

DIAMDC バランスインデックスファンド

DIAMDC バランス30インデックスファンド DIAMDC バランス50インデックスファンド
DIAMDC バランス70インデックスファンド

追加型投信／内外／資産複合（インデックス型）

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

各ファンドは、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、基本アロケーションによる合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

当作成対象期間につきましても、これに沿った運用を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

作成対象期間 2020年2月26日～2021年2月25日

| 第14期 | | 決算日：2021年2月25日 |
|-------------------------|----------|----------------|
| 第14期末（2021年2月25日） | | |
| DIAMDC バランス30インデックスファンド | | |
| 基準価額 | 14,732円 | |
| 純資産総額 | 4,946百万円 | |
| 第14期 | 騰落率 | 4.8% |
| | 分配金合計 | 0円 |
| DIAMDC バランス50インデックスファンド | | |
| 基準価額 | 15,834円 | |
| 純資産総額 | 9,692百万円 | |
| 第14期 | 騰落率 | 10.3% |
| | 分配金合計 | 0円 |
| DIAMDC バランス70インデックスファンド | | |
| 基準価額 | 16,441円 | |
| 純資産総額 | 6,631百万円 | |
| 第14期 | 騰落率 | 14.4% |
| | 分配金合計 | 0円 |

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

当ファンドは投資信託約款において、運用報告書（全体版）を電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書（全体版）は、下記のホームページにアクセスし、「基準価額一覧」等から当ファンドの名称を選択いただき、ファンドの詳細ページから閲覧、ダウンロードすることができます。また、運用報告書（全体版）は受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

■運用報告書に関するお問い合わせ先

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）

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

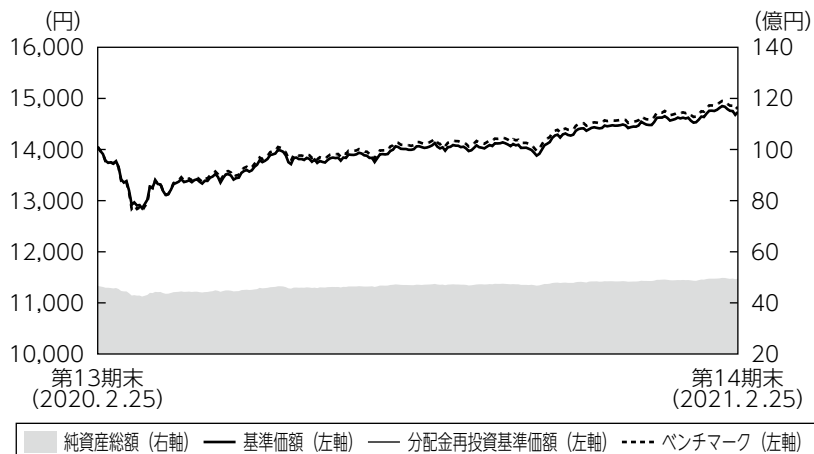
アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2 <http://www.am-one.co.jp/>

運用経過の説明

D I A M D C バランス30インデックスファンド

基準価額等の推移



第14期首： 14,053円
 第14期末： 14,732円
 (既払分配金0円)
 騰落率： 4.8%
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。なお、ベンチマークについては後掲の＜当ファンドのベンチマークについて＞をご参照ください。

基準価額の主な変動要因

期初は新型コロナウイルスの影響長期化やそれに伴う景気減速などが懸念されましたが、その後の世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、期末にかけてのワクチン開発や接種の進展等から景気回復への期待を好感した内外の株式市場は上昇しました。また、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場が上昇したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 22.0% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △2.5% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 17.2% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1.8% |

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第14期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | (2020年2月26日 ～2021年2月25日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 37円 | 0.264% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,985円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (14) | (0.099) | |
| (販売会社) | (18) | (0.132) | |
| (受託会社) | (5) | (0.033) | |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.001) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.008 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保管費用) | (0) | (0.002) | |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | |
| (その他) | (0) | (0.003) | |
| 合計 | 38 | 0.274 | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

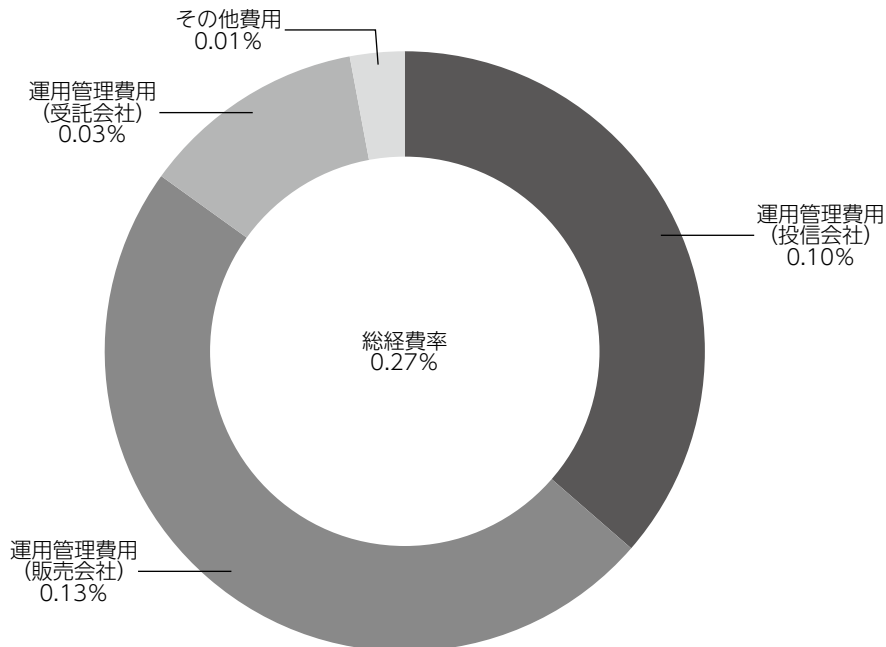
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.27%です。



