投資信託説明書（請求目論見書）

使用開始日
2024年11月27日

Asset Management One

DIAM DC バランスインデックスファンド

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

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 DC バランス30インデックスファンド」、「DIAM DC バランス50インデックスファンド」、「DIAM DC バランス70インデックスファンド」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 DC バランス30インデックスファンド」、「DIAM DC バランス50インデックスファンド」、「DIAM DC バランス70インデックスファンド」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】・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 68

第３【ファンドの経理状況】・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 75

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 288

第三部【委託会社等の情報】・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 290

第１【委託会社等の概況】・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 290

約款・・ 319

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。
なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。
※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2024年11月27日から2025年5月23日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

なお、海外休業日には、お申込みの受付は行いません。

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

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

○振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。
ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。

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(※)に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

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

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

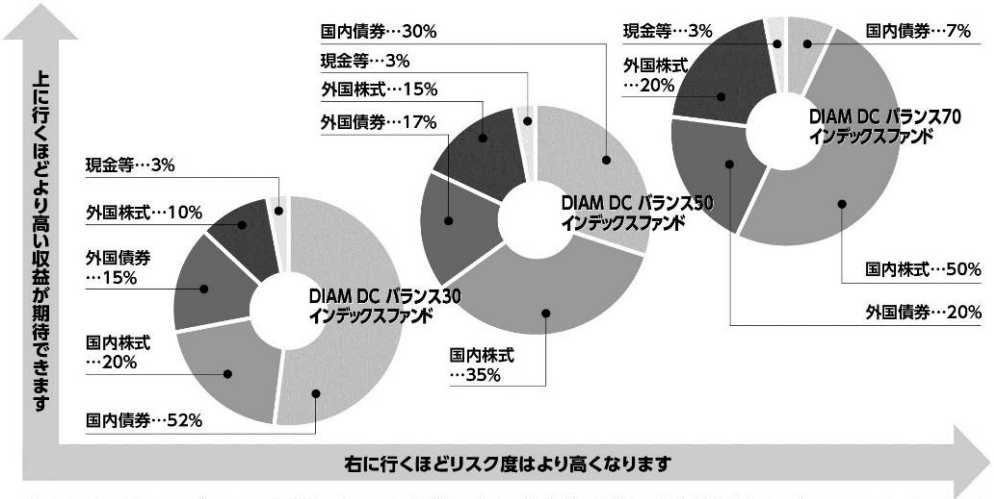
(※)当社が独自に指数化した合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、国内債券についてはNOMURA−BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

2 ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

3ファンドの基本アロケーション

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



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

●DIAM DC バランス30インデックスファンド
比較的リスクの低い資産（国内債券）を中心に組入れ、安定運用を行います。

●DIAM DC バランス50インデックスファンド
各資産をバランスよく組入れ、ミドルリスク・ミドルリターンをめざします。

●DIAM DC バランス70インデックスファンド
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組入れることにより、より高い収益をめざします。

分配方針

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

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

○商品分類表

ＤＩＡＭ ＤＣ バランス３０インデックスファンド

ＤＩＡＭ ＤＣ バランス５０インデックスファンド

ＤＩＡＭ ＤＣ バランス７０インデックスファンド

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）	補足分類
単位型投信 追加型投信	国　　内 海　　外 内　　外	株　　式 債　　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

ＤＩＡＭ ＤＣ バランス３０インデックスファンド

ＤＩＡＭ ＤＣ バランス５０インデックスファンド

ＤＩＡＭ ＤＣ バランス７０インデックスファンド

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

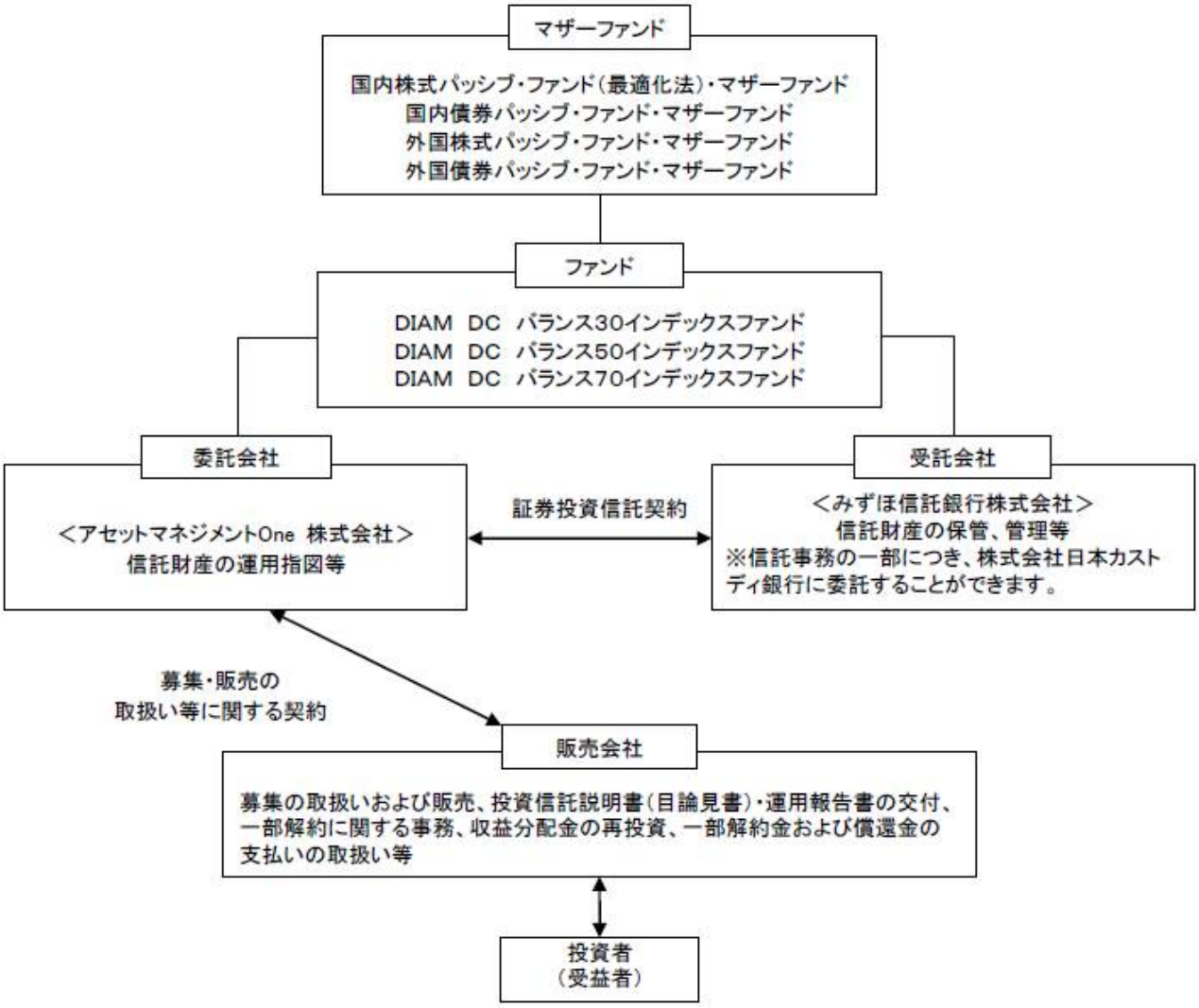
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式、債券） 資産配分固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券）を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が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

