,991.300	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	595,653.800	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,900,000.000	1,575,526.300	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,360,000.000	1,203,847.520	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,310,000.000	932,467.170	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,820,000.000	1,725,451.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	700,000.000	590,869.090	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,460,000.000	1,372,097.780	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,480,000.000	1,368,715.840	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	660,000.000	565,084.740	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,310,000.000	1,300,548.350	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	350,000.000	345,714.420	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,710,000.000	1,713,722.800	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,320,000.000	1,498,516.800	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,320,000.000	1,491,600.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,090,000.000	1,203,905.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,330,000.000	1,288,105.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,640,000.000	1,547,325.240	
SPAIN 0.0 01/31/27	1,910,000.000	1,752,807.000	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,880,000.000	1,675,550.000	
SPAIN 0.0 05/31/25	870,000.000	835,018.620	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,880,000.000	1,526,184.000	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,800,000.000	1,552,599.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	2,140,000.000	1,770,199.250	
SPAIN 0.6 10/31/29	2,130,000.000	1,871,577.750	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,850,000.000	1,534,377.050	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,550,000.000	1,440,570.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,700,000.000	1,510,535.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,600,000.000	1,152,857.600	
SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	350,460.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,790,000.000	973,509.400	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,810,000.000	1,267,175.570	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,450,000.000	2,182,337.500	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,630,000.000	2,518,611.610	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,170,000.000	2,042,621.000	
SPAIN 1.4 07/30/28	2,170,000.000	2,029,384.000	

	SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,395,777.000	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	1,766,529.420	
	SPAIN 1.45 10/31/71	660,000.000	323,460.720	
	SPAIN 1.5 04/30/27	1,510,000.000	1,444,617.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,630,000.000	1,598,069.120	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,940,000.000	1,669,756.060	
	SPAIN 1.9 10/31/52	1,270,000.000	853,916.250	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,730,000.000	1,691,543.830	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,664,600.040	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,810,000.000	1,782,793.890	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,870,000.000	1,740,783.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	1,720,000.000	1,645,400.160	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,560,000.000	1,301,479.920	
	SPAIN 2.8 05/31/26	1,800,000.000	1,790,370.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,300,000.000	1,140,869.600	
	SPAIN 3.15 04/30/33	1,570,000.000	1,566,090.700	
	SPAIN 3.45 07/30/43	740,000.000	713,346.680	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,120,000.000	1,022,501.760	
	SPAIN 3.5 05/31/29	500,000.000	513,269.600	
	SPAIN 3.55 10/31/33	1,820,000.000	1,869,686.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,660,000.000	1,794,626.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,895,000.000	1,931,774.370	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,880,000.000	2,142,372.800	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,910,000.000	2,207,005.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,060,000.000	2,251,374.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,210,000.000	1,463,681.340	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,515,000.000	1,812,153.610	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,330,000.000	2,484,017.660	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,960,000.000	2,234,903.720	
	ユーロ 小計	548,330,000.000 (89,196,841,100)	507,209,176.290 (82,507,716,707)	
国債証券 合計		282,189,743,519.500 (282,189,743,520)	255,953,711,162 (255,953,711,162)	
合計			255,953,711,162 (255,953,711,162)	

(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 254銘柄	46.62	47.33
イギリス・ポンド	国債証券 58銘柄	5.16	5.24
イスラエル・シェケル	国債証券 12銘柄	0.32	0.32
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.34	1.36
オブショア・人民元	国債証券 49銘柄	8.24	8.37
カナダ・ドル	国債証券 37銘柄	1.98	2.01
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.40	0.40

スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.20	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.26	0.26
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	0.23	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.16	0.17
ポーランド・ズロチ	国債証券	12銘柄	0.52	0.53
マレーシア・リングgit	国債証券	26銘柄	0.47	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.85	0.86
ユーロ	国債証券	343銘柄	31.76	32.24

(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。

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型
D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型
D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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22期中間計算期間（2024年2月27日から2024年8月26日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月25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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の2024年2月27日から2024年8月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の2024年8月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月27日から2024年8月26日まで）の損益の状況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、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、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。

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、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要な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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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) 上記の中間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。

【中間財務諸表】

【D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 2024年2月26日現在	第22期中間計算期間末 2024年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	705,733,434	706,278,172
親投資信託受益証券	20,890,798,864	21,138,032,430
未収入金	54,224,000	9,370,000
流動資産合計	21,650,756,298	21,853,680,602
資産合計	21,650,756,298	21,853,680,602
負債の部		
流動負債		
未払解約金	89,567,208	31,185,194
未払受託者報酬	3,425,027	3,575,424
未払委託者報酬	26,258,846	27,411,813
その他未払費用	401,475	406,775
流動負債合計	119,652,556	62,579,206
負債合計	119,652,556	62,579,206
純資産の部		
元本等		
元本	11,393,251,151	11,611,865,282
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	10,137,852,591	10,179,236,114
(分配準備積立金)	2,852,178,127	2,651,426,926
元本等合計	21,531,103,742	21,791,101,396
純資産合計	21,531,103,742	21,791,101,396
負債純資産合計	21,650,756,298	21,853,680,602

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2023年2月28日 至 2023年8月27日	第22期中間計算期間 自 2024年2月27日 至 2024年8月26日
営業収益		
受取利息	3,464	279,622
有価証券売買等損益	815,476,401	△124,599,434
営業収益合計	815,479,865	△124,319,812
営業費用		
支払利息	162,921	2,782
受託者報酬	3,201,950	3,575,424
委託者報酬	24,548,579	27,411,813
その他費用	379,592	406,775
営業費用合計	28,293,042	31,396,794
営業利益又は営業損失(△)	787,186,823	△155,716,606
経常利益又は経常損失(△)	787,186,823	△155,716,606
中間純利益又は中間純損失(△)	787,186,823	△155,716,606
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	38,822,948	△3,216,535
期首剰余金又は期首欠損金(△)	7,903,980,759	10,137,852,591
剰余金増加額又は欠損金減少額	731,039,901	943,185,440
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	731,039,901	943,185,440
剰余金減少額又は欠損金増加額	486,043,786	749,301,846
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	486,043,786	749,301,846
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	8,897,340,749	10,179,236,114

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第22期中間計算期間	
	自 2024年2月27日	至 2024年8月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2024年2月26日、当中間計算期間末日を2024年8月26日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第21期	第22期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在
1. 期首元本額	10,828,169,759円	11,393,251,151円
期中追加設定元本額	1,999,883,214円	1,060,692,700円
期中一部解約元本額	1,434,801,822円	842,078,569円
2. 受益権の総数	11,393,251,151口	11,611,865,282口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期	第22期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	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	同左

