

Oneグローバルバランス

追加型投信／内外／資産複合

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。

当ファンドは、主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券の4つの資産に投資し、公的年金の基本ポートフォリオを考慮しつつ、投資環境分析による各資産の魅力度判定に応じた機動的な変更を行うことで、信託財産の成長をめざします。

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 2021年9月16日～2022年9月16日

第1期	決算日：2022年9月16日	
第1期末 (2022年9月16日)	基準価額	9,842円
	純資産総額	69百万円
第1期	騰落率	△1.6%
	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)

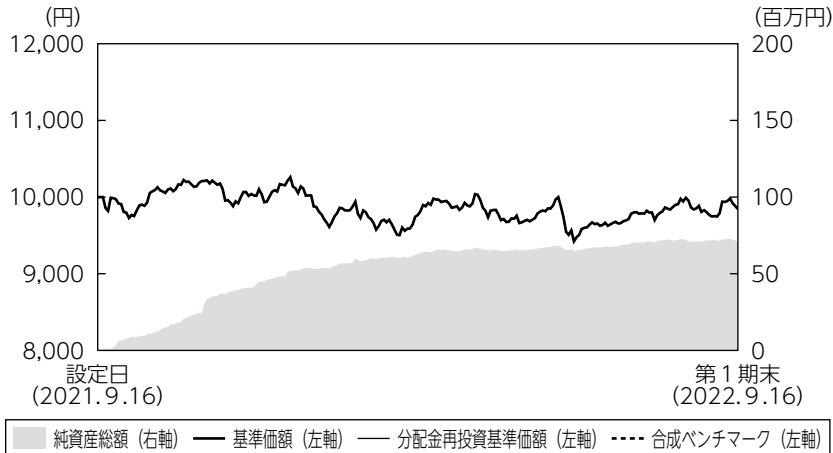
お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

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

基準価額等の推移



第1期首：10,000円

第1期末：9,842円

(既払分配金0円)

騰落率：△1.6%

(分配金再投資ベース)

(注) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

- (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) 基準価額は、設定日前日を10,000円として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000円として指数化しています。
- (注5) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の変動要因

下記の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、外国債券に分散投資を行いました。当期は、新型コロナウイルスの感染急拡大やF R B（米連邦準備理事会）による金融引き締めへの懸念、ウクライナ情勢への懸念等から全ての投資対象資産が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。一方、為替市場で円安が大幅に進んだことは基準価額の上昇要因となりましたが、全体としては基準価額は下落する結果となりました。

◆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	△5.3%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△3.4%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.8%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.8%

1 万口当たりの費用明細

項目	第1期		項目の概要
	(2021年9月16日 ～2022年9月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	112円	1.136%	(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9,865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)	(54)	(0.551)	
(販売会社)	(54)	(0.551)	
(受託会社)	(3)	(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)	(0.001)	
(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	0.004	(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)	(0.004)	
(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	0.014	(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)	(0.005)	
(監査費用)	(0)	(0.004)	
(その他)	(1)	(0.005)	
合計	114	1.155	