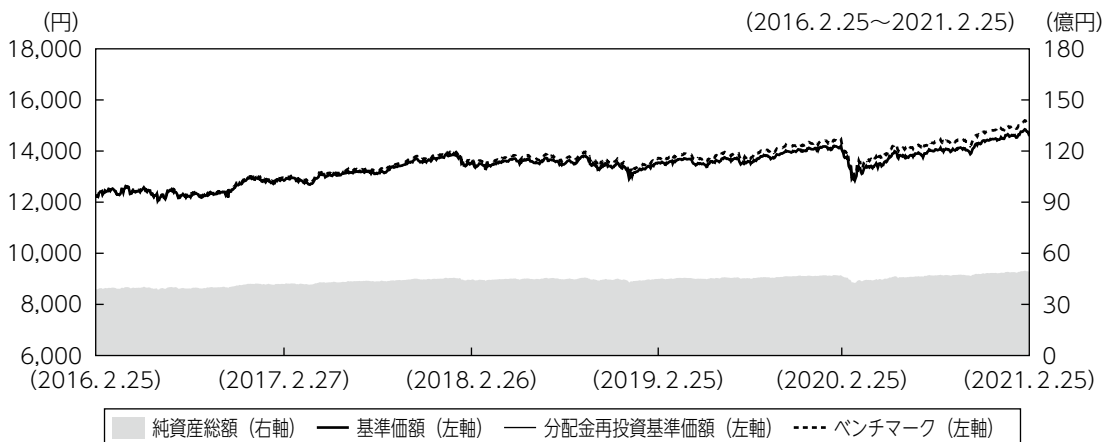
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

最近5年間の基準価額等の推移

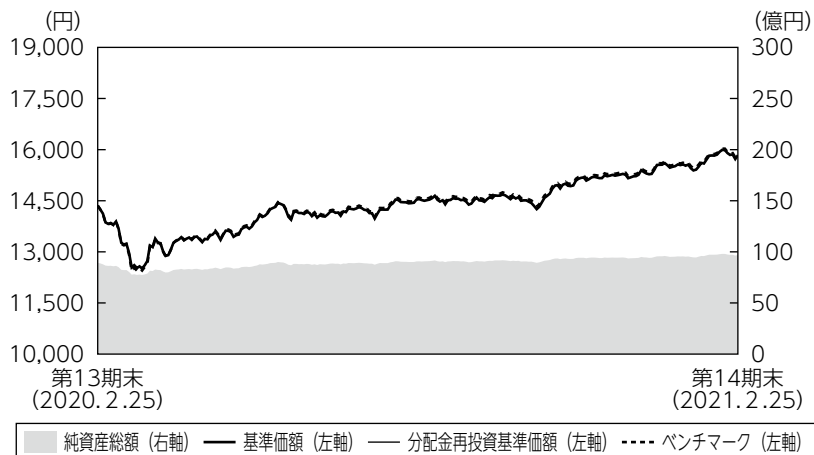


- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、2016年2月25日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2016年2月25日 期首 | 2017年2月27日 決算日 | 2018年2月26日 決算日 | 2019年2月25日 決算日 | 2020年2月25日 決算日 | 2021年2月25日 決算日 |
|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落) (円) | 12,197 | 12,846 | 13,537 | 13,547 | 14,053 | 14,732 |
| 期間分配金合計 (税引前) (円) | — | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | — | 5.3 | 5.4 | 0.1 | 3.7 | 4.8 |
| ベンチマークの騰落率 (%) | — | 5.9 | 5.7 | 0.5 | 4.1 | 5.5 |
| 純資産総額 (百万円) | 3,872 | 4,191 | 4,448 | 4,498 | 4,666 | 4,946 |

D I A M D C バランス50インデックスファンド

基準価額等の推移



- (注1) 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。なお、ベンチマークについては後掲の〈当ファンドのベンチマークについて〉をご参照ください。

基準価額の主な変動要因

期初は新型コロナウイルスの影響長期化やそれに伴う景気減速などが懸念されましたが、その後の世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、期末にかけてのワクチン開発や接種の進展等から景気回復への期待を好感した内外の株式市場は上昇しました。また、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場が上昇したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 22.0% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △2.5% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 17.2% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1.8% |

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第14期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|----------------------------------------------------------------------|
| | (2020年2月26日 ～2021年2月25日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 43円 | 0.297% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,417円です。 |
| (投信会社) | (17) | (0.115) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (21) | (0.148) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社) | (5) | (0.033) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.002 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.002) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.010 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (0) | (0.002) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| (その他) | (1) | (0.004) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 45 | 0.310 | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

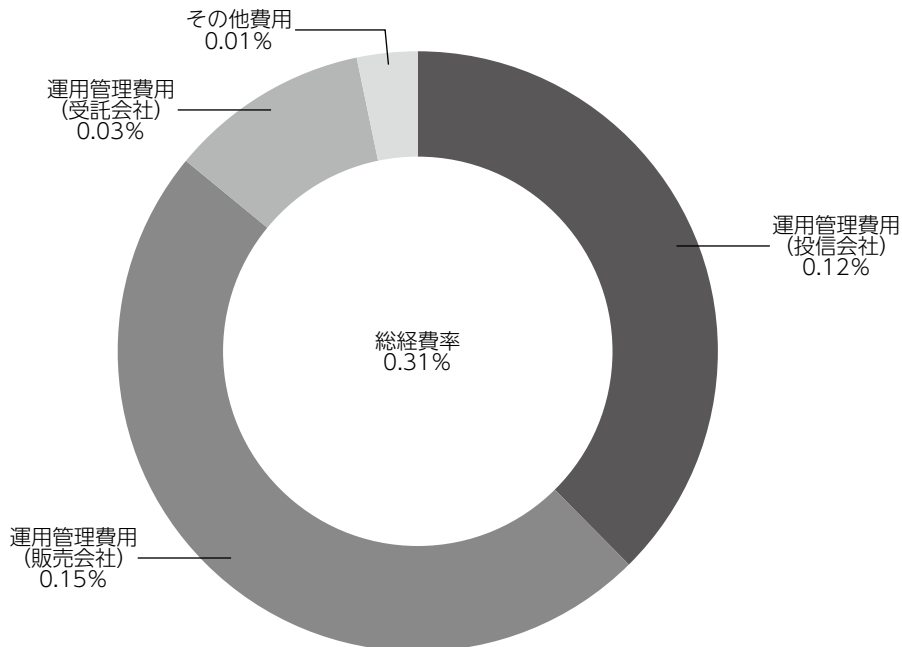
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.31%です。