場合、当該価額が異なることもあります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第21期 2024年2月26日現在	第22期中間計算期間末 2024年8月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,8898円 (18,898円)	1,8766円 (18,766円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月25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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2024年2月27日から2024年8月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2024年8月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月27日から2024年8月26日まで）の損益の状況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、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、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。

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、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要な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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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) 上記の中間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。

【D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 2024年2月26日現在	第22期中間計算期間末 2024年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,580,250,582	1,622,662,962
親投資信託受益証券	47,844,610,300	48,522,771,740
未収入金	67,386,000	150,000
流動資産合計	49,492,246,882	50,145,584,702
資産合計	49,492,246,882	50,145,584,702
負債の部		
流動負債		
未払解約金	120,396,951	40,982,177
未払受託者報酬	7,717,815	8,238,096
未払委託者報酬	66,888,022	71,397,246
その他未払費用	656,315	683,431
流動負債合計	195,659,103	121,300,950
負債合計	195,659,103	121,300,950
純資産の部		
元本等		
元本	18,824,329,381	19,012,719,618
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	30,472,258,398	31,011,564,134
(分配準備積立金)	13,237,982,363	12,542,310,826
元本等合計	49,296,587,779	50,024,283,752
純資産合計	49,296,587,779	50,024,283,752
負債純資産合計	49,492,246,882	50,145,584,702

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2023年2月28日 至 2023年8月27日	第22期中間計算期間 自 2024年2月27日 至 2024年8月26日
営業収益		
受取利息	7,522	642,186
有価証券売買等損益	3,068,102,164	303,654,440
営業収益合計	3,068,109,686	304,296,626
営業費用		
支払利息	356,270	6,297
受託者報酬	6,998,133	8,238,096
委託者報酬	60,650,861	71,397,246
その他費用	609,324	683,431
営業費用合計	68,614,588	80,325,070
営業利益又は営業損失(△)	2,999,495,098	223,971,556
経常利益又は経常損失(△)	2,999,495,098	223,971,556
中間純利益又は中間純損失(△)	2,999,495,098	223,971,556
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	95,129,441	33,418,991
期首剰余金又は期首欠損金(△)	22,336,439,878	30,472,258,398
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,755,876,615	2,002,251,068
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,755,876,615	2,002,251,068
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,042,461,740	1,653,497,897
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,042,461,740	1,653,497,897
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	25,954,220,410	31,011,564,134

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第22期中間計算期間	
	自 2024年2月27日	至 2024年8月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2024年2月26日、当中間計算期間末日を2024年8月26日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第21期	第22期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在
1. 期首元本額	17,911,791,114円	18,824,329,381円
期中追加設定元本額	2,686,742,128円	1,209,267,830円
期中一部解約元本額	1,774,203,861円	1,020,877,593円
2. 受益権の総数	18,824,329,381口	19,012,719,618口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期	第22期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間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	(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つた	同左

場合、当該価額が異なることもあります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第21期 2024年2月26日現在	第22期中間計算期間末 2024年8月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,6188円 (26,188円)	2,6311円 (26,311円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月25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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の2024年2月27日から2024年8月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の2024年8月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月27日から2024年8月26日まで）の損益の状況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、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、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。

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、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要な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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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) 上記の中間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。

【D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 3成長型】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 2024年2月26日現在	第22期中間計算期間末 2024年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,440,871,490	1,484,349,744
親投資信託受益証券	42,813,408,531	43,762,264,644
未収入金	5,677,000	22,630,000
流動資産合計	44,259,957,021	45,269,244,388
資産合計	44,259,957,021	45,269,244,388
負債の部		
流動負債		
未払解約金	69,283,013	71,807,575
未払受託者報酬	6,710,774	7,473,928
未払委託者報酬	64,871,224	72,248,327
その他未払費用	596,568	638,104
流動負債合計	141,461,579	152,167,934
負債合計	141,461,579	152,167,934
純資産の部		
元本等		
元本	12,665,777,646	12,810,343,464
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	31,452,717,796	32,306,732,990
(分配準備積立金)	14,102,186,728	13,186,889,289
元本等合計	44,118,495,442	45,117,076,454
純資産合計	44,118,495,442	45,117,076,454
負債純資産合計	44,259,957,021	45,269,244,388

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2023年2月28日 至 2023年8月27日	第22期中間計算期間 自 2024年2月27日 至 2024年8月26日
営業収益		
受取利息	6,491	587,510
有価証券売買等損益	3,567,528,723	553,283,113
営業収益合計	3,567,535,214	553,870,623
営業費用		
支払利息	304,743	5,741
受託者報酬	5,887,501	7,473,928
委託者報酬	56,912,941	72,248,327
その他費用	543,427	638,104
営業費用合計	63,648,612	80,366,100
営業利益又は営業損失(△)	3,503,886,602	473,504,523
経常利益又は経常損失(△)	3,503,886,602	473,504,523
中間純利益又は中間純損失(△)	3,503,886,602	473,504,523
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	120,409,568	66,222,199
期首剰余金又は期首欠損金(△)	21,599,780,104	31,452,717,796
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,044,224,938	2,573,847,621
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,044,224,938	2,573,847,621
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,293,067,737	2,127,114,751
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,293,067,737	2,127,114,751
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	25,734,414,339	32,306,732,990

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第22期中間計算期間	
	自 2024年2月27日	至 2024年8月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2024年2月26日、当中間計算期間末日を2024年8月26日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第21期	第22期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在
1. 期首元本額	11,868,114,973円	12,665,777,646円
期中追加設定元本額	2,230,886,992円	1,000,146,961円
期中一部解約元本額	1,433,224,319円	855,581,143円
2. 受益権の総数	12,665,777,646口	12,810,343,464口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期	第22期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	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	同左

場合、当該価額が異なることもあります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第21期 2024年2月26日現在	第22期中間計算期間末 2024年8月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,483円 (34,833円)	3,521円 (35,219円)

(参考)

「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型」、「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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、中間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)

2024年8月26日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,001,093,897
株式	561,965,045,350
派生商品評価勘定	328,266,450
未収配当金	645,110,129
差入委託証拠金	1,373,835,624
流動資産合計	576,313,351,450
資産合計	576,313,351,450
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,211,400
前受金	463,070,000
未払解約金	692,692,000
流動負債合計	1,165,973,400
負債合計	1,165,973,400
純資産の部	
元本等	
元本	122,402,978,585
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	452,744,399,465
元本等合計	575,147,378,050
純資産合計	575,147,378,050
負債純資産合計	576,313,351,450