(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。

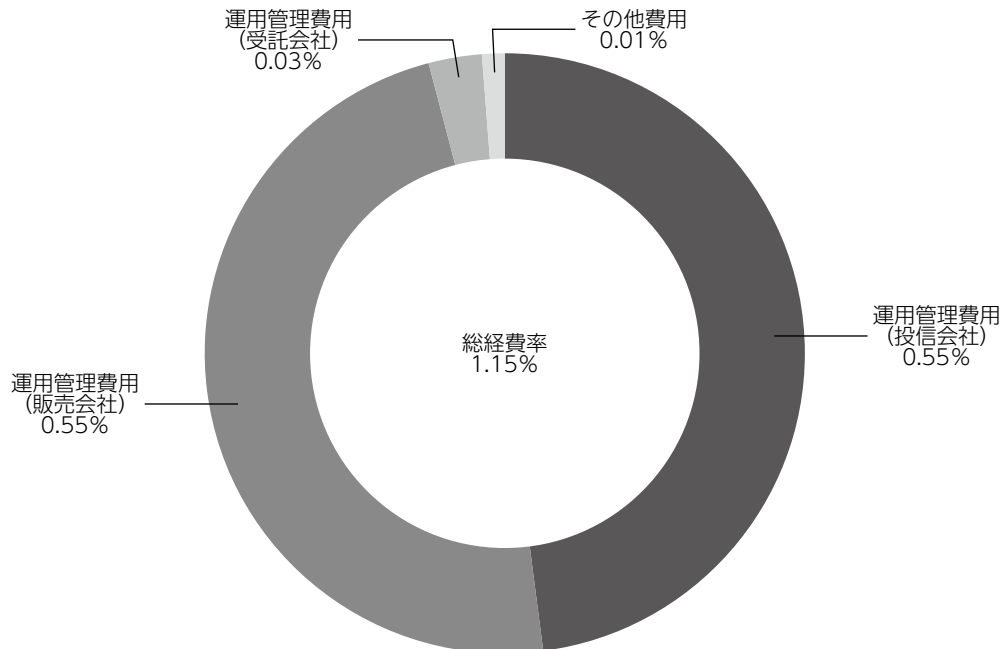
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.15%です。



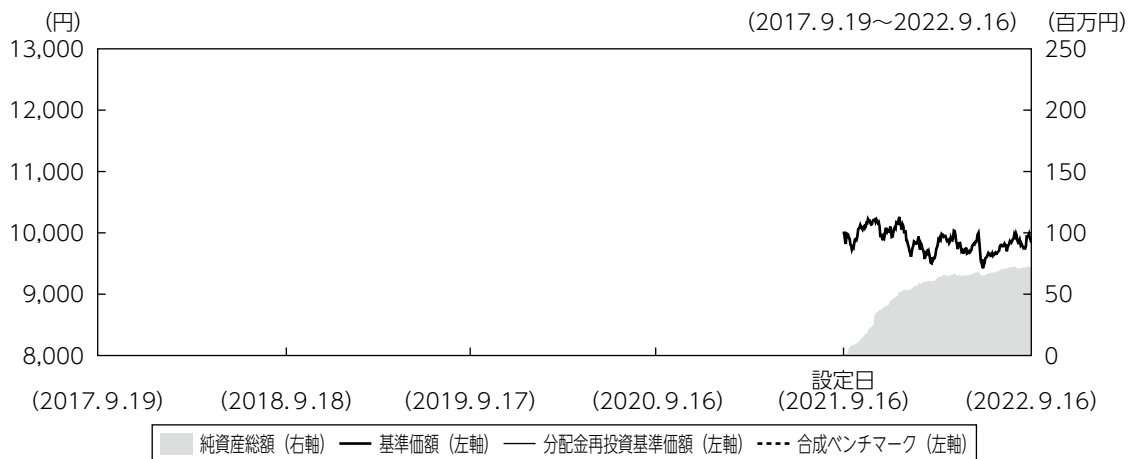
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。

		2021年9月16日 設定日	2022年9月16日 決算日
基準価額 (分配落)	(円)	10,000	9,842
期間分配金合計 (税引前)	(円)	—	0
分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	△1.6
純資産総額	(百万円)	1	69

- (注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。
- (注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

投資環境

国内株式市場は、期初から2022年3月半ばまでは、新型コロナウイルスの新規感染者数の拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を要因として下落しました。その後も、米国での金融引き締め、円安ドル高の進行、インフレ動向、国内の新型コロナウイルスの感染状況やウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2021年12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなりました。2022年に入ると米中央銀行が利上げに着手するとの観測から利回りは上昇（価格は下落）し、期末にかけては欧米の好調な経済指標がインフレ加速を意識させ、利回りは一段と上昇しました。