2006年12月27日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

●「ファミリーファンド方式」とは●

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

○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額
20億円（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＞

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

＜投資対象＞

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

＜投資態度＞

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

(2)①「ＤＩＡＭ ＤＣ バランス３０インデックスファンド」

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

②「ＤＩＡＭ ＤＣ バランス５０インデックスファンド」

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

③「ＤＩＡＭ ＤＣ バランス７０インデックスファンド」

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

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

※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）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。

※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。

※本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマー

ク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。

このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

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

■対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項
ファンドは合成インデックスに連動させるため、以下の対応を行います。
基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。
なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針　(2)投資対象　（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要をご参照ください。

（２）【投資対象】

1.投資の対象とする資産（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2.有価証券の指図範囲（約款第17条第１項）

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

(1) 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

(2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

(3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

(5) 株券または新株引受権証書

(6) 国債証券

(7) 地方債証券

(8) 特別の法律により法人の発行する債券

(9) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

(10)資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

(11)特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

(12)協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

(13)資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

(14)コマーシャル・ペーパー

(15)新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

(16)外国または外国の者の発行する証券または証書で、(5)～(15)までの証券または証書の性質を有するもの

(17)投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）

(18)投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

(19)外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

(20)オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

(21)預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

(22)外国法人が発行する譲渡性預金証書

(23)指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

(24)抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

(25)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

(26)外国の者に対する権利で(25)の有価証券の性質を有するもの

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

3. 金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

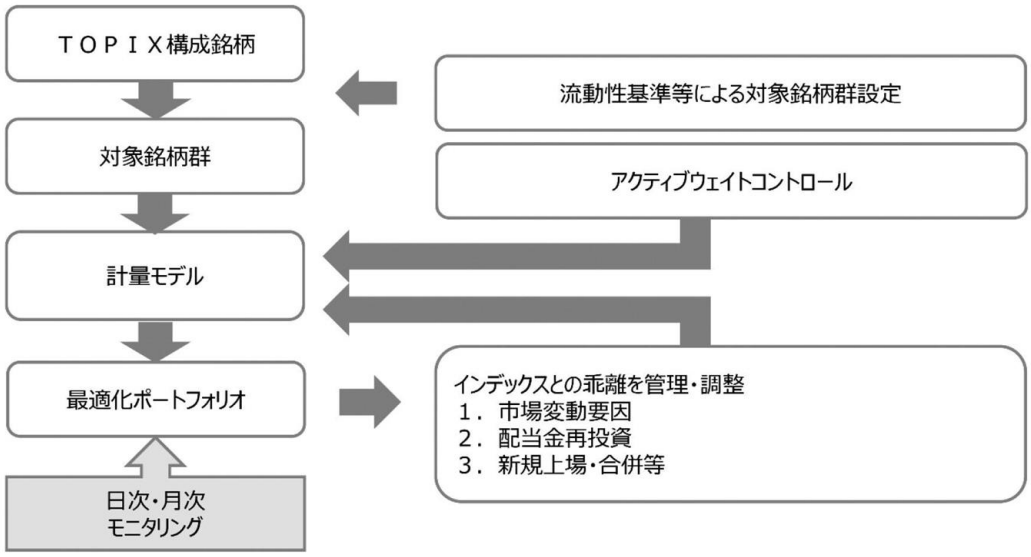
5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で5) の権利の性質を有するもの

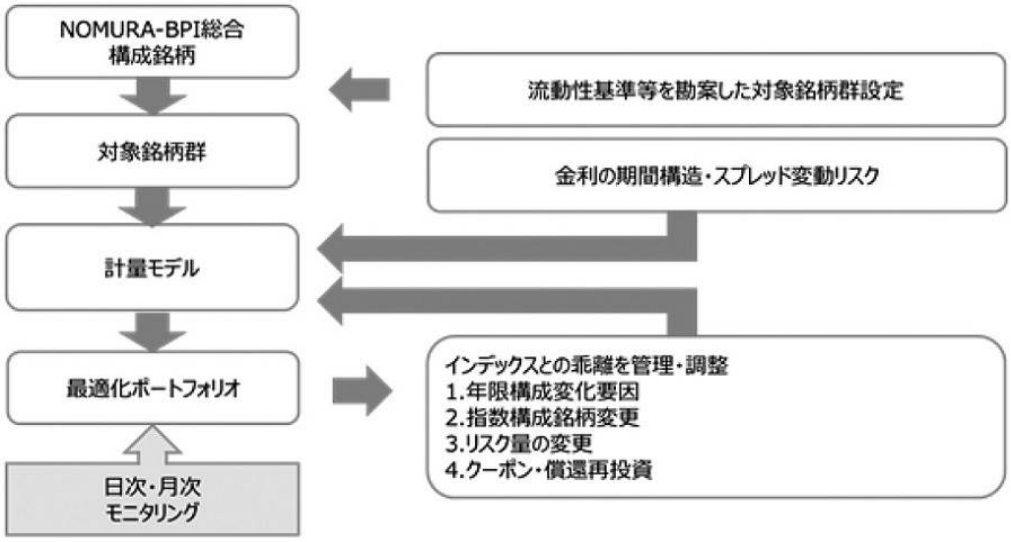
4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3. の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。（約款第17条第3項）

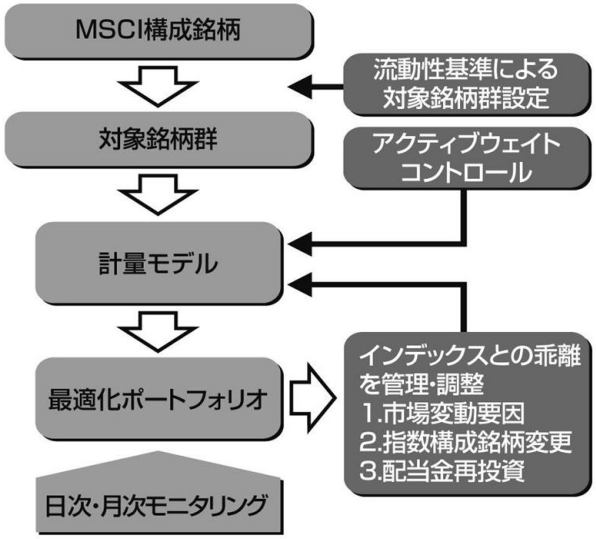
（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	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	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。 ・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