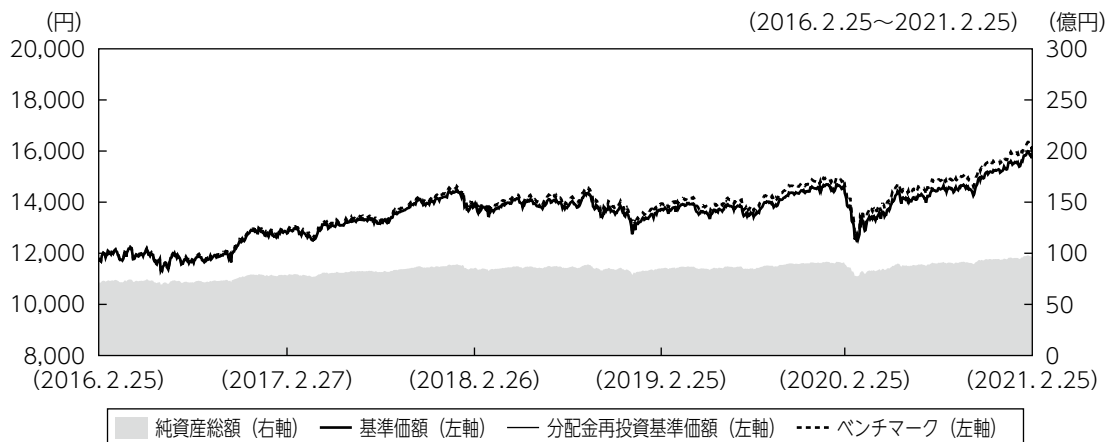
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

最近5年間の基準価額等の推移

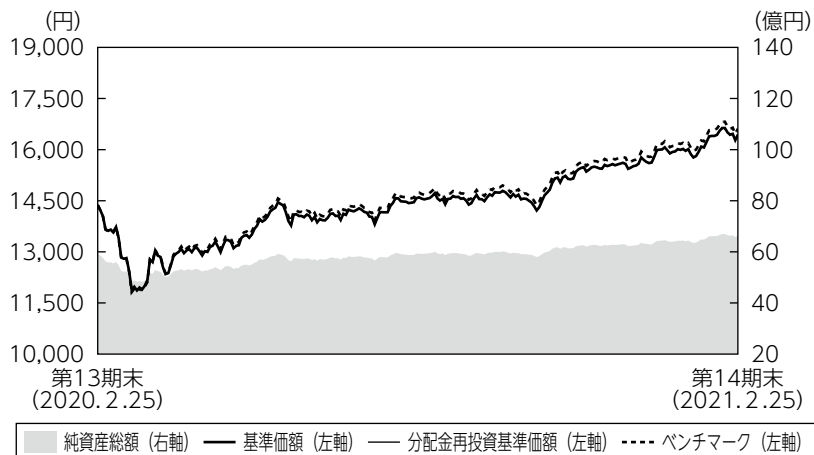


- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、2016年2月25日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2016年2月25日 期首 | 2017年2月27日 決算日 | 2018年2月26日 決算日 | 2019年2月25日 決算日 | 2020年2月25日 決算日 | 2021年2月25日 決算日 |
|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落) (円) | 11,681 | 12,776 | 13,878 | 13,729 | 14,358 | 15,834 |
| 期間分配金合計 (税引前) (円) | — | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | — | 9.4 | 8.6 | △1.1 | 4.6 | 10.3 |
| ベンチマークの騰落率 (%) | — | 10.1 | 9.0 | △0.5 | 5.0 | 10.5 |
| 純資産総額 (百万円) | 7,107 | 7,834 | 8,547 | 8,531 | 8,938 | 9,692 |

D I A M D C バランス70インデックスファンド

基準価額等の推移



- (注1) 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。なお、ベンチマークについては後掲の〈当ファンドのベンチマークについて〉をご参照ください。

基準価額の主な変動要因

期初は新型コロナウイルスの影響長期化やそれに伴う景気減速などが懸念されましたが、その後の世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、期末にかけてのワクチン開発や接種の進展等から景気回復への期待を好感した内外の株式市場は上昇しました。また、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場が上昇したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 22.0% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △2.5% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 17.2% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1.8% |

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第14期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | (2020年2月26日 ～2021年2月25日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 48円 | 0.330% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,434円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (19) | (0.132) | |
| (販売会社) | (24) | (0.165) | |
| (受託会社) | (5) | (0.033) | |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.001) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.002 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.002) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.011 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保管費用) | (0) | (0.002) | |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | |
| (その他) | (1) | (0.005) | |
| 合計 | 50 | 0.345 | |

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

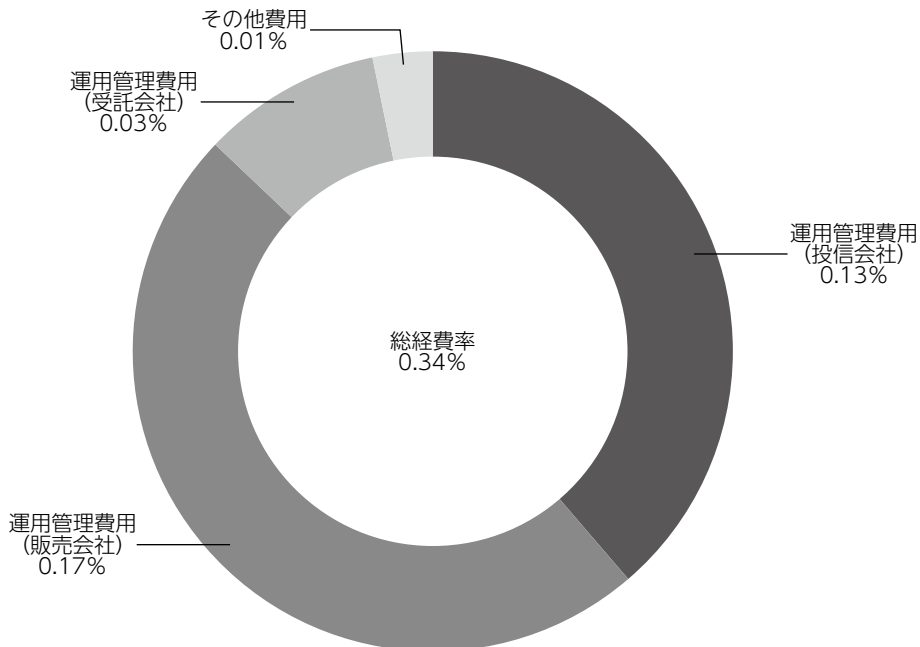
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.34%です。