先進国株式市場は下落しました。2021年10月以降、好調な企業業績を背景に上昇した後、F R Bの資産買い入れ縮小加速への警戒感から不安定な展開となりました。2022年に入ると米国の金融緩和策の急速な転換が懸念され下落しました。3月上旬にかけては、ロシアのウクライナ侵攻が嫌気され下落しました。その後は和平交渉の進展期待から反発しましたが、F R Bがインフレ抑制を目的に断続的な利上げを行ったことが嫌気され調整しました。

先進国債券市場では、米国国債およびドイツ国債の利回りはともに上昇しました。米国国債は、堅調な米雇用統計や、F R Bが金融引き締めを積極的に続けるとの見方、米インフレ率の上振れなどを背景に利回りは上昇しました。ドイツ国債についてもロシアのウクライナへの侵攻や米国長期金利の上昇、E C B（欧州中央銀行）が大幅利上げに踏み切るとの見方などを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では、主要通貨に対して米ドル高、および円安が進みました。F R Bが金融引き締めペースを加速するとの見方などから米国金利が大幅に上昇したことや、米国をはじめ各国の中央銀行が金融政策の積極的な引き締めを進める中、日銀は金融緩和を継続する姿勢を明確に示すなど、金融政策の方向性の違いが意識されたことなどが、米ドル高・円安の主な要因となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

主要投資対象マザーファンドへの投資割合については、公的年金基金の基本ポートフォリオ比率を基本配分比率としつつ、経済・市場環境に基づいた投資環境分析を実施し、基本配分比率から機動的に配分比率を変更しました。当期は、経済判断が下方にシフトしていく中、市場環境が悪化していると判定した局面に内外株式の比率を減少させ、基準価額の下落幅抑制を図りました。

○当期末の資産配分

資産	基本配分比率	組入比率
国内株式	15.0%	15.2%
国内債券	35.0%	34.5%
外国株式	15.0%	15.6%
外国債券	25.0%	25.5%
現金等	10.0%	9.1%

※1 比率は純資産総額に対する割合です。

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

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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NOMUR A-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。

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。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
	2021年9月16日 ～2022年9月16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	24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

当ファンドでは、投資対象マザーファンドについて、公的年金基金の基本ポートフォリオ比率を基本配分比率としつつ、経済・市場環境に基づいて投資環境分析を実施し、基本配分比率から機動的に配分比率を変更することにより、収益の獲得をめざします。

- 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
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、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を概ね一致させることで、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ことをめざしたパッシブ運用を行います。