	
主な投資制限	1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 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。 3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 4. 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。

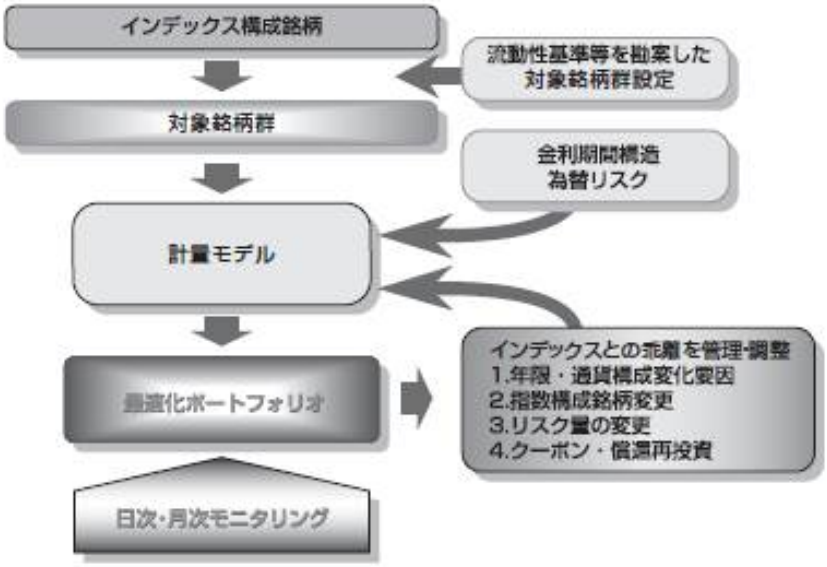
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。
運用プロセス	1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 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。 2. 最適化法によるポートフォリオの構築 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	1. 主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
運用プロセス	1. 流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。 2. 最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20％以下とします。

	3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人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。

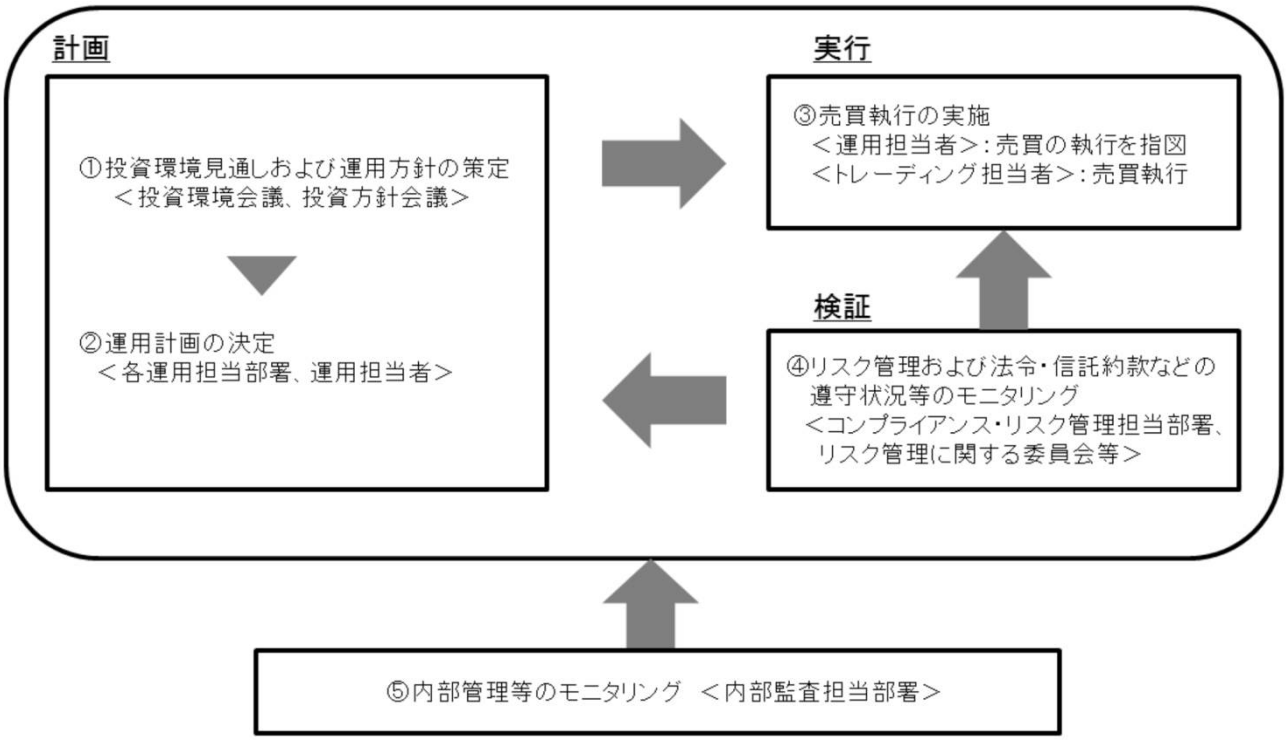
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
運用プロセス	1. 流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2. 最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3. インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資

	
主な投資制限	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、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「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。

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保益の運用方針

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

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

2)売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」と言います。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b.上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c.毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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「ＤＩＡＭ ＤＣ バランス３０インデックスファンド」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40％以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の35％以下とします。

②「ＤＩＡＭ ＤＣ バランス５０インデックスファンド」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60％以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45％以下とします。

③「ＤＩＡＭ ＤＣ バランス７０インデックスファンド」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80％以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50％以下とします。

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20条）

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

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

(7)同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限（約款第21条）

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

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

(8)同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款第22条）

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

(b)上記(a)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに

転換社債型新株予約権付社債の定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(9)信用取引の指図範囲（約款第23条）

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

(b)上記(a)の信用取引の指図は、次の1)～6)に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1)～6)に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1)信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2)株式分割により取得する株券

3)有償増資により取得する株券

4)売出しにより取得する株券

5)信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6)信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（(5)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(10)先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

(a)委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

1)先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

2)先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時

価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。）を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

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

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

(c) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行うことの指図をすることができます。

1) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が１年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額の範囲内とします。

2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象3．金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額（「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3) コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(11)スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

(a)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

(b)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(c)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

(f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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26条）

(a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(b)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(c)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定

元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(e)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、純資産総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(f)上記(e)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

(h)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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26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27条）