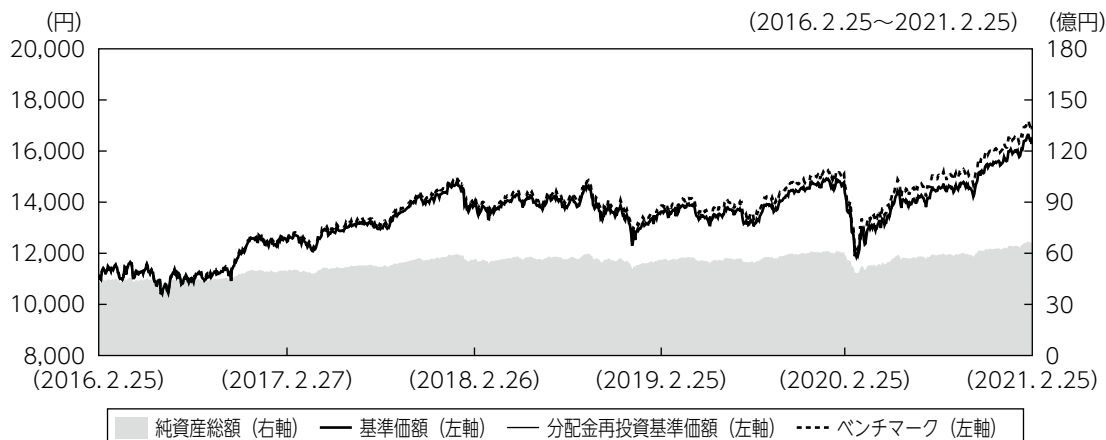
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

最近5年間の基準価額等の推移



- (注1) 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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、2016年2月25日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2016年2月25日 期首 | 2017年2月27日 決算日 | 2018年2月26日 決算日 | 2019年2月25日 決算日 | 2020年2月25日 決算日 | 2021年2月25日 決算日 |
|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落) (円) | 10,985 | 12,455 | 13,935 | 13,629 | 14,374 | 16,441 |
| 期間分配金合計 (税引前) (円) | — | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | — | 13.4 | 11.9 | △2.2 | 5.5 | 14.4 |
| ベンチマークの騰落率 (%) | — | 14.2 | 12.4 | △1.6 | 6.0 | 15.6 |
| 純資産総額 (百万円) | 4,274 | 4,943 | 5,654 | 5,626 | 5,913 | 6,631 |

投資環境

国内株式市場は、期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続やワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

国内債券市場は下落しました。期初は新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり、利回りは低下（価格は上昇）したものの、2020年3月にリスク性資産の価格が反発したことを受けて利回りは上昇（価格は下落）しました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月から期末にかけては国内株式市場が堅調に推移したことや米長期金利が上昇したことを受けて利回りは上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。米国株式市場は期初から新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により急落しましたが、2020年3月下旬以降は米景気対策法案への期待などから反発しました。その後も欧米における感染拡大から調整する場面もありましたが、ワクチン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感などを受け堅調に推移しました。欧州株式市場は急落後の反発力に欠ける市場もあり、前期末比では各国市場まちまちの値動きとなりました。

外国債券市場では、米国債の利回りは低下しました。一方、ドイツ債の利回りは上昇しました。米国債利回りは新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてFRB（米連邦準備理事会）による緊急利下げや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチンへの期待を受けて利回りが上昇傾向となりました。ドイツ債についてはワクチンへの期待を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では、主要通貨に対してまちまちな動きとなりました。米ドル/円相場は、期初は新型コロナウイルスの感染拡大を受けたリスク回避の動きや世界的なドル需要の高まりが交錯し相場が振れた後、米中対立への警戒や金融緩和の長期化観測、先々の景気不透明感等から円高米ドル安の動きとなりました。ユーロ/円相場については欧州復興基金設立への期待等により2020年5月以降は円安ユーロ高の動きとなりました。英ポンドやその他主要通貨に対しては前期末比で円安となりました。

■ ポートフォリオについて

各ファンドでは、以下の基本アロケーションによる合成インデックスに概ね連動した投資成果をめざし、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行いました。

<基本アロケーション>

D I A M D C バランス30インデックスファンド：国内株式20%、国内債券52%、外国株式10%、外国債券15%、短期金融資産3%

D I A M D C バランス50インデックスファンド：国内株式35%、国内債券30%、外国株式15%、外国債券17%、短期金融資産3%

D I A M D C バランス70インデックスファンド：国内株式50%、国内債券7%、外国株式20%、外国債券20%、短期金融資産3%

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークである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）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

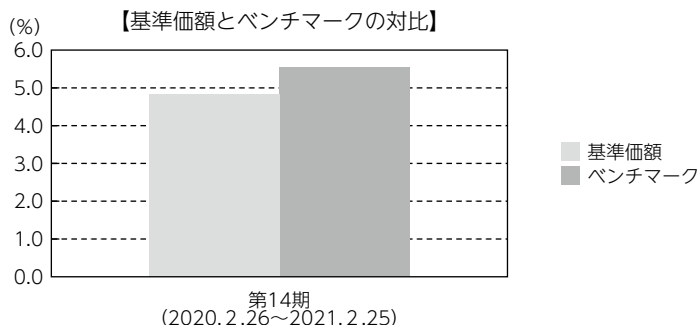
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

D I A M D C バランス30インデックスファンド

■ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で5.5%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.7%と、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

■分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳(1万口当たり)

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2020年2月26日 ～2021年2月25日 |
| 当期分配金(税引前) | －円 |
| 対基準価額比率 | －% |
| 当期の収益 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 5,153円 |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金(税引前)」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

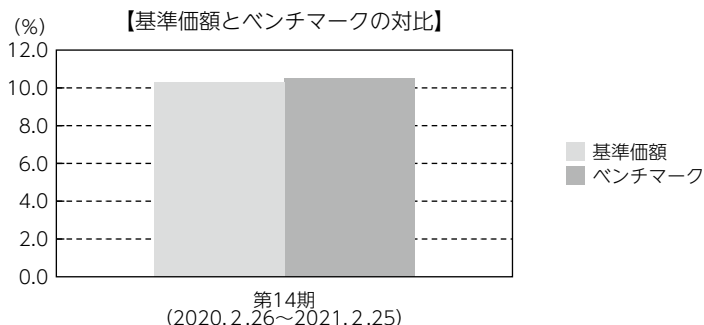
(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益(含、評価益)」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

DIAM DC バランス50インデックスファンド

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で10.5%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%と、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配原資の内訳(1万口当たり)

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2020年2月26日 ~2021年2月25日 |
| 当期分配金(税引前) | -円 |
| 対基準価額比率 | -% |
| 当期の収益 | -円 |
| 当期の収益以外 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 6,861円 |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金(税引前)」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

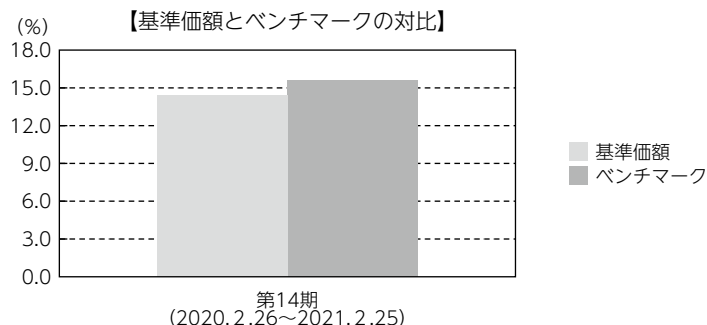
(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益(含、評価益)」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