お知らせ

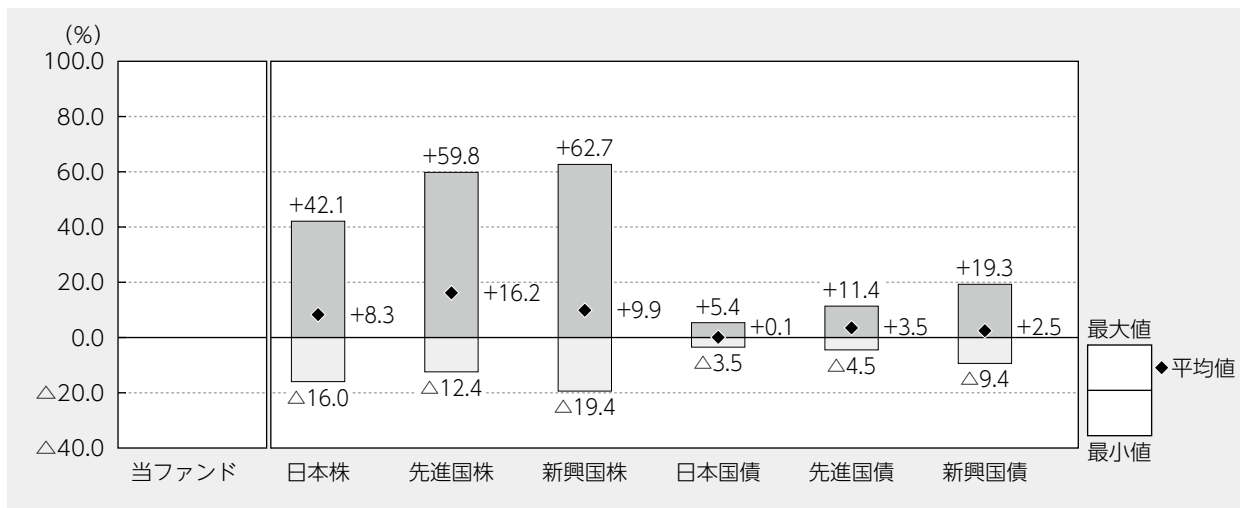
約款変更のお知らせ

- 当ファンドが投資対象とする「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。
(2021年12月21日)
- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。
(2022年3月15日)
- 当ファンドが投資対象とする「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。
(2022年3月15日)
- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「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」に変更しました。
(2022年4月4日)

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2021年9月16日から2031年9月12日までです。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	One グローバルバランス	以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	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。
	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	<p>国内外の株式および公社債に実質的に投資を行います。</p> <p>主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、公的年金が基本ポートフォリオ*で定める資産構成割合や、投資環境分析等を勘案のうえ決定します。</p> <p>(*) 国民年金、厚生年金の積立金を運用している、年金積立金管理運用独立行政法人 (Government Pension Investment Fund 以下「GPIF」といいます。) の基本ポートフォリオです。</p> <p>※当ファンドは、アセットマネジメントOneがGPIFの基本ポートフォリオを考慮しつつ、独自に資産配分比率を決定するものであり、GPIFと何ら関係を有するものではありません。</p> <p>※当ファンドの運用は、GPIFの運用成果に連動することをめざすものではありません。</p> <p>※GPIFの基本ポートフォリオの資産構成が変更される場合や、GPIFの基本ポートフォリオが参照できなくなる場合などは運用方法を変更することがあります。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p>	
分配方針	<p>決算日(原則として9月16日。休業日の場合は翌営業日。)に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の中から、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場合があります。</p>	

代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンド : 2022年8月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス : 2017年9月~2022年8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。

*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（2022年9月16日現在）

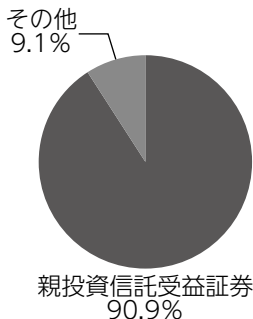
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

	当期末
	2022年9月16日
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	34.5%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.5
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.6
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	15.2
その他	9.2

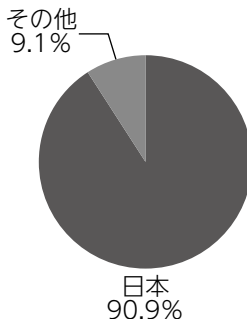
(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

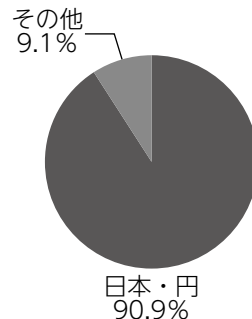
◆資産別配分



◆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

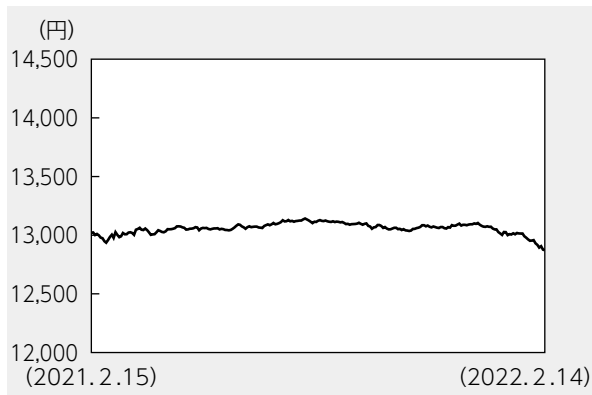
項目	当期末
	2022年9月16日
純資産総額	69,937,050円
受益権総口数	71,062,409口
1万口当たり基準価額	9,842円