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

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

2)公社債の貸付は、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たときは、担保の受入の指図を行うものとします。

(15)公社債の空売りの指図範囲（約款第28条）

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

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

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

(16)公社債の借入れ（約款第29条）

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

(b)上記(a)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

(d)上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

(17)特別な場合の外貨建資産への投資制限（約款第31条）

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

(18)外国為替予約の指図（約款第32条）

(a)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

(19)資金の借入れ（約款第39条）

(a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(b)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10％以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

(c)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(d)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

３【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

(1)株式投資リスク

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

1)価格変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

2)信用リスク

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

各ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

(2)債券投資リスク

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

1)金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

2)信用リスク

投資する債券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドが実質的に投資する債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

(3)為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、各ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがいまして、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。各ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としており、円と投資対象国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に影響します。

(4)資産配分リスク

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

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

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

(5)カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

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

○各ファンドにつき、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

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

○注意事項

イ．当ファンドは、実質的に株式や債券など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

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

ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

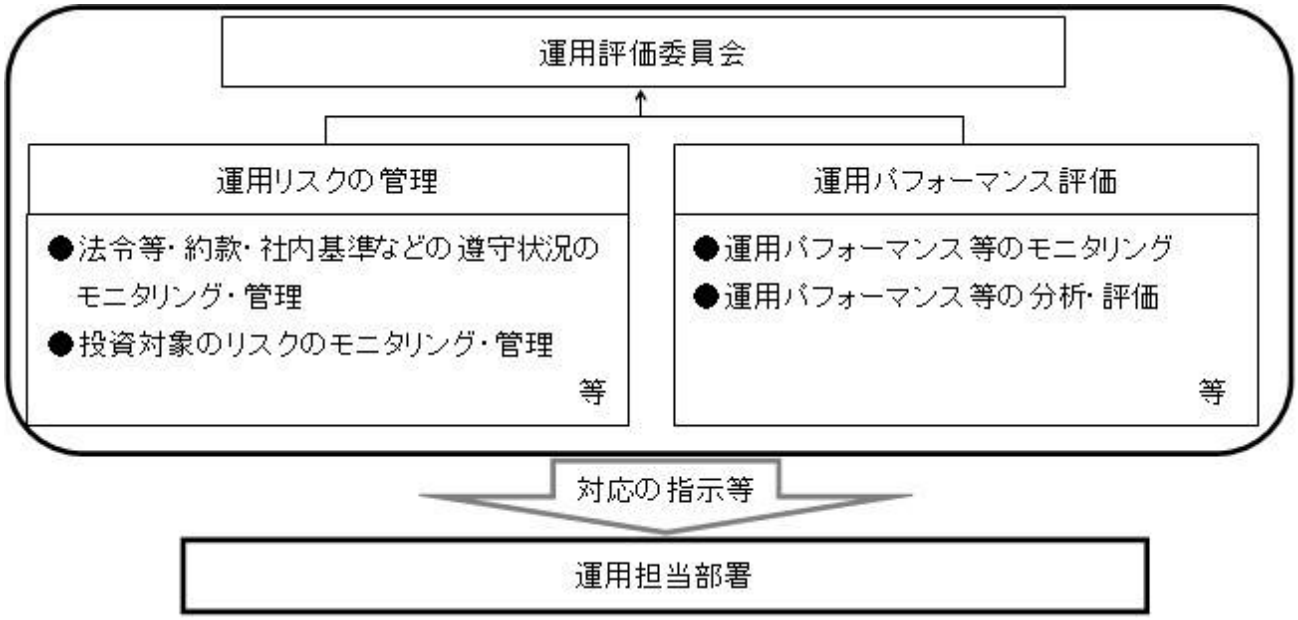
＜リスク管理体制＞

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

・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・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。



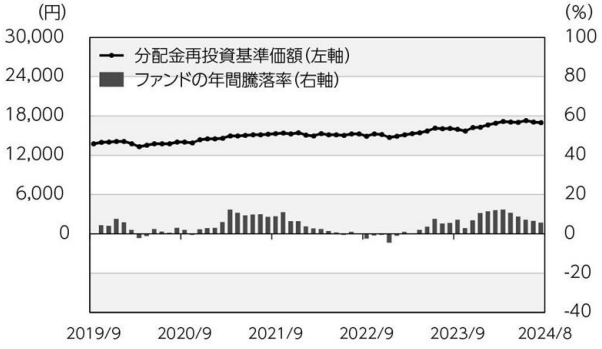
・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※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。

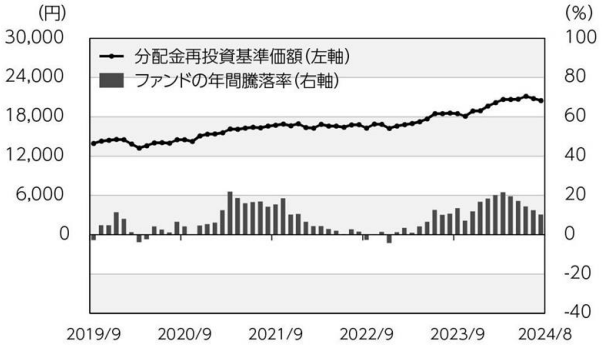
<参考情報>

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

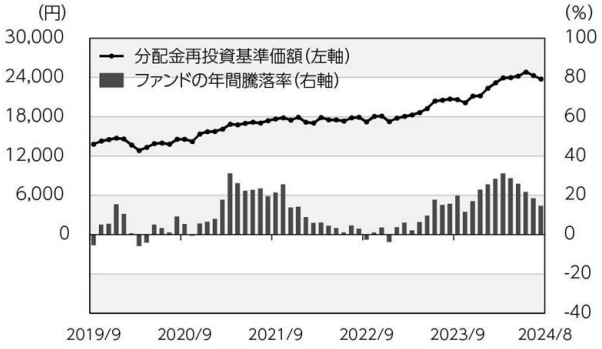
DIAM DC バランス30インデックスファンド



DIAM DC バランス50インデックスファンド



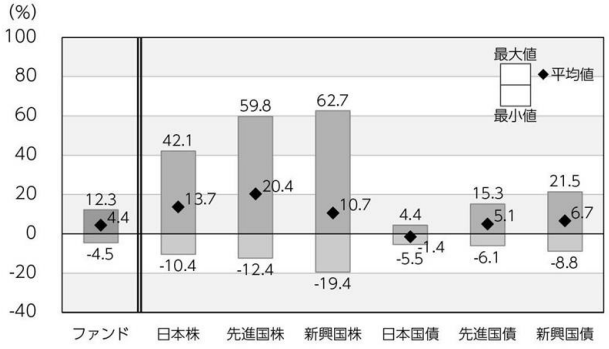
DIAM DC バランス70インデックスファンド



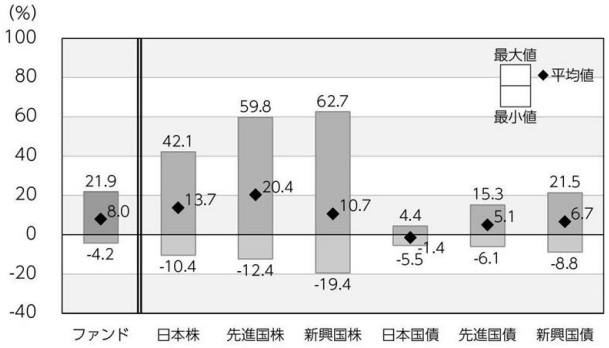
*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*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。