D I A M D C バランス70インデックスファンド

■ ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で15.6%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△1.2%のパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

■ 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■ 分配原資の内訳(1万口当たり)

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2020年2月26日 ~2021年2月25日 |
| 当期分配金(税引前) | -円 |
| 対基準価額比率 | -% |
| 当期の収益 | -円 |
| 当期の収益以外 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 8,159円 |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金(税引前)」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益(含、評価益)」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

各ファンドでは、合成インデックスに概ね連動した投資成果が得られるよう、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行います。

- 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。
- 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。
- 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
引き続き、ベンチマークに連動したファンドパフォーマンスをめざします。
- 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
引き続き、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

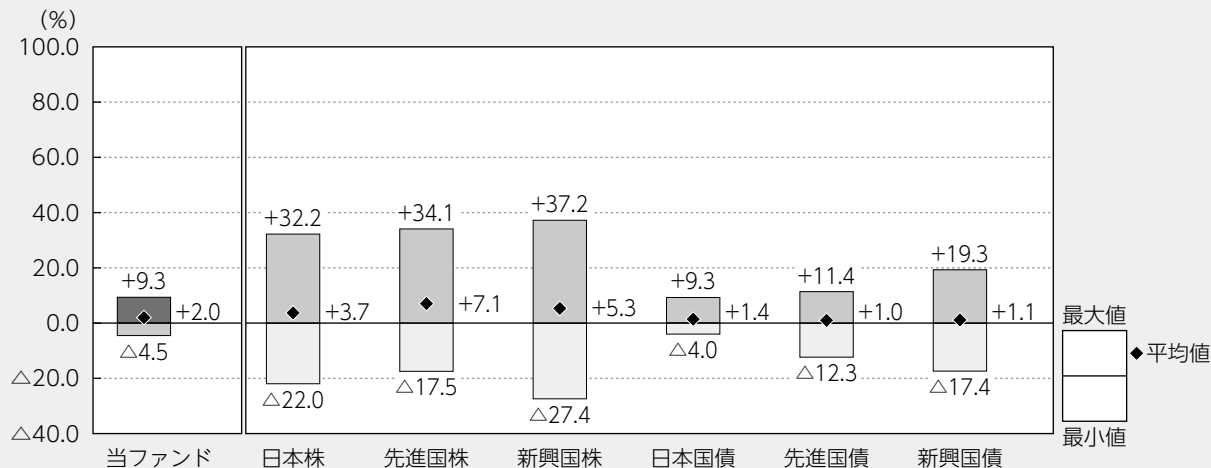
当ファンドの概要

| | | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合（インデックス型） | |
| 信託期間 | 2006年12月27日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 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。 | |
| 主要投資対象 | ベビーファンド* | 以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。 |
| | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 海外の株式を主要投資対象とします。 |
| | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 海外の公社債を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | マザーファンド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。 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。 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。 実質組入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。 | |
| 分配方針 | 決算日（原則として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。）等から基準価額水準、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。 | |

*ベビーファンドとは、D I A M D C バランス30インデックスファンド、D I A M D C バランス50インデックスファンド、D I A M D C バランス70インデックスファンドです。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較

DIAMDC バランス30インデックスファンド



2016年2月～2021年1月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 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。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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)

日本国債…NOMURA-BPI国債

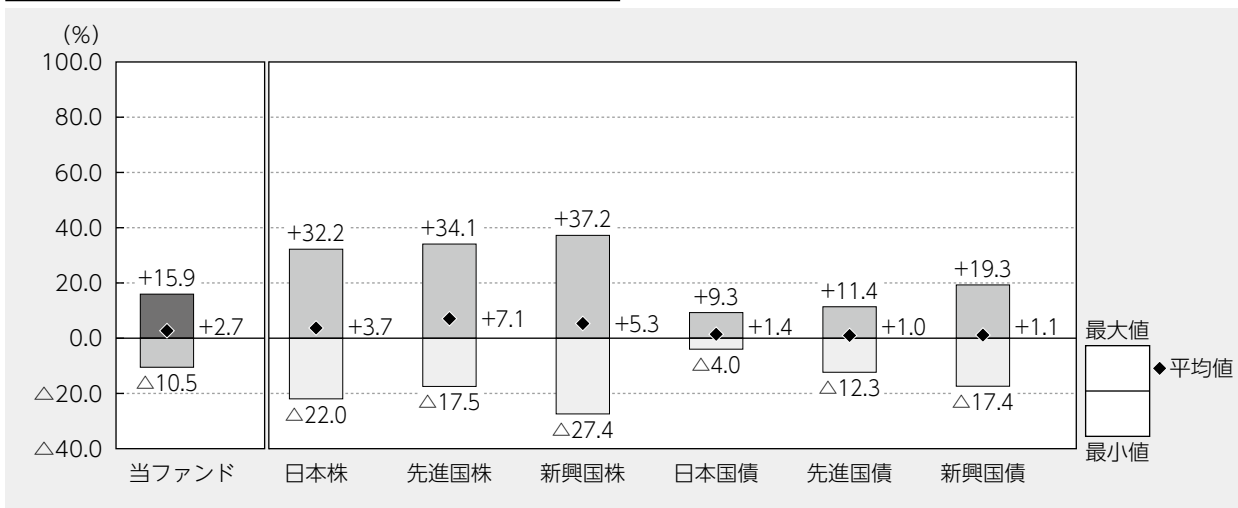
先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)

(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。

※各指数については後掲の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

DIAMDC バランス50インデックスファンド



2016年2月～2021年1月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 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。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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)