(注) 当期中における追加設定元本額は112,391,367円、同解約元本額は42,328,958円です。

組入ファンドの概要

[国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド] (計算期間 2021年2月16日～2022年2月14日)

◆基準価額の推移



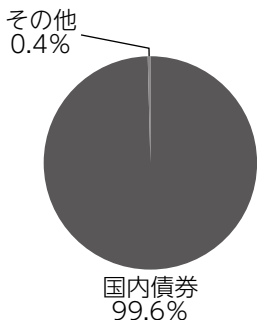
◆組入上位10銘柄

銘柄名	通貨	比率
3 2 9回 利付国庫債券 (10年)	日本・円	1.5%
3 3 9回 利付国庫債券 (10年)	日本・円	1.2
3 3 8回 利付国庫債券 (10年)	日本・円	1.1
3 4 4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	0.9
3 4 5回 利付国庫債券 (10年)	日本・円	0.9
3 4 7回 利付国庫債券 (10年)	日本・円	0.9
1 3 8回 利付国庫債券 (5年)	日本・円	0.9
3 4 8回 利付国庫債券 (10年)	日本・円	0.9
組入銘柄数	714銘柄	

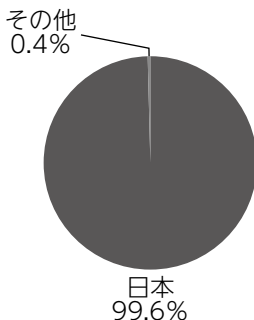
◆1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

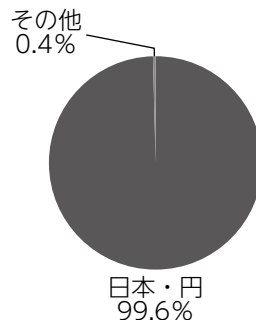
◆資産別配分



◆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。

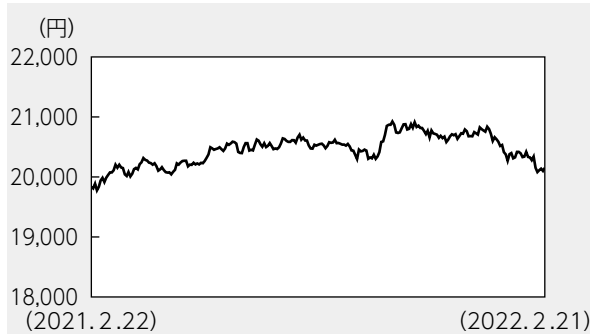
(注4) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

(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。

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド】

(計算期間 2021年2月23日～2022年2月21日)

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄

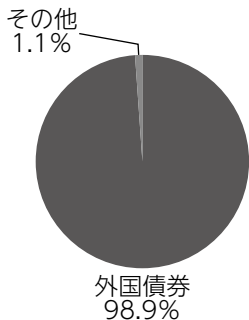
銘柄名	通貨	比率
US T N/B 1.25 08/15/31	アメリカ・ドル	0.5%
US T N/B 1.625 05/15/31	アメリカ・ドル	0.5
US T N/B 1.125 02/15/31	アメリカ・ドル	0.5
US T N/B 2.75 11/15/23	アメリカ・ドル	0.5
US T N/B 0.875 11/15/30	アメリカ・ドル	0.4
US T N/B 2.75 02/15/24	アメリカ・ドル	0.4
US T N/B 0.625 08/15/30	アメリカ・ドル	0.4
US T N/B 1.75 01/31/23	アメリカ・ドル	0.4
US T N/B 0.375 04/15/24	アメリカ・ドル	0.4
US T N/B 0.125 01/15/24	アメリカ・ドル	0.4
組入銘柄数	786銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