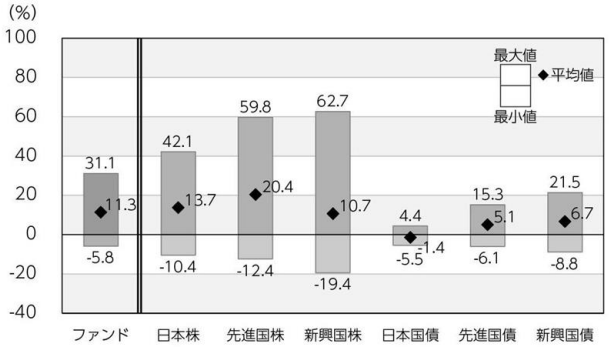
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2019年9月～2024年8月



2019年9月～2024年8月



2019年9月～2024年8月

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※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かかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④ マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に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ます。）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 DC バランス30インデックスファンド	0.27%	0.26%	0.01%
DIAM DC バランス50インデックスファンド	0.31%	0.30%	0.01%
DIAM DC バランス70インデックスファンド	0.34%	0.33%	0.01%

（表示桁数未満を四捨五入）

※対象期間: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】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

2024年8月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		5,637,839,939	97.01
	内　日本	5,637,839,939	97.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		174,039,098	2.99
純資産総額		5,811,879,037	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

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		11,229,970,915	97.01
	内　日本	11,229,970,915	97.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		346,086,148	2.99
純資産総額		11,576,057,063	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

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		9,351,145,001	97.02
	内　日本	9,351,145,001	97.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		287,652,978	2.98
純資産総額		9,638,797,979	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。

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

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　ジャージィー	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】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,504,367,866	1.2410 3,108,147,194	1.2192 3,053,325,302	－ －	52.54
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	243,375,699	4.6713 1,136,883,368	4.7905 1,165,891,286	－ －	20.06
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	363,159,880	2.3288 845,753,228	2.3482 852,772,030	－ －	14.67
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	62,498,075	8.5381 533,617,268	9.0539 565,851,321	－ －	9.74

（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。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

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	国内株式パッシブ・ファン	親投資	852,195,358	4.6676	4.7905	－	35.27

	ド（最適化法）・マザーファンド 日本	信託受益証券		3,977,719,337	4,082,441,862	－	
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	2,852,368,441	1.2412 3,540,401,226	1.2192 3,477,607,603	－ －	30.04
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	831,101,709	2.3285 1,935,268,665	2.3482 1,951,593,033	－ －	16.86
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	189,788,756	8.5320 1,619,280,726	9.0539 1,718,328,417	－ －	14.84

（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。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

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	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	1,016,246,674	4.6692 4,745,130,800	4.7905 4,868,329,691	－ －	50.51
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	210,300,048	8.5423 1,796,460,189	9.0539 1,904,035,604	－ －	19.75
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	809,810,289	2.3300 1,886,923,749	2.3482 1,901,596,520	－ －	19.73
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	555,432,404	1.2396 688,558,029	1.2192 677,183,186	－ －	7.03

（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	97.02
合計	97.02

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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	キヤノン 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	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	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 3,645,810,000	99.86 3,644,890,000	0.4 2028/9/20	0.81
30	３５３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,690,000,000	98.83 3,646,900,800	98.52 3,635,535,600	0.1 2028/12/20	0.81

（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】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド
該当事項はありません。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド
該当事項はありません。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド
該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド
該当事項はありません。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド
該当事項はありません。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド
該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド
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8計算期間末（2015年2月25日）	3,961	3,961	1.2516	1.2516
第9計算期間末（2016年2月25日）	3,872	3,872	1.2197	1.2197
第10計算期間末（2017年2月27日）	4,191	4,191	1.2846	1.2846
第11計算期間末（2018年2月26日）	4,448	4,448	1.3537	1.3537
第12計算期間末（2019年2月25日）	4,498	4,498	1.3547	1.3547
第13計算期間末（2020年2月25日）	4,666	4,666	1.4053	1.4053
第14計算期間末（2021年2月25日）	4,946	4,946	1.4732	1.4732
第15計算期間末（2022年2月25日）	5,360	5,360	1.4905	1.4905
第16計算期間末（2023年2月27日）	5,659	5,659	1.5060	1.5060
第17計算期間末（2024年2月26日）	6,501	6,501	1.6947	1.6947
2023年8月末日	6,180	－	1.6094	－
9月末日	6,131	－	1.5974	－

10月末日	6,024	－	1.5687	－
11月末日	6,226	－	1.6231	－
12月末日	6,260	－	1.6288	－
2024年1月末日	6,415	－	1.6617	－
2月末日	6,536	－	1.6921	－
3月末日	6,664	－	1.7165	－
4月末日	6,525	－	1.7099	－
5月末日	5,869	－	1.7046	－
6月末日	5,942	－	1.7308	－
7月末日	5,879	－	1.7087	－
8月末日	5,811	－	1.6996	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

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8計算期間末 （2015年2月25日）	7,650	7,650	1.2462	1.2462
第9計算期間末 （2016年2月25日）	7,107	7,107	1.1681	1.1681
第10計算期間末 （2017年2月27日）	7,834	7,834	1.2776	1.2776
第11計算期間末 （2018年2月26日）	8,547	8,547	1.3878	1.3878
第12計算期間末 （2019年2月25日）	8,531	8,531	1.3729	1.3729
第13計算期間末 （2020年2月25日）	8,938	8,938	1.4358	1.4358
第14計算期間末 （2021年2月25日）	9,692	9,692	1.5834	1.5834
第15計算期間末 （2022年2月25日）	9,872	9,872	1.6169	1.6169
第16計算期間末 （2023年2月27日）	10,210	10,210	1.6767	1.6767
第17計算期間末 （2024年2月26日）	12,205	12,205	2.0202	2.0202
2023年8月末日	11,360	－	1.8602	－
9月末日	11,239	－	1.8479	－
10月末日	10,955	－	1.8090	－
11月末日	11,407	－	1.8868	－
12月末日	11,458	－	1.8928	－
2024年1月末日	11,876	－	1.9636	－
2月末日	12,238	－	2.0188	－
3月末日	12,527	－	2.0677	－
4月末日	12,385	－	2.0643	－
5月末日	11,778	－	2.0714	－
6月末日	12,015	－	2.1144	－
7月末日	11,801	－	2.0782	－