日本国債…NOMURA-BPI国債

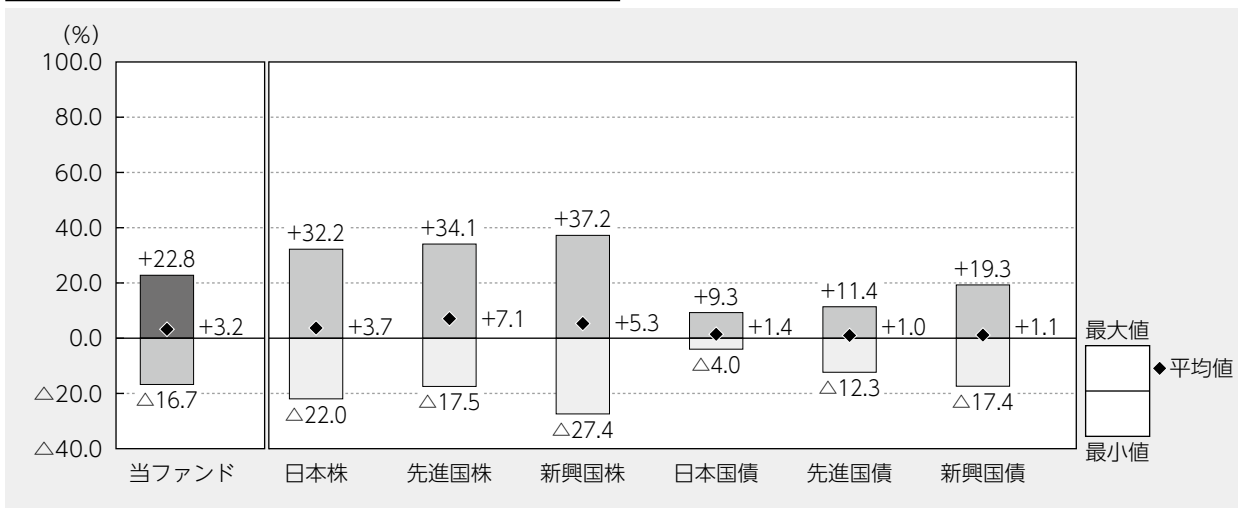
先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)

(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。

*各指数については後掲の<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>をご参照ください。

DIAMDC バランス70インデックスファンド



2016年2月～2021年1月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 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。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しています。

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

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)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド (円ベース)

(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。

※各指数については後掲の<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>をご参照ください。

当ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容 (2021年2月25日現在)

D I A M D C バランス30インデックスファンド

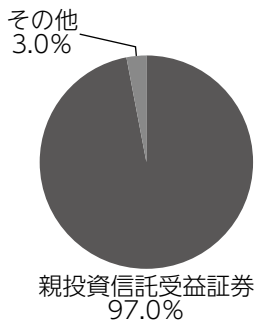
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

| | 当期末 |
|------------------------------|------------|
| | 2021年2月25日 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 51.0% |
| 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド | 20.7 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 14.5 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 10.8 |
| その他 | 3.0 |

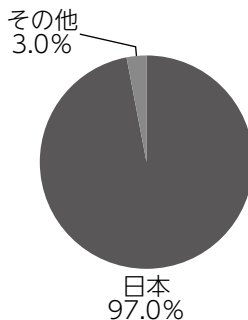
(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

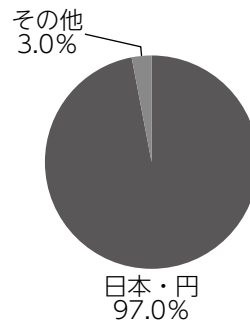
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

純資産等

| 項目 | 当期末 |
|------------|----------------|
| | 2021年2月25日 |
| 純資産総額 | 4,946,061,131円 |
| 受益権総口数 | 3,357,314,515口 |
| 1万口当たり基準価額 | 14,732円 |

(注) 当期中における追加設定元本額は453,091,880円、同解約元本額は416,139,596円です。

組入ファンドの概要については、26ページ以降をご覧ください。

DIAMDC バランス50インデックスファンド

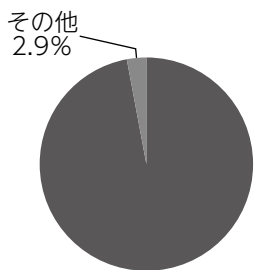
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

| | 当期末 |
|-----------------------------|------------|
| | 2021年2月25日 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 36.8% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 28.1 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 16.4 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 15.7 |
| その他 | 2.9 |

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

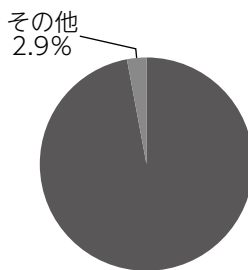
(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

◆資産別配分



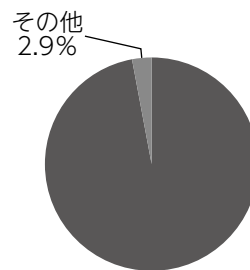
親投資信託受益証券
97.1%

◆国別配分



日本
97.1%

◆通貨別配分



日本・円
97.1%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

純資産等

| 項目 | 当期末 |
|------------|----------------|
| | 2021年2月25日 |
| 純資産総額 | 9,692,477,455円 |
| 受益権総口数 | 6,121,173,640口 |
| 1万口当たり基準価額 | 15,834円 |

(注) 当期中における追加設定元本額は460,563,926円、同解約元本額は564,773,432円です。

組入ファンドの概要については、26ページ以降をご覧ください。

DIAMDC バランス70インデックスファンド

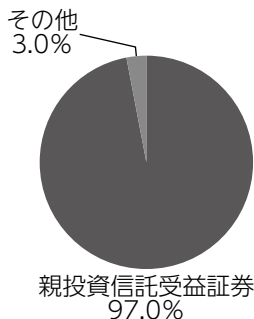
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

| | 当期末 |
|-----------------------------|------------|
| | 2021年2月25日 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 50.9% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 21.0 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 18.9 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 6.2 |
| その他 | 3.0 |

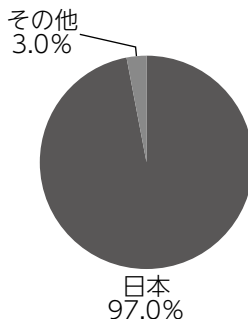
(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

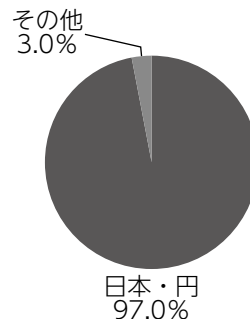
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

純資産等

| 項目 | 当期末 |
|------------|----------------|
| | 2021年2月25日 |
| 純資産総額 | 6,631,987,116円 |
| 受益権総口数 | 4,033,813,214口 |
| 1万口当たり基準価額 | 16,441円 |

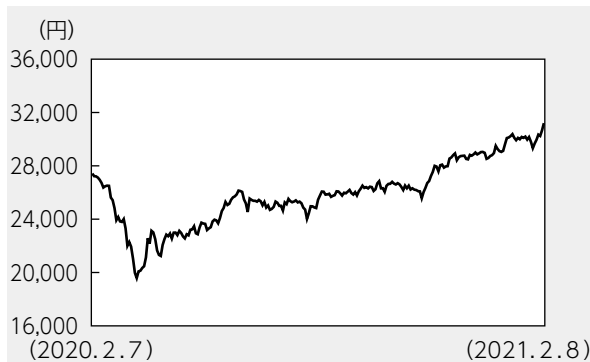
(注) 当期中における追加設定元本額は445,535,191円、同解約元本額は525,978,103円です。