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月27日
	至 2024年8月26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	2024年8月26日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	121,324,101,032円
同期中追加設定元本額	23,282,822,768円
同期中一部解約元本額	22,203,945,215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	2,389,417,366円
たわらノーロード 国内株式くらっ専用>	6,153,196,563円
One DC 国内株式インデックスファンド	33,816,294,953円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,471,330,806円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,958,569円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	7,816,793円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	18,692,588円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	25,971,845円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	24,226,143円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	11,940,511円
たわらノーロード TOPIX	2,939,542,100円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,908,335,946円
たわらノーロード バランス (堅実型)	49,216,083円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,695,277円
たわらノーロード バランス (積極型)	758,697,533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)	2,358,926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)	136,009,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	419,611,645円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	384,853,822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)	570,555,155円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	249,483円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,127,685円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,580,224円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,451,451円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	15,308,081円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	10,674円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	49,545円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	326,442円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金> O n e グローバルバランス	33,416,703,253円
D I A M グローバルバランス	83,943,719円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	872,110,548円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,209,720,073円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,889,269,523円
D I A M DC バランス 3 0 インデックスファンド	243,375,699円
D I A M DC バランス 5 0 インデックスファンド	851,939,319円
D I A M DC バランス 7 0 インデックスファンド	1,016,246,674円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,854,132円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	971,013,845円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,880,508円
D I A M DC 8 資産バランスファンド (新興国 1 0)	257,237,298円
D I A M DC 8 資産バランスファンド (新興国 2 0)	324,600,113円
D I A M DC 8 資産バランスファンド (新興国 3 0)	572,411,769円
投資のソムリエ	6,497,487,572円
クルーズコントロール	35,585,879円
投資のソムリエ<DC年金>	754,241,896円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	364,341,592円
4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,392,943,718円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	519,929,252円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド	1,472,797,460円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー 2 0 4 5)	87,190,652円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー 2 0 5 5)	45,187,006円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド (DC)	4,970,557円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー 2 0 3 5)	169,042,021円
4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	580,280,744円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	189,500,191円
9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	229,249,412円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー 2 0 4 0)	83,112,314円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー 2 0 5 0)	49,223,152円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー 2 0 6 0)	30,014,895円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	691,392,539円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー 2 0 6 5)	7,688,024円
O n e グローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	992,177円
O n e グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	29,305,874円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 1 9 - 1 2 (適格機関投資家限定)	17,891,924円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 0 - 0 6 (適格機関投資家限定)	18,058,882円
マルチアセット・インカム戦略ファンド 2 0 - 0 8 (適格機関投資家限定)	8,892,722円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 0 - 0 9 (適格機関投資家限定)	10,815,134円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 1 - 0 3 (適格機関投資家限定)	2,550,654円
インカム重視マルチアセット運用ファンド II 2 0 2 1 - 0 4 (適格機関投資家限定)	45,769,095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)	111,102,026円

ヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	
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)	12,512,028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)	100,942,448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)	379,535,170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)	39,875,776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)	382,181,782円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	113,185,019円
AMOne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) (適格機関投資家限定)	1,514,537円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	20,202,616円
日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	35,824,908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)	29,793,559円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	3,842,096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)	31,558,641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)	57,656,041円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,410,106円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	9,125,908円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,846,683円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	76,013円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	509,693円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,481,342円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	227,328,274円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	352,016,854円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,094,727,843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)	9,459,792円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	12,623,430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)	118,699,401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)	23,222,045円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	49,836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)	111,925,939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)	6,874,469円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	27,732,236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)	54,241,150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)	115,279,283円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	15,238,675円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	5,873,361円
動的パッケージファンド<DC年金>	15,853,719円
コア資産形成ファンド	7,268,402円
MHAMトピックスファンド	776,073,240円
MHAM TOPIXファンドVA (適格機関投資家専用)	43,988,515円

MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,762,766,017円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,431,036,969円
計	122,402,978,585円
2. 受益権の総数	122,402,978,585口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年8月26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					
先物取引					
買建	13,373,050,000	—	13,691,275,000	318,225,000	
合計	13,373,050,000	—	13,691,275,000	318,225,000	

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月26日現在
1口当たり純資産額	4.6988円
(1万口当たり純資産額)	(46,988円)

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)

2024年8月26日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,081,520,830
コール・ローン	4,843,918,037
株式	1,484,452,384,697
投資信託受益証券	2,209,655,568
投資証券	27,559,502,039
派生商品評価勘定	614,218,255
未収入金	7,274,749
未収配当金	1,757,971,752
差入委託証拠金	12,147,201,551
流動資産合計	1,542,673,647,478
資産合計	1,542,673,647,478
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	76,091,919
未払解約金	57,763,000
流動負債合計	133,854,919
負債合計	133,854,919
純資産の部	
元本等	
元本	170,935,732,236
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	1,371,604,060,323
元本等合計	1,542,539,792,559
純資産合計	1,542,539,792,559
負債純資産合計	1,542,673,647,478

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月27日 至 2024年8月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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 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 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 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 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	2024年8月26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	162, 160, 503, 494円
同期中追加設定元本額	25, 759, 823, 933円
同期中一部解約元本額	16, 984, 595, 191円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,846,185,102円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1,326,759円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,348,704円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	15,848,762円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	17,590,613円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	19,677,824円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	10,114,827円
たわらノーロード 先進国株式	67,151,870,419円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,926,732,288円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	978,209,785円
たわらノーロード バランス (堅実型)	74,666,514円
たわらノーロード バランス (標準型)	764,774,600円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,131,854,758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)	41,599,500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)	243,789,477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)	267,774,727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)	486,370,513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)	241,175円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	14,238,797円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,861,943円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	15,326,787円
たわらノーロード 全世界株式	5,484,303,009円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	678円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	3,107円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (積極型)	2,512円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	58,056,431,491円
O n e DC 先進国株式インデックスファンド	3,628,081,008円
O n e グローバルバランス	42,936,672円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	115,779,355円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	658,288,658円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	953,681,426円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	61,630,055円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	188,107,574円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	209,559,846円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	16,014,340円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	602,328,460円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	111,796,003円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	131,814,629円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	168,823,148円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	297,114,830円
投資のソムリエ	6,291,485,187円
クルーズコントロール	9,109,881円
投資のソムリエ<DC年金>	729,667,609円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	191,408,608円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	338,468,143円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	534,396,905円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,515,198,705円
ワールドアセットバランス (基本コース)	80,909,672円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	208,686,290円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	66,511,296円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	34,545,257円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	5,108,934円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	160,102,073円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	146,007,688円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	360,819,681円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	115,604,180円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	61,093,848円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	37,565,917円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	22,888,723円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	178,949,982円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	5,951,723円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	29,448,508円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	3,037,057円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06（適格機関投資家限定）	3,065,731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）	31,176,073円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09（適格機関投資家限定）	1,849,859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）	236,047円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04（適格機関投資家限定）	7,776,075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）	6,532,415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）	2,143,943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）	11,736,453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）	16,600,867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）	459,553,864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）	33,989,856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）	970,977,004円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	1,040,620,981円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	109,498,592円
AMOne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）（適格機関投資家限定）	221,397円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	4,618,935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）	5,054,595円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,715,740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）	16,907,422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）	30,870,690円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	1,289,257円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	7,326,221円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	759,334円