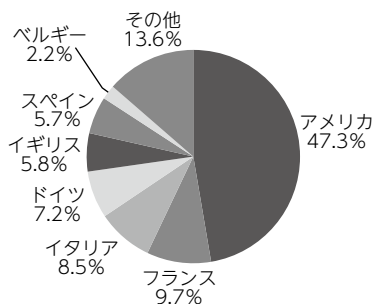
項目	当期	
	金額	比率
(a) その他費用 (保管費用)	3円	0.013%
(その他)	(2)	(0.012)
	(0)	(0.001)
合計	3	0.013

期中の平均基準価額は20,455円です。

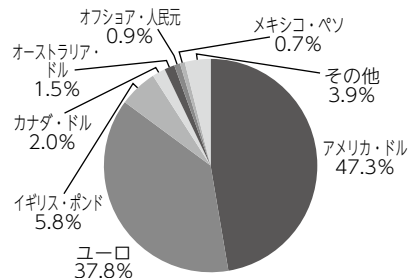
◆資産別配分



◆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」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)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。

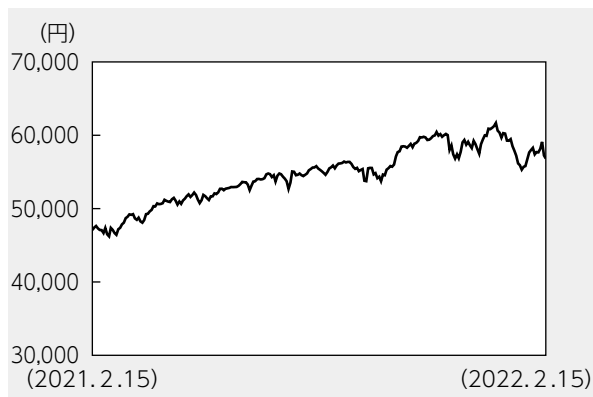
(注6) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

(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。

【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 2021年2月16日～2022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	4.9%
MICROSOFT CORP	アメリカ・ドル	3.7
AMAZON.COM INC	アメリカ・ドル	2.5
ALPHABET INC-CL A	アメリカ・ドル	1.4
ALPHABET INC-CL C	アメリカ・ドル	1.4
TESLA INC	アメリカ・ドル	1.3
NVIDIA CORP	アメリカ・ドル	1.1
META PLATFORMS INC	アメリカ・ドル	0.9
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ・ドル	0.8
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ・ドル	0.8
組入銘柄数	1,284銘柄	

◆1万口当たりの費用明細

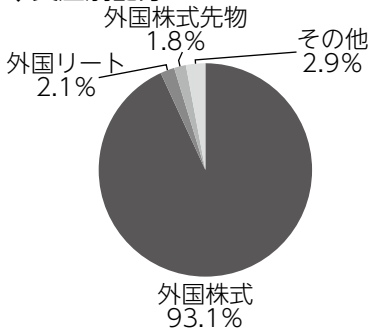
項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料	3円	0.006%
(株式)	(3)	(0.005)
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)
(先物・オプション)	(1)	(0.001)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投資証券)	(0)	(0.000)
(b) 有価証券取引税	14	0.025
(株式)	(14)	(0.025)
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)
(投資証券)	(0)	(0.000)
(c) その他費用	22	0.040
(保管費用)	(0)	(0.000)
(その他)	(22)	(0.040)
合計	39	0.071