組入ファンドの概要については、26ページ以降をご覧ください。

組入ファンドの概要

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド】（計算期間 2020年2月8日～2021年2月8日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄（現物）

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|---------|------|
| トヨタ自動車 | 日本・円 | 3.0% |
| ソニー | 日本・円 | 2.8 |
| ソフトバンクグループ | 日本・円 | 2.7 |
| キーエンス | 日本・円 | 2.1 |
| 任天堂 | 日本・円 | 1.3 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本・円 | 1.3 |
| 日本電産 | 日本・円 | 1.3 |
| リクルートホールディングス | 日本・円 | 1.3 |
| 信越化学工業 | 日本・円 | 1.2 |
| 日本電信電話 | 日本・円 | 1.2 |
| 組入銘柄数 | 2,183銘柄 | |

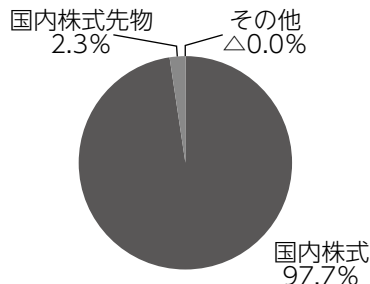
◆1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | |
|-------------|-----|---------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) 売買委託手数料 | 0円 | 0.001% |
| (株式) | (0) | (0.000) |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) |
| 合計 | 0 | 0.001 |

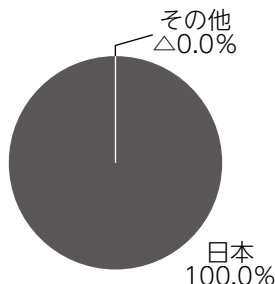
◆組入上位銘柄（先物）

| 銘柄名 | 売買 | 比率 |
|----------|-----|------|
| TOPIX 先物 | 買建 | 2.3% |
| 組入銘柄数 | 1銘柄 | |

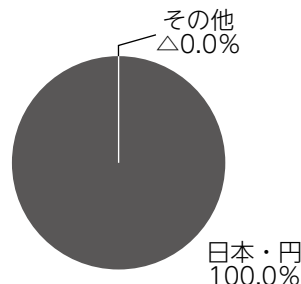
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 1万口当たりの費用明細の金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（25,909円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については2ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄・資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

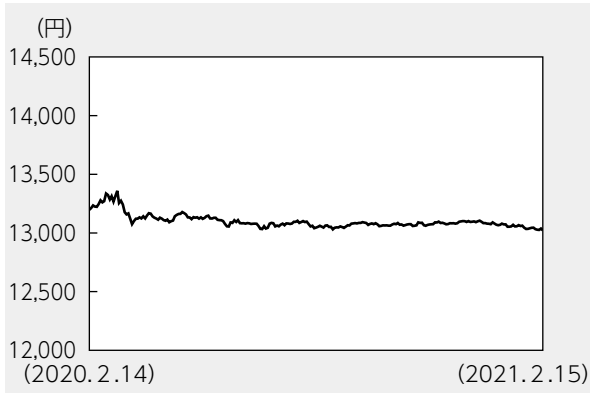
(注5) 国別配分、通貨別配分については、現物と先物の比率を合計して表示しています。

(注6) その他は、純資産総額を100%として、現物と先物の比率を差し引いたものです。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注7) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド】（計算期間 2020年2月15日～2021年2月15日）

◆基準価額の推移



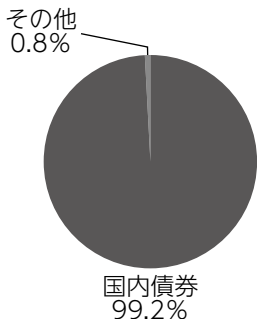
◆組入上位10銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|---------------------|-------|------|
| 3 2 3回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 1.2% |
| 3 3 9回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 1.1 |
| 3 4 5回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 1.1 |
| 3 3 5回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 1.1 |
| 1 4 4回 利付国庫債券 (5年) | 日本・円 | 1.0 |
| 3 5 0回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 3 4 2回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 1 3 8回 利付国庫債券 (5年) | 日本・円 | 0.9 |
| 1 3 2回 利付国庫債券 (5年) | 日本・円 | 0.9 |
| 3 4 6回 利付国庫債券 (10年) | 日本・円 | 0.9 |
| 組入銘柄数 | 401銘柄 | |

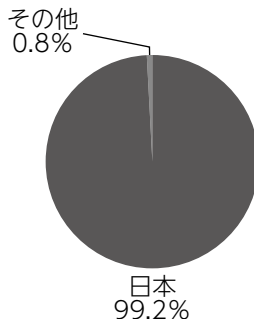
◆1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

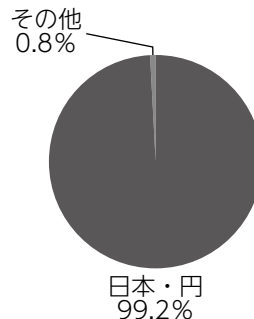
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のもので。

(注2) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

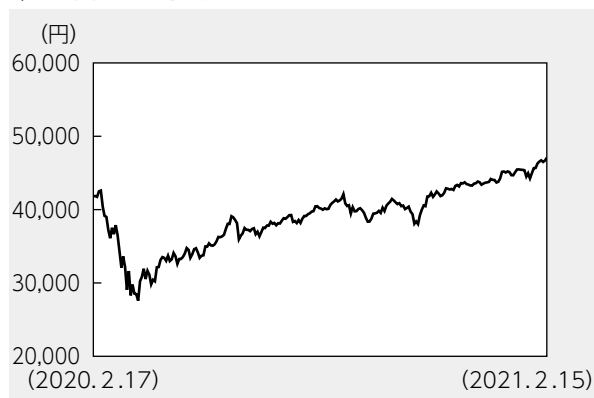
(注3) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注4) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注5) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド】

◆基準価額の推移



(計算期間 2020年2月18日～2021年2月15日)