D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	27, 022円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	272, 595円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	1, 185, 006円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	81, 153, 480円
D I A Mバランスファンド3 7. 5 V A (適格機関投資家限定)	164, 930, 121円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	586, 172, 071円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	25, 824, 591円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	20, 654, 200円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	127, 486, 654円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	4, 116, 400円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	122, 903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)	39, 960, 185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)	3, 678, 774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)	14, 863, 447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)	20, 057, 351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)	61, 774, 180円
動的パッケージファンド<DC年金>	13, 765, 983円
コア資産形成ファンド	6, 433, 707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, 434, 326, 157円
MHAM外国株式インデックスファンド	130, 335, 083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>	1, 003, 454, 407円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1, 544, 865, 082円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2, 010, 682, 162円
計	170, 935, 732, 236円
2. 受益権の総数	170, 935, 732, 236口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年8月26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					
売建	35,732,038	—	35,732,024	14	
イギリス・ポンド	22,766,400	—	22,766,280	120	
オーストラリア・ドル	12,965,638	—	12,965,744	△106	
買建	4,648,165,916	—	4,573,029,542	△75,136,374	
アメリカ・ドル	3,648,196,210	—	3,583,869,023	△64,327,187	
イギリス・ポンド	192,657,651	—	190,882,967	△1,774,684	
オーストラリア・ドル	16,677,340	—	16,574,728	△102,612	
カナダ・ドル	140,897,103	—	139,369,001	△1,528,102	
ユーロ	649,737,612	—	642,333,823	△7,403,789	
合計	4,683,897,954	—	4,608,761,566	△75,136,360	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2024年8月26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 先物取引 買建	27,638,260,604	—	28,251,523,300	613,262,696	
合計	27,638,260,604	—	28,251,523,300	613,262,696	

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年8月26日現在

1口当たり純資産額	9,0241円
(1万口当たり純資産額)	(90,241円)

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)

2024年8月26日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,528,622,432
国債証券	455,869,491,350
地方債証券	26,893,121,201
特殊債券	26,262,376,500
社債券	22,001,206,000
未収利息	896,649,948
前払費用	349,296,441
流動資産合計	534,800,763,872
資産合計	534,800,763,872
負債の部	
流動負債	
未払解約金	152,481,000
流動負債合計	152,481,000
負債合計	152,481,000
純資産の部	
元本等	
元本	438,169,789,935
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	96,478,492,937
元本等合計	534,648,282,872
純資産合計	534,648,282,872
負債純資産合計	534,800,763,872

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月27日 至 2024年8月26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。時価評価にあつては、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	2024年8月26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	429,366,789,140円
同期中追加設定元本額	353,704,398,788円
同期中一部解約元本額	344,901,397,993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	31,072,566,151円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	49,680,795円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	91,497,323円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	51,644,912円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	661,076,252円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	282,371,982円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	32,901,219円
たわらノーロード 国内債券	19,906,592,586円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	7,253,790,900円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,688,496,092円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,585,689,378円
たわらノーロード バランス（積極型）	493,994,327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）	225,168,591円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	2,507,319,012円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	3,021,394,422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）	925,995,122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）	44,595,018円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	22,642,806円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	193,017,946円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	7,651,872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）	16,586円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	16,586円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,651,078,010円
O n e グローバルバランス	207,090,854円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	11,731,261,961円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	17,699,667,542円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	8,077,403,023円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,504,735,230円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,852,368,441円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	555,432,404円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	93,375,152円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,507,090,002円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,436,914円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	5,765,367,836円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,613,532,798円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	569,216,433円
投資のソムリエ	83,487,166,696円
クルーズコントロール	154,132,975円
投資のソムリエ<DC年金>	9,530,152,155円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,351,083,468円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,929,393,002円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	11,153,343,499円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	32,231,685,105円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	645,463,091円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	334,726,832円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	107,881,060円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,137,544,953円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,923,138,407円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,371,088,082円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,577,299,809円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	738,517,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	364,339,713円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	222,140,962円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,291,620,547円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	58,751,910円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	177,696,340円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,185,312,932円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,189,470,829円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,165,236,942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)	716,558,013円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,167,682,254円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	3,023,990,191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)	2,037,395,142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)	825,517,733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)	2,070,641,757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)	1,316,161,002円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,904,178,959円
O n e コアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,068,557,042円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,426,693,433円
A M O n e 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)(適格機関投資家限定)	201,195,176円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	271,240,981円
O n e 収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	4,064,184,282円
O n e 収益追求型マルチアセット戦略ファンドIII(適格機関投資家限	4,050,598,427円

定)	
One 収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ (適格機関投資家限定)	3,998,262,930円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	1,976,372,339円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	48,349,524円
AMOne コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	817,696,087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)	154,984,006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)	94,310,704円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	22,996,383円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	55,979,989円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	29,065,240円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	412,945円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,125,025円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	9,057,686円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,477,898,381円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,159,278,715円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,470,265,365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)	58,105,973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)	129,159,932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)	1,460,760,803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)	95,092,644円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	613,938円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	1,183,904,819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)	28,098,872円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	227,162,681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)	300,235,667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)	784,401,617円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	205,475,451円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	56,085,518円
コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	387,569,601円
動的パッケージファンド<DC年金>	211,988,862円
コア資産形成ファンド	98,905,431円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	13,051,627,012円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	23,731,134,098円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	22,310,113,333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]	107,034,862円
計	438,169,789,935円
2. 受益権の総数	438,169,789,935口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸

差額	借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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 該当事項はありませぬ。</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つた場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月26日現在
1口当たり純資産額	1,2202円
(1万口当たり純資産額)	(12,202円)

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)