期中の平均基準価額は54,626円です。

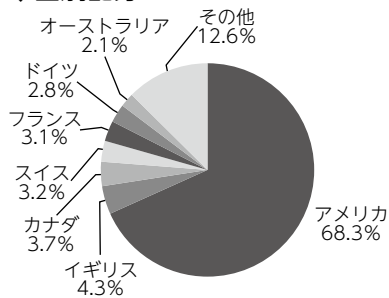
◆組入上位銘柄（先物）

銘柄名	売買	比率
S&P500 EMINI FUT	買建	1.3%
DJ EURO STOXX 50	買建	0.3
FTSE 100 INDEX FUTURE	買建	0.1
S&P/TSE 60 IX FUT	買建	0.1
SPI 200 FUTURES	買建	0.0
組入銘柄数	5銘柄	

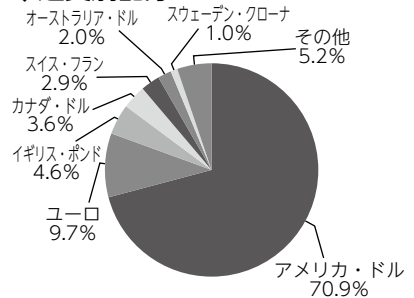
◆資産別配分



◆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」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）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。

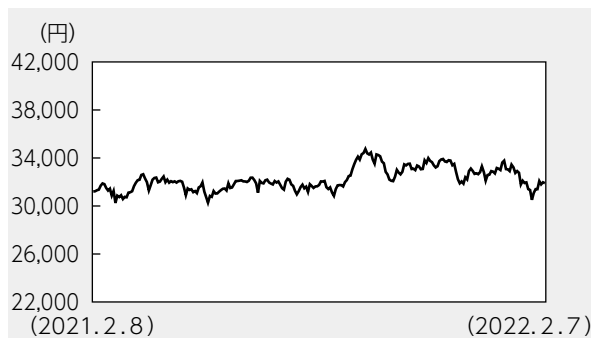
(注6) その他は、純資産総額を100%として、現物と先物の比率を差し引いたものです。また、上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

(注7) 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。

【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 2021年2月9日～2022年2月7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	4.3%
ソニーグループ	日本・円	2.9
キーエンス	日本・円	2.0
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
リクルートホールディングス	日本・円	1.5
東京エレクトロン	日本・円	1.3
日本電信電話	日本・円	1.3
任天堂	日本・円	1.2
信越化学工業	日本・円	1.2
ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数	2,174銘柄	

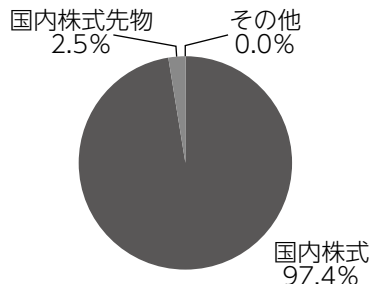
◆1万口当たりの費用明細

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料	1円	0.002%
（株式）	(0)	(0.001)
（先物・オプション）	(0)	(0.001)
合計	1	0.002
期中の平均基準価額は32,238円です。		

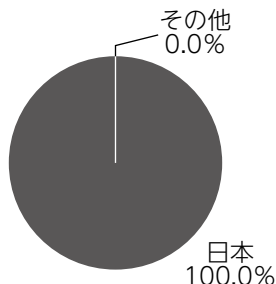
◆組入上位銘柄（先物）

銘柄名	売買	比率
TOPIX 先物	買建	2.5%
組入銘柄数	1銘柄	

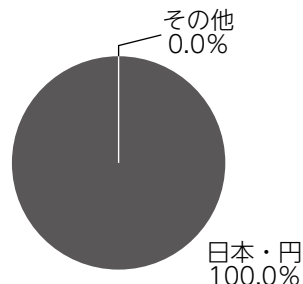
◆資産別配分



◆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」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。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で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）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。

<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、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。
- 「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・ディバーシファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(このページは白紙です)