8月末日	11,576	－	2.0493	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

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8計算期間末 （2015年2月25日）	4,726	4,726	1.2215	1.2215
第9計算期間末 （2016年2月25日）	4,274	4,274	1.0985	1.0985
第10計算期間末 （2017年2月27日）	4,943	4,943	1.2455	1.2455
第11計算期間末 （2018年2月26日）	5,654	5,654	1.3935	1.3935
第12計算期間末 （2019年2月25日）	5,626	5,626	1.3629	1.3629
第13計算期間末 （2020年2月25日）	5,913	5,913	1.4374	1.4374
第14計算期間末 （2021年2月25日）	6,631	6,631	1.6441	1.6441
第15計算期間末 （2022年2月25日）	6,985	6,985	1.6913	1.6913
第16計算期間末 （2023年2月27日）	7,559	7,559	1.8019	1.8019
第17計算期間末 （2024年2月26日）	9,944	9,944	2.3171	2.3171
2023年8月末日	8,861	－	2.0721	－
9月末日	8,819	－	2.0600	－
10月末日	8,646	－	2.0119	－
11月末日	9,079	－	2.1142	－
12月末日	9,090	－	2.1200	－
2024年1月末日	9,607	－	2.2345	－
2月末日	9,983	－	2.3172	－
3月末日	10,338	－	2.3935	－
4月末日	10,252	－	2.3954	－
5月末日	9,853	－	2.4197	－
6月末日	10,113	－	2.4831	－
7月末日	9,896	－	2.4298	－
8月末日	9,638	－	2.3757	－

②【分配の推移】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

	１口当たりの分配金（円）
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
2024年2月27日～2024年8月26日	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

	１口当たりの分配金（円）
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
2024年2月27日～2024年8月26日	－

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

	１口当たりの分配金（円）
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
2024年2月27日～2024年8月26日	－

③【収益率の推移】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

	収益率（％）
第8計算期間	10.7
第9計算期間	△2.5
第10計算期間	5.3
第11計算期間	5.4
第12計算期間	0.1
第13計算期間	3.7
第14計算期間	4.8
第15計算期間	1.2
第16計算期間	1.0
第17計算期間	12.5
2024年2月27日～2024年8月26日	△0.1

（注）収益率は期間騰落率です。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

	収益率（%）
第8計算期間	15.4
第9計算期間	△6.3
第10計算期間	9.4
第11計算期間	8.6
第12計算期間	△1.1
第13計算期間	4.6
第14計算期間	10.3
第15計算期間	2.1
第16計算期間	3.7
第17計算期間	20.5
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。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

	収益率（%）
第8計算期間	20.4
第9計算期間	△10.1
第10計算期間	13.4
第11計算期間	11.9
第12計算期間	△2.2
第13計算期間	5.5
第14計算期間	14.4
第15計算期間	2.9
第16計算期間	6.5
第17計算期間	28.6
2024年2月27日～2024年8月26日	1.4

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第8計算期間	587,018,593	370,175,319
第9計算期間	305,909,017	296,074,964
第10計算期間	275,951,706	188,670,759
第11計算期間	334,079,343	310,386,979
第12計算期間	291,814,490	257,295,183
第13計算期間	267,614,189	267,934,960
第14計算期間	453,091,880	416,139,596
第15計算期間	652,179,628	412,991,541
第16計算期間	563,656,024	402,292,173
第17計算期間	536,540,036	458,021,975
2024年2月27日～ 2024年8月26日	279,835,018	708,956,134

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

	設定口数	解約口数

第8計算期間	941,276,993	622,378,462
第9計算期間	486,750,602	541,314,986
第10計算期間	463,520,203	415,914,505
第11計算期間	505,249,804	478,772,270
第12計算期間	401,039,943	345,753,574
第13計算期間	413,568,332	402,317,373
第14計算期間	460,563,926	564,773,432
第15計算期間	557,802,022	573,213,847
第16計算期間	503,376,782	519,506,568
第17計算期間	505,531,553	553,620,050
2024年2月27日～ 2024年8月26日	288,782,243	699,426,953

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

	設定口数	解約口数
第8計算期間	651,362,252	510,532,126
第9計算期間	464,619,957	442,857,312
第10計算期間	358,141,987	280,091,973
第11計算期間	477,082,367	388,424,861
第12計算期間	367,041,734	296,923,234
第13計算期間	326,295,645	340,098,661
第14計算期間	445,535,191	525,978,103
第15計算期間	588,124,012	492,033,801
第16計算期間	537,178,278	471,764,353
第17計算期間	614,558,721	517,872,227
2024年2月27日～ 2024年8月26日	329,458,673	576,385,847

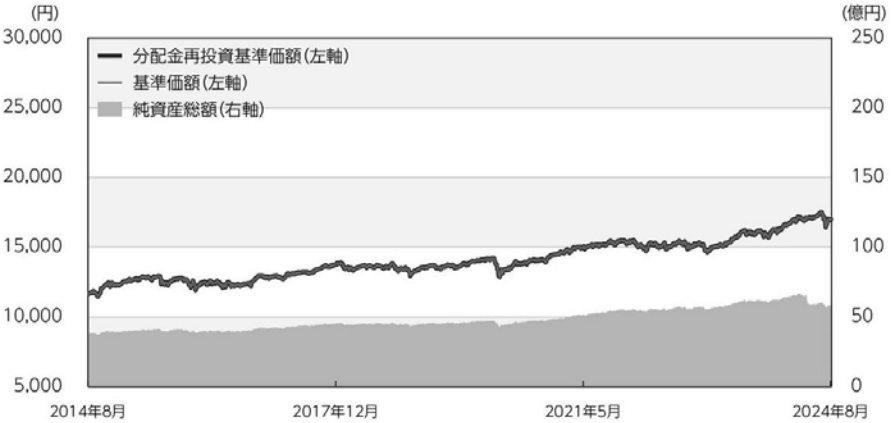
（注）本邦外における設定及び解約はありません。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2024年8月30日

DIAM DC バランス30インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 《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:2006年12月27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