2024年8月26日現在

資産の部	
流動資産	
預金	888,091,039
コール・ローン	790,528,425
国債証券	253,307,748,590
未収利息	1,619,568,257
前払費用	260,590,740
流動資産合計	256,866,527,051
資産合計	256,866,527,051
負債の部	
流動負債	
未払解約金	25,029,000
流動負債合計	25,029,000
負債合計	25,029,000
純資産の部	
元本等	
元本	109,581,690,761
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	147,259,807,290
元本等合計	256,841,498,051
純資産合計	256,841,498,051
負債純資産合計	256,866,527,051

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月27日 至 2024年8月26日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
2. 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 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	2024年8月26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	111,583,962,350円
同期中追加設定元本額	21,853,342,574円
同期中一部解約元本額	23,855,614,163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	6,462,016,258円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	1,477,145円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	9,887,977円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	29,699,694円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	19,580,239円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	30,647,055円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	18,927,225円
たわらノーロード 先進国債券	22,496,928,661円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,756,754,385円
たわらノーロード バランス（堅実型）	73,414,837円
たわらノーロード バランス（標準型）	447,396,529円
たわらノーロード バランス（積極型）	103,432,062円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	21,063,099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）	1,074,620,800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）	2,014,529,595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）	1,072,317,328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）	609,755,177円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,278,711円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,452,541円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	190,683,112円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	30,611,303円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	28,390,452円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	4,297円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	4,355円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	4,058円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	7,004,210,936円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	2,088,358,771円
O n e グローバルバランス	115,080,200円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	717,155,503円

D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2, 518, 705, 542円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2, 997, 355, 272円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	358, 167, 122円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	828, 811, 106円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	804, 784, 681円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25, 468, 703円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	955, 746, 909円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17, 942, 671円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	154, 157, 168円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	160, 868, 965円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	280, 555, 631円
クルーズコントロール	109, 636, 898円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	224, 640, 619円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1, 093, 351, 431円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	851, 307, 869円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	177, 400, 920円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	687, 248, 824円
O n e グローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	5, 086, 434円
O n e グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	54, 460, 068円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	899, 232, 529円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	402, 557, 402円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	403, 928, 856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)	390, 399, 927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)	243, 268, 057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)	544, 565円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04(適格機関投資家限定)	1, 028, 555, 122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)	357, 907, 785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)	280, 337, 444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)	350, 378, 615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)	671, 386, 296円
D I A M 為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6, 014, 090, 179円
D I A M 外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1, 358, 806, 804円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2, 510, 453, 786円
A M O n e 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)(適格機関投資家限定)	75, 955, 441円
D I A M ワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	41, 274, 899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)	671, 281, 806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)	310, 370, 108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)	188, 914, 819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)	11, 507, 301円

D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	18, 671, 453円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	5, 813, 409円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	51, 343円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1, 563, 651円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	3, 021, 830円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1, 086, 642, 851円
D I A Mバランスファンド3 7. 5 V A (適格機関投資家限定)	1, 171, 364, 152円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2, 241, 253, 637円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	48, 527, 723円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	90, 598, 157円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	973, 648, 995円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	178, 494, 892円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	153, 671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)	152, 774, 994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)	153, 086, 731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)	314, 980, 576円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	31, 261, 554円
動的パッケージファンド<DC年金>	46, 263, 167円
コア資産形成ファンド	21, 854, 025円
たわらノーロード 外国債券(為替ヘッジなし)<ラップ専用>	3, 508, 784, 441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>	12, 292, 153, 428円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5, 206, 181, 853円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	5, 086, 013, 349円
計	109, 581, 690, 761円
2. 受益権の総数	109, 581, 690, 761口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月26日現在

1口当たり純資産額	2,3438円
(1万口当たり純資産額)	(23,438円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型

2024年8月30日現在

I 資産総額	21,994,449,988円
II 負債総額	24,933,983円
III 純資産総額 (I - II)	21,969,516,005円
IV 発行済数量	11,667,229,926口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.8830円

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型

2024年8月30日現在

I 資産総額	50,506,487,019円
II 負債総額	30,795,022円
III 純資産総額 (I - II)	50,475,691,997円
IV 発行済数量	19,067,922,886口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.6472円

D I AMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型

2024年8月30日現在

I 資産総額	45,698,599,714円
II 負債総額	28,259,503円
III 純資産総額 (I - II)	45,670,340,211円
IV 発行済数量	12,856,898,819口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	3.5522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

2024年8月30日現在

I 資産総額	587,744,531,053円
II 負債総額	844,065,274円
III 純資産総額 (I - II)	586,900,465,779円
IV 発行済数量	122,512,674,820口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.7905円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	1,553,620,964,811円
II 負債総額	45,596,073円
III 純資産総額 (I - II)	1,553,575,368,738円
IV 発行済数量	171,592,262,537口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	9.0539円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	622,841,491,977円
II 負債総額	172,797,250,000円
III 純資産総額 (I - II)	450,044,241,977円
IV 発行済数量	369,117,812,161口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2192円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	258,096,674,773円
II 負債総額	3,351,301,781円
III 純資産総額 (I - II)	254,745,372,992円
IV 発行済数量	108,484,219,541口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.3482円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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（2024年8月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2024年8月30日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年8月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,455,299,141,596
追加型株式投資信託	770	16,616,529,639,752
単位型公社債投資信託	21	30,883,481,518
単位型株式投資信託	194	1,065,722,864,899
合計	1,011	19,168,435,127,765

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第39期事業年度（自2023年4月1日至2024年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年5月23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 長 谷 川 敬

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2023年4月1日から2024年3月31日までの第39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2024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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産	1,127	1,093
建物	※1 1,001	※1 918
器具備品	※1 118	※1 130
リース資産	※1 7	※1 5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産	5,021	4,495
ソフトウェア	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産	9,768	8,935
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位：百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(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	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
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	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	95,739		102,113	
運用受託報酬	16,150		17,155	
投資助言報酬	2,048		2,211	
その他営業収益	23		26	
営業収益計		113,962		121,507
営業費用				
支払手数料	41,073		44,366	
広告宣伝費	216		329	
公告費	0		0	
調査費	33,177		35,468	
調査費	12,294		13,277	
委託調査費	20,882		22,190	
委託計算費	548		558	
営業雑経費	733		823	
通信費	36		36	
印刷費	504		598	
協会費	69		65	
諸会費	29		44	
支払販売手数料	92		78	
営業費用計		75,749		81,545
一般管理費				
給料	10,484		10,763	
役員報酬	168		164	
給料・手当	9,199		9,425	
賞与	1,115		1,173	
交際費	17		34	
寄付金	11		15	
旅費交通費	128		162	
租税公課	330		489	
不動産賃借料	1,006		1,030	
退職給付費用	437		412	
固定資産減価償却費	1,388		1,567	
福利厚生費	47		46	
修繕費	1		1	
賞与引当金繰入額	1,730		1,927	
役員賞与引当金繰入額	48		52	
機器リース料	0		0	
事務委託費	4,074		3,379	
事務用消耗品費	37		46	
器具備品費	1		3	
諸経費	334		240	
一般管理費計		20,078		20,172
営業利益		18,135		19,788