◆組入上位10銘柄（現物）

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|---------------------|---------|------|
| APPLE INC | アメリカ・ドル | 4.6% |
| MICROSOFT CORP | アメリカ・ドル | 3.5 |
| AMAZON.COM INC | アメリカ・ドル | 2.7 |
| FACEBOOK INC | アメリカ・ドル | 1.3 |
| ALPHABET INC-CL C | アメリカ・ドル | 1.2 |
| ALPHABET INC-CL A | アメリカ・ドル | 1.2 |
| TESLA INC | アメリカ・ドル | 1.2 |
| JOHNSON & JOHNSON | アメリカ・ドル | 0.9 |
| JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ・ドル | 0.8 |
| NVIDIA CORP | アメリカ・ドル | 0.7 |
| 組入銘柄数 | 1,284銘柄 | |

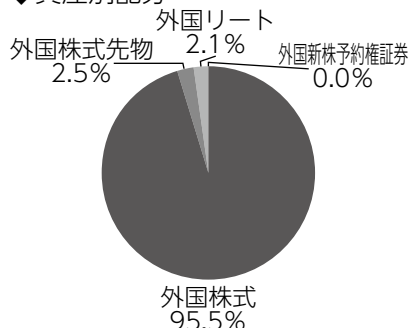
◆1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | |
|-------------|------|---------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) 売買委託手数料 | 1円 | 0.004% |
| (株式) | (1) | (0.002) |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) |
| (先物・オプション) | (1) | (0.002) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投資証券) | (0) | (0.000) |
| (b) 有価証券取引税 | 5 | 0.013 |
| (株式) | (5) | (0.012) |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投資証券) | (0) | (0.000) |
| (c) その他費用 | 9 | 0.024 |
| (保管費用) | (0) | (0.000) |
| (その他) | (9) | (0.024) |
| 合計 | 16 | 0.040 |

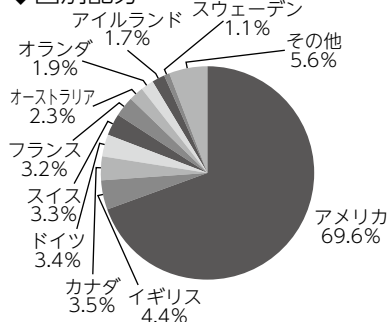
◆組入上位銘柄（先物）

| 銘柄名 | 売買 | 比率 |
|-----------------------|-----|------|
| S&P500 EMINI FUT | 買建 | 1.9% |
| DJ EURO STOXX 50 | 買建 | 0.4 |
| FTSE 100 INDEX FUTURE | 買建 | 0.1 |
| S&P/TSE 60 IX FUT | 買建 | 0.1 |
| SPI 200 FUTURES | 買建 | 0.1 |
| 組入銘柄数 | 5銘柄 | |

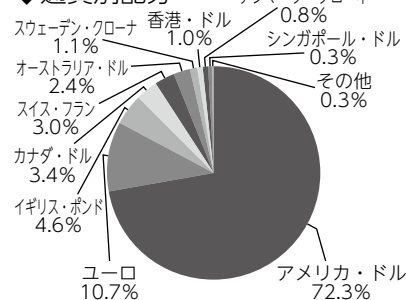
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 1万口当たりの費用明細の金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(39,034円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については2ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 国別配分は発行国(地域)を表示しています。

(注6) 現金等はその他として表示しています。なお、資産別配分については、現金等を考慮しておりません。

(注7) 国別配分・通貨別配分については、上位11位以下をその他に含めて集計しています。

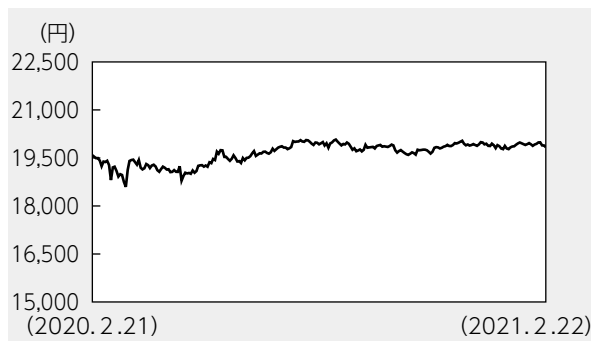
(注8) 国別配分、通貨別配分については、現物と先物の比率を合計して表示しています。

(注9) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド】

(計算期間 2020年2月22日～2021年2月22日)

◆基準価額の推移



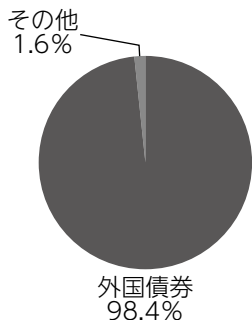
◆組入上位10銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|--------------------------|---------|------|
| US T N/B 2.0 02/15/22 | アメリカ・ドル | 0.7% |
| US T N/B 1.75 03/31/22 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 0.125 01/15/24 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 2.0 11/30/22 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 0.875 11/15/30 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 0.25 11/15/23 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 2.75 11/15/23 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | ユーロ | 0.5 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | アメリカ・ドル | 0.4 |
| US T N/B 1.625 11/15/22 | アメリカ・ドル | 0.4 |
| 組入銘柄数 | 715銘柄 | |

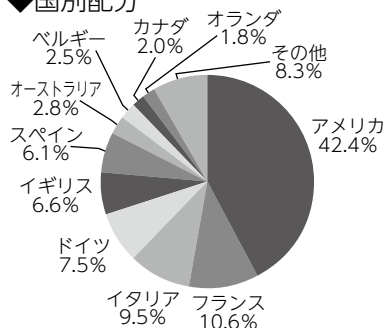
◆1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | |
|------------------------------|------------------|------------------------------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) その他費用 (保管費用) (その他) | 2円 (2) (0) | 0.012% (0.011) (0.001) |
| 合計 | 2 | 0.012 |

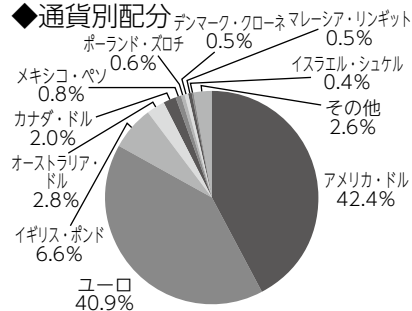
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。

(注2) 1万口当たりの費用明細の金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(19,648円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については2ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

(注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(注6) 国別配分・通貨別配分については上位11位以下をその他に含めて集計しています。

(注7) 国別配分は発行国(地域)を表示しています。

(注8) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

<当ファンドのベンチマークについて>

- 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委託会社が独自に合成したものです。基本アロケーションについては、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。
- 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。
- 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）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TOPIXの商標に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。
- MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、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。
- FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所（株東京証券取引所）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は、(株)東京証券取引所が有しています。
- 「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。
- 「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。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。
- 「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。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」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。

(このページは白紙です)

(このページは白紙です)