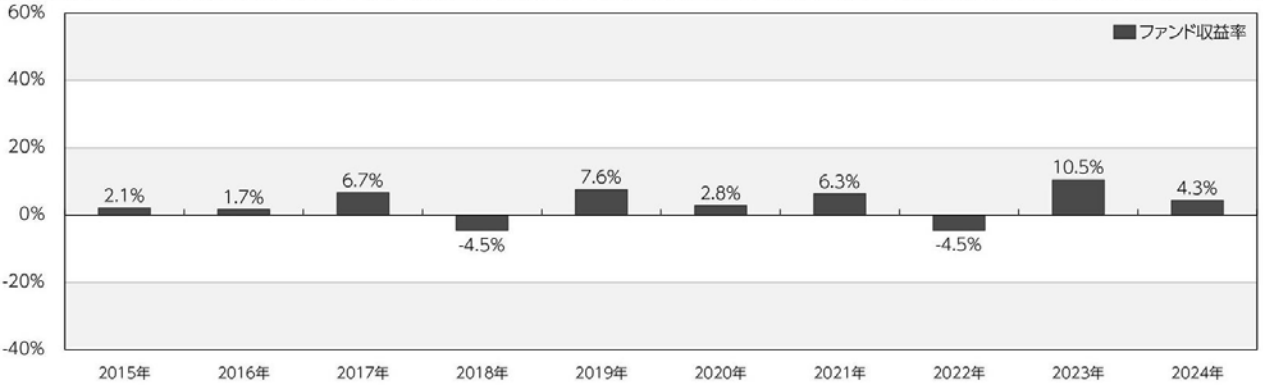
※分配金は1万口当たりです。

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	52.54
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.06
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.67
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.74

年間収益率の推移(暦年ベース)



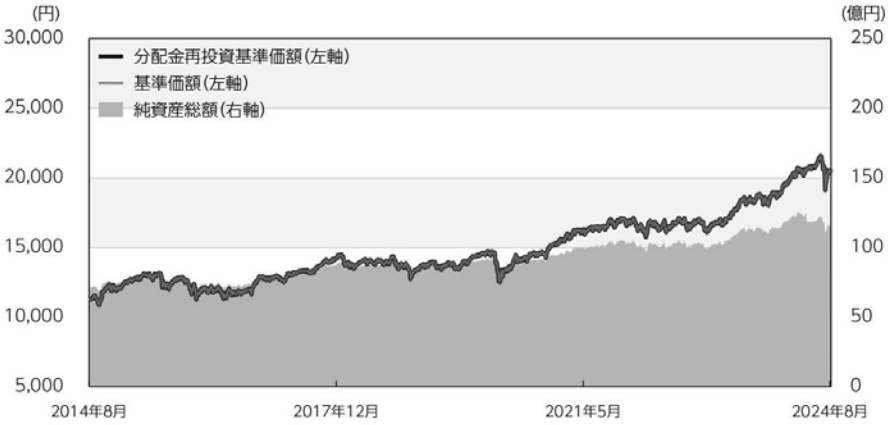
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

データの基準日:2024年8月30日

DIAM DC バランス50インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 《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:2006年12月27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

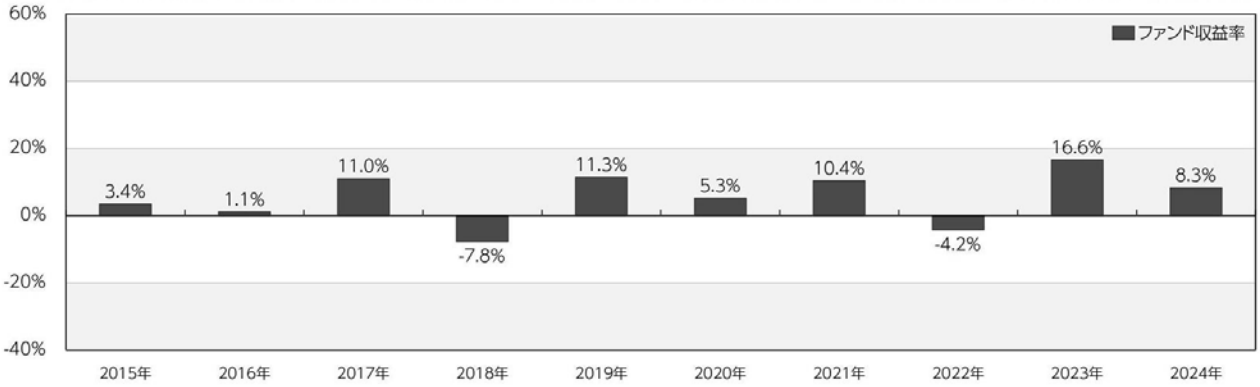
※分配金は1万口当たりです。

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	35.27
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	30.04
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.86
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.84

年間収益率の推移(暦年ベース)



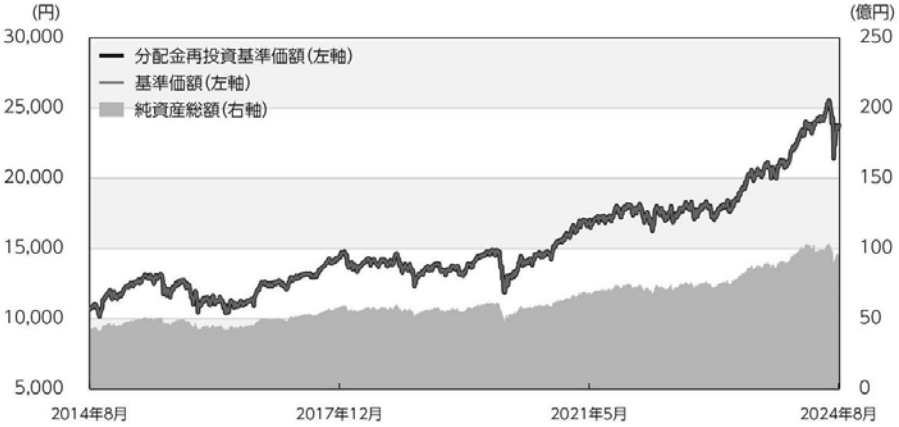
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

データの基準日:2024年8月30日

DIAM DC バランス70インデックスファンド

基準価額・純資産の推移 《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:2006年12月27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