(単位：百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		10		4
受取配当金	※1	2,400	※1	899
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		10		18
時効後支払損引当金戻入額		24		35
営業外収益計		2,446		959
営業外費用				
為替差損		3		19
金銭の信託運用損		1,003		1,008
早期割増退職金		24		6
雑損失		47		0
営業外費用計		1,079		1,034
経常利益		19,502		19,712
特別利益				
投資有価証券売却益		4		—
特別利益計		4		—
特別損失				
固定資産除却損		12		6
投資有価証券売却損		9		—
関係会社株式評価損		584		1,362
減損損失		—	※2	231
特別損失計		606		1,601
税引前当期純利益		18,900		18,111
法人税、住民税及び事業税		4,881		5,769
法人税等調整額		197		△510
法人税等合計		5,078		5,258
当期純利益		13,821		12,852

(3) 【株主資本等変動計算書】

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
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	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034

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

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<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 … 2～20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、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>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。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<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。</p> <p>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 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>
<p>6. 収益及び費用の計上基準</p>	<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>

(1) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(4) 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
建物	523	630
器具備品	934	769
リース資産	1	3

(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38期 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日)
受取配当金	2,393	895

※2. 減損損失

当事業年度において、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。

(株主資本等変動計算書関係)

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023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
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類 株式				

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

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
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

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

2024年6月17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
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					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期（2023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	29,184	29,184	—
(2) 投資有価証券 その他有価証券	1	1	—
資産計	29,186	29,186	—

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 その他有価証券	1	1	—
資産計	28,145	28,145	—

(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38期（2023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	33,770	—	—	—
(2) 金銭の信託	29,184	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	16,279	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	3,307	—	—	—
(5) 投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	82,540	1	—	—

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 その他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	91,923	1	—	—

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38期（2023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	—	29,184	—	29,184
(2) 投資有価証券 その他有価証券	—	1	—	1
資産計	—	29,186	—	29,186

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 その他有価証券	—	1	—	1
資産計	—	28,145	—	28,145

(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（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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024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	180	182
関係会社株式		
非上場株式	5,810	4,447

(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38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円）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38期（2023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180百万円）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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

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。

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）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。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	△191	△246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

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

	(百万円)	
	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	△44	△40
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	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	22	13
過去勤務費用の費用処理額	34	△0
その他	△4	△4
確定給付制度に係る退職給付費用	334	307

(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24百万円、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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024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103百万円、当事業年度104百万円であります。

(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

	<u>第38期</u> (2023年3月31日現在)	<u>第39期</u> (2024年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	121	195
未払事業所税	9	9
賞与引当金	529	590
未払法定福利費	94	98
運用受託報酬	390	351
資産除去債務	15	17
減価償却超過額 (一括償却資産)	21	12
減価償却超過額	198	91
繰延資産償却超過額 (税法上)	297	331
退職給付引当金	812	832
時効後支払損引当金	33	22
ゴルフ会員権評価損	7	6
関係会社株式評価損	345	761
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	—	70
その他	13	8
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	<u>2,895</u>	<u>3,406</u>
繰延税金負債	<u>—</u>	<u>—</u>
繰延税金負債合計	<u>—</u>	<u>—</u>
繰延税金資産の純額	<u>2,895</u>	<u>3,406</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

	<u>第38期</u> (2023年3月31日現在)	<u>第39期</u> (2024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	△3.69 %	△1.44 %
その他	△0.06 %	△0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>26.87 %</u>	<u>29.04 %</u>

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	68,921百万円	60,761百万円
資産合計	68,921百万円	60,761百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	3,643百万円	1,957百万円
負債合計	3,643百万円	1,957百万円
純資産	65,278百万円	58,804百万円

(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	51,451百万円	47,640百万円
顧客関連資産	20,947百万円	17,109百万円

(2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,039百万円	△7,649百万円
経常利益	△8,039百万円	△7,649百万円
税引前当期純利益	△8,039百万円	△7,649百万円
当期純利益	△6,744百万円	△6,474百万円
1株当たり当期純利益	△168,617円97銭	△161,850円28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	4,228百万円	3,837百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
委託者報酬	95,739百万円	102,113百万円
運用受託報酬	14,651百万円	15,156百万円
投資助言報酬	2,048百万円	2,211百万円
成功報酬(注)	1,499百万円	1,999百万円
その他営業収益	23百万円	26百万円
合計	113,962百万円	121,507百万円

(注) 成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) 及び第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 営業収益

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

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。

(2) 子会社及び関連会社等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

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。

(3) 兄弟会社等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023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	7,474	未払 手数料	1,579
	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	13,932	未払 手数料	2,404

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。

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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
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	13,821百万円	12,852百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

約 款

追加型証券投資信託
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型
約 款

運用の基本方針

約款第17条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券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。

(2) 投資態度

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

2) 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30%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、当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目指して運用します。

(注) 当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TOPIX（東証株価指数、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）、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、当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。

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及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変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

6) 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。）を行うことができます。

7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 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) 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。
- 3) 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) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 5) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 6) 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30%以下とします。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第22条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第23条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、約款第24条の範囲で行います。
- 10) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（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

委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者としみずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

<信託の目的、金額および限度額>

第3条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができるものとします。

③追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

④委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第49条第7項、第51条第1項、第52条第1項、第53条第1項および第55条第2項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

<受益権の分割および再分割>

第5条 委託者は、第3条第1項による受益権について100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

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

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第27条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

- ③第30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時の異なる受益権の内容>

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

- ③委託者は、第5条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

- ④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

<受益権の設定に係る受託者の通知>

第11条 受託者は、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係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

<受益権の申込み単位、価額および手数料>

第12条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第5条第1項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日が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、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- ②第1項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ③第1項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第4項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1口につき1円に、第4項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については1口につき1円とします。）に乗じて得た額とします。
- ⑤前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第46条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第40条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

- 第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、
- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、
 - ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

<受益権の譲渡の対抗要件>

- 第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

- 第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとし、
1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます、以下同じ。）

- イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第16条 委託者は、信託金を主として第1号から第4号までのアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託(以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。)の受益証券ならびに第5号以降の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
2. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. 株券または新株引受権証券
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. 特定目的会社に係る特定社債券(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. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(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. 特定目的会社に係る優先出資証券(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、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 証券投資信託または外国証券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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ②委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の40を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の40を超えることとなった場合には、これを調整します。
- ⑤委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の15を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑦前3項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<運用の基本方針>

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

- 第18条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ②前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとし、

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第19条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ②委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③委託者は、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係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「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て、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係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、かつ本条で規定する全オプション取引に係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。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、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。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係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係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。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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。
- ⑤スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- ⑥委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、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。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係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係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係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係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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係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係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。

- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係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係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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、委託者は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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。
- ⑦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。
- ⑧委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第24条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

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

- 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<公社債の空売りの指図範囲>

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

<公社債の借入れ>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ②前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債

の一部を返還するための指図をするものとします。

④第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の30を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

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

<外国為替予約の指図>

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

②前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

③前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

- 第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- ②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
 - ③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
 - ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

- 第35条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

- 第36条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

- 第37条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ②一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
 - ③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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 - ④借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

- 第38条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

- 第39条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ②信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
 - ③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを

定めます。

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、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。ただし、第1計算期間は平成14年12月13日から平成16年2月25日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

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

<信託財産に関する報告>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

<信託事務の諸費用>

第42条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年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消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで …年10,000分の31

2. 平成17年10月1日から信託終了の日まで …年10,000分の26

②前項の信託報酬は、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信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

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

<収益の分配方式>

第44条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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

第45条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金(信託終了時

における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)については第47条第1項に規定する支払開始日まで、一部解約金については第47条第2項に規定する支払日まで、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

<収益分配金の再投資等>

第46条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- ②委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、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委託者の指定する証券会社または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ③収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

- ④前項および第47条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第47条 償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- ②一部解約金は、第49条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。

- ③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。

- ④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第48条 受益者が、信託終了による償還金について第47条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

- 第49条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、一部解約の実行の請求日が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、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。
- ②平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。
- ⑦委託者は、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、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第51条の規定を準用するものとします。

<質権口記載又は記録の受益権の取り扱い>

- 第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

- 第51条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ②委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑥第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場

合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第52条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第56条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第53条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第56条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第54条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第55条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第56条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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

<信託約款の変更>

第56条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、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け出ます。

②委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公告>

第58条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

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

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第59条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第60条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条から第15条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日

(信託契約締結日)

委託者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

約 款

追加型証券投資信託
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型
約 款

運用の基本方針

約款第17条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券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。

(2) 投資態度

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

2) 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、当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目指して運用します。

(注) 当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TOPIX（東証株価指数、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）、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、当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。

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及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変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

6) 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。）を行うことができます。

7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 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) 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。
- 3) 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) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 5) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 6) 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。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第22条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第23条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡し取引および為替先渡し取引は、約款第24条の範囲で行います。
- 10) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（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

委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者としみずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

<信託の目的、金額および限度額>

第3条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができるものとします。

③追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

④委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第49条第7項、第51条第1項、第52条第1項、第53条第1項および第55条第2項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

<受益権の分割および再分割>

第5条 委託者は、第3条第1項による受益権について100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

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

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

- ③第30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時の異なる受益権の内容>

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

- ③委託者は、第5条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

- ④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

<受益権の設定に係る受託者の通知>

第11条 受託者は、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係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

<受益権の申込み単位、価額および手数料>

第12条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第5条第1項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日が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、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- ②第1項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ③第1項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第4項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1口につき1円に、第4項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については1口につき1円とします。）に乗じて得た額とします。
- ⑤前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第46条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第40条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

- 第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、
- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、
 - ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

<受益権の譲渡の対抗要件>

- 第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

- 第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとし、

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

- イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第16条 委託者は、信託金を主として第1号から第4号までのアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託(以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。)の受益証券ならびに第5号以降の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
2. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. 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(新株引受権証書と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
10. 特定目的会社に係る特定社債券(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. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(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. 特定目的会社に係る優先出資証券(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、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 証券投資信託または外国証券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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の60を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の60を超えることとなった場合には、これを調整します。

⑤委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の15を超えることとなる投資の指図をしません。

⑦前3項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<運用の基本方針>

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第18条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第19条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<同一銘柄の転換社債等への投資制限>

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第20条の2 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<信用取引の指図範囲>

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

- ②前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

<先物取引等の運用指図・目的・範囲>

第22条 委託者は、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、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとし、（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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

②委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。

③委託者は、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係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「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て、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係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、かつ本条で規定する全オプション取引に係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。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、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。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係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係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。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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。
- ⑤スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- ⑥委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、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。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係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係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係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係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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係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係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。

- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係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係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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、委託者は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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。
- ⑦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。
- ⑧委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第24条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

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

- 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<公社債の空売りの指図範囲>

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

<公社債の借入れ>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ②前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債

の一部を返還するための指図をするものとします。

④第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

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

<外国為替予約の指図>

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

②前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

③前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

- 第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- ②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
 - ③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
 - ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

- 第35条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

- 第36条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

- 第37条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ②一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
 - ③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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 - ④借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

- 第38条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

- 第39条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ②信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
 - ③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを

定めます。

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、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。ただし、第1計算期間は平成14年12月13日から平成16年2月25日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

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

<信託財産に関する報告>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

<信託事務の諸費用>

第42条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年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消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで …年10,000分の34
2. 平成17年10月1日から信託終了の日まで …年10,000分の29

- ②前項の信託報酬は、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信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
- ③第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第44条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ②毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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

第45条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金(信託終了時

における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)については第47条第1項に規定する支払開始日まで、一部解約金については第47条第2項に規定する支払日まで、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

<収益分配金の再投資等>

第46条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

- ②委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- ④前項および第47条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第47条 償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- ②一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。
- ③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。
- ④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第48条 受益者が、信託終了による償還金について第47条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託者が受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

第49条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

ただし、一部解約の実行の請求日が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、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の

実行の請求に応じません。

- ②平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。
- ⑦委託者は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第51条の規定を準用するものとします。

<質権口記載又は記録の受益権の取り扱い>

第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

- 第51条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ②委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - ③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
 - ④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
 - ⑤委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - ⑥第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第52条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第56条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第53条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第56条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第54条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第55条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第56条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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

<信託約款の変更>

第56条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、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け出ます。

②委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公告>

第58条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<https://www.am-one.co.jp/>

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

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第59条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第60条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとし、

第2条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条から第15条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとし、

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日 (信託契約締結日)

委託者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

約 款

追加型証券投資信託
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型
約 款

運用の基本方針

約款第17条に基づき委託者が別に定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券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。

(2) 投資態度

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

2) 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%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が55%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、当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目指して運用します。

(注) 当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TOPIX（東証株価指数、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）、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、当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。

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及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変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

5) 信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

6) 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。）を行うことができます。

7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。
- 2) 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。
- 3) 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) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 5) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 6) 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55%以下とします。
- 7) 有価証券先物取引等は約款第22条の範囲で行います。
- 8) スワップ取引は約款第23条の範囲で行います。
- 9) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第24条の範囲で行います。
- 10) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（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

委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

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

. 追加型証券投資信託
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者としみずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

<信託の目的、金額および限度額>

第3条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができるものとします。

③追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

④委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第49条第7項、第51条第1項、第52条第1項、第53条第1項および第55条第2項の規定による信託終了の日または信託契約終了の日までとします。

<受益権の分割および再分割>

第5条 委託者は、第3条第1項による受益権について100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

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

<当初の受益者>

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第5条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

②この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

- ③第30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時の異なる受益権の内容>

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

- ③委託者は、第5条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

- ④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

<受益権の設定に係る受託者の通知>

第11条 受託者は、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係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

<受益権の申込み単位、価額および手数料>

第12条 委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、第5条第1項の規定により分割される受益権を、別に定める契約を結んだ受益権取得申込者に限り、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

ただし、取得申込日が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、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、受益権の取得申込みに応じません。

- ②第1項の取得申込者は委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ③第1項の受益権の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第4項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る当該価額は、1口につき1円に、第4項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④前項に規定する手数料の額は、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結前の取得申込については1口につき1円とします。）に乗じて得た額とします。
- ⑤前各項の規定にかかわらず、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第46条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第40条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得の申込みの受け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

- 第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、
- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、
 - ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

<受益権の譲渡の対抗要件>

- 第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<投資の対象とする資産の種類>

- 第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとし、

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

- イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第16条 委託者は、信託金を主として第1号から第4号までのアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託(以下、それぞれを総称し「マザーファンド」といいます。)の受益証券ならびに第5号以降の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
2. 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
3. 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
4. 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
5. 株券または新株引受権証券
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. 特定目的会社に係る特定社債券(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. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(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. 特定目的会社に係る優先出資証券(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、第5号から第15号までの証券または証書の性質を有するもの
17. 証券投資信託または外国証券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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ②委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④委託者は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の80以上となる投資の指図しません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の80以上となった場合には、これを調整します。
- ⑤委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の15を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑦前3項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該投資信託証券、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<運用の基本方針>

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

- 第18条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ②前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとし、

<同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限>

第19条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜同一銘柄の転換社債等への投資制限＞

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であつ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。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第20条の2 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

＜信用取引の指図範囲＞

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

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

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

＜先物取引等の運用指図・目的・範囲＞

第22条 委託者は、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、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号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、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

②委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことの指図をすることができます。

③委託者は、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係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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第16条第2項第1号から第4号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係る利払金および償還金等ならびに第16条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「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係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、かつ本条で規定する全オプション取引に係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。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、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。

- ②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係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係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。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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。
- ⑤スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- ⑥委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、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。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係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係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産に係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係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下本項において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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係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係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。

- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産に係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係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、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、委託者は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥前項においてマザーファンドの信託財産に係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係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。
- ⑦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。
- ⑧委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第24条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付けの指図および範囲>

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

- 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<公社債の空売りの指図範囲>

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

<公社債の借入れ>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ②前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産

総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

<外貨建資産への投資制限>

第28条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の55を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の55を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<特別の場合の外貨建有価証券への投資制限>

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

<外国為替予約の指図>

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

②前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

③前項においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

<保管業務の委任>

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

<有価証券の保管>

第32条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

<混蔵寄託>

第33条 金融機関または証券会社(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるも

のとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第34条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

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

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

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

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

第35条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

第36条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

第37条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

③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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

第38条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

第39条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

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

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

<信託の計算期間>

第40条 この信託の計算期間は、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。ただし、第1計算期間は平成14年12月13日から平成16年2月25日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

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

<信託財産に関する報告>

第41条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

<信託事務の諸費用>

第42条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②信託財産の財務諸表監査に要する費用は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて計算し、毎年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消費税等相当額とともに信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第43条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第40条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に定める率を乗じて得た額とします。

1. 信託契約締結日から平成17年9月30日まで …年10,000分の37
2. 平成17年10月1日から信託終了の日まで …年10,000分の32

- ②前項の信託報酬は、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信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。
- ③第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

<収益の分配方式>

第44条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時は、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ②毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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

第45条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第47条第1項に規定する支払開始日まで、一部解約金については第47条第2項に規定する支払日まで、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

<収益分配金の再投資等>

第46条 収益分配金は、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

②委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

④前項および第47条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

<償還金および一部解約金の支払い>

第47条 償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する証券会社または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

②一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として6営業日目から当該受益者に支払います。

③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとします。

④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

<償還金の時効>

第48条 受益者が、信託終了による償還金について第47条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託者が受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<信託契約の一部解約>

第49条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

ただし、一部解約の実行の請求日が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

ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、英国証券取引所の休業日に該当する場合は、一部解約の実行の請求に応じません。

- ②平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするとき、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となるのが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第4項の規定に準じて算出した価額とします。
- ⑦委託者は、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第51条の規定を準用するものとします。

<質権口記載又は記録の受益権の取り扱い>

第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託契約の解約>

- 第51条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ②委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - ③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
 - ④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
 - ⑤委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - ⑥第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第52条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第56条の規定に従います。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第53条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第56条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第54条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する営業を承継させることがあります。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第55条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は第56条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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

<信託約款の変更>

第56条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、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け出ます。

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

<反対者の買取請求権>

第57条 第51条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第51条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公告>

第58条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

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

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第59条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第60条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 平成18年12月29日現在の信託約款第10条、第11条、第13条から第15条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

第3条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第24条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成14年12月13日 (信託契約締結日)

委託者 興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

親投資信託
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
- 6) 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- 4) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 5) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

親投資信託
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第16条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

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

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

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

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

親投資信託
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3) 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
- 4) 有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 5) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- 6) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。
- 2) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 4) 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 5) 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 6) 有価証券先物取引等は約款第18条の範囲で行います。
- 7) スワップ取引は約款第19条の範囲で行います。
- 8) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第20条の範囲で行います。
- 9) 外国為替予約取引は約款第24条の範囲で行いません。
- 10) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 11) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

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

親投資信託
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

約款

運用の基本方針

約款第15条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

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

- 8) 外国為替予約取引は約款24条の範囲で行ないます。
- 9) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 10) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。