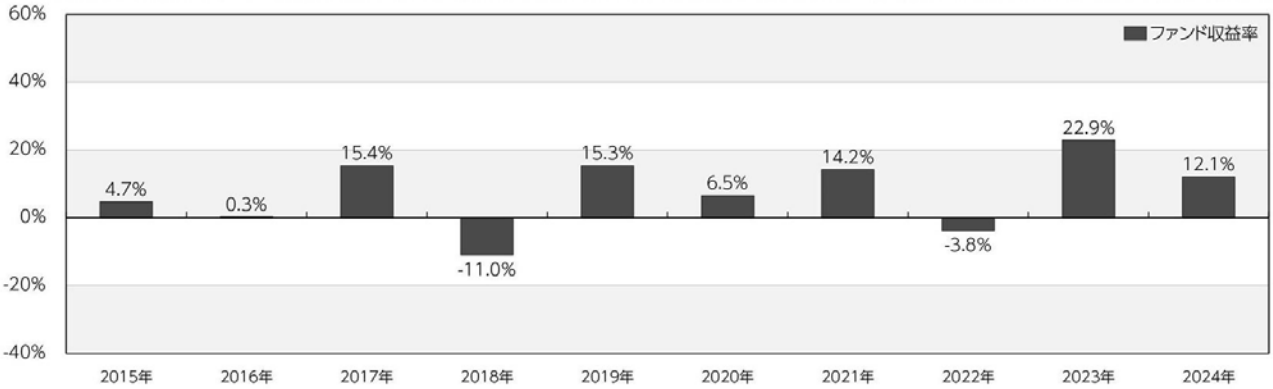
※分配金は1万口当たりです。

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	50.51
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.75
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.73
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.03

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。

データの基準日:2024年8月30日

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お申込みの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

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

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

※「基準価額」とは、ファンドの純資産総額（資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口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

各ファンドにつき、1円以上1円単位（当初元本 1口＝1円）

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

・お申込手数料

ありません。

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

２【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時30分までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

・解約代金

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

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

・解約価額
解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

・解約価額の照会方法等
解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日※における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社への問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　https://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は2006年12月27日から無期限です。
ただし、下記(5)イ.の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

a.計算期間は毎年2月26日から翌年2月25日までとすることを原則とします。
b.上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

イ．償還規定
a.委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
b.委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
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って、上記c. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

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

h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更d. 」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ. 信託約款の変更

a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。

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

c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べることができる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。

e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定にしたがいます。

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

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】

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

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17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
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　森 重　　俊 寛

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンドの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、ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンドの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）ＸＢＲＬ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】

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 2023年2月27日現在	第17期 2024年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	180,227,178	206,164,871
親投資信託受益証券	5,490,204,949	6,308,285,211
未収入金	1,340,000	18,072,000
流動資産合計	5,671,772,127	6,532,522,082
資産合計	5,671,772,127	6,532,522,082
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,627,326	22,600,920
未払受託者報酬	944,221	1,039,665
未払委託者報酬	6,609,821	7,277,971
その他未払費用	111,951	123,293
流動負債合計	12,293,319	31,041,849
負債合計	12,293,319	31,041,849
純資産の部		
元本等		
元本	3,757,866,453	3,836,384,514
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,901,612,355	2,665,095,719
（分配準備積立金）	952,045,969	1,506,997,770
元本等合計	5,659,478,808	6,501,480,233
純資産合計	5,659,478,808	6,501,480,233
負債純資産合計	5,671,772,127	6,532,522,082

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 自　2023年2月28日 至　2024年2月26日
営業収益		
受取利息	1,348	1,687
有価証券売買等損益	71,943,719	736,976,262
営業収益合計	71,945,067	736,977,949
営業費用		
支払利息	65,017	72,073
受託者報酬	1,848,744	2,003,202
委託者報酬	12,941,814	14,023,059
その他費用	219,217	237,541
営業費用合計	15,074,792	16,335,875
営業利益又は営業損失（△）	56,870,275	720,642,074
経常利益又は経常損失（△）	56,870,275	720,642,074
当期純利益又は当期純損失（△）	56,870,275	720,642,074
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（△）	6,773,785	40,355,334
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,764,038,029	1,901,612,355
剰余金増加額又は欠損金減少額	285,341,383	317,060,605
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	285,341,383	317,060,605
剰余金減少額又は欠損金増加額	197,863,547	233,863,981
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	197,863,547	233,863,981
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（△）	1,901,612,355	2,665,095,719

（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17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16期 2023年2月27日現在	第17期 2024年2月26日現在
１．　期首元本額	3,596,502,602円	3,757,866,453円
期中追加設定元本額	563,656,024円	536,540,036円
期中一部解約元本額	402,292,173円	458,021,975円
２．　受益権の総数	3,757,866,453口	3,836,384,514口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 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（59,914,823円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,096,980,415円）及び分配準備積立金（892,131,146円）より分配対象収益は2,049,026,384円（1万口当たり5,452.63円）でありますが、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（81,511,457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（581,068,472円）、信託約款に規定される収益調整金（1,247,919,131円）及び分配準備積立金（844,417,841円）より分配対象収益は2,754,916,901円（1万口当たり7,181.02円）でありますが、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16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 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

	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。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 2023年2月27日現在	第17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	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第16期 2023年2月27日現在	第17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	54,042,810	675,617,067
合計	54,042,810	675,617,067

（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16期 2023年2月27日現在	第17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）	1.5060円 （15,060円）	1.6947円 （16,947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	288,206,993	1,344,773,829	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,661,941,245	3,306,663,414	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	80,763,954	688,698,464	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	415,782,480	968,149,504	
親投資信託受益証券　合計		3,446,694,672	6,308,285,211	
合計			6,308,285,211	

（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
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　森 重　　俊 寛

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンドの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、ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンドの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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 2023年2月27日現在	第17期 2024年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	322,232,094	385,369,865
親投資信託受益証券	9,904,065,453	11,843,525,549
未収入金	17,250,000	10,830,000
流動資産合計	10,243,547,547	12,239,725,414
資産合計	10,243,547,547	12,239,725,414
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,492,695	17,211,142
未払受託者報酬	1,705,955	1,913,294
未払委託者報酬	13,647,989	15,306,591
その他未払費用	202,355	226,961
流動負債合計	33,048,994	34,657,988
負債合計	33,048,994	34,657,988
純資産の部		
元本等		
元本	6,089,632,029	6,041,543,532
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,120,866,524	6,163,523,894
（分配準備積立金）	3,047,772,122	4,784,531,551
元本等合計	10,210,498,553	12,205,067,426
純資産合計	10,210,498,553	12,205,067,426
負債純資産合計	10,243,547,547	12,239,725,414

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 自　2023年2月28日 至　2024年2月26日
営業収益		
受取利息	2,393	3,109
有価証券売買等損益	398,486,163	2,124,509,096
営業収益合計	398,488,556	2,124,512,205
営業費用		
支払利息	117,751	131,223
受託者報酬	3,364,228	3,666,613
委託者報酬	26,914,428	29,333,425
その他費用	399,045	434,940
営業費用合計	30,795,452	33,566,201
営業利益又は営業損失（△）	367,693,104	2,090,946,004
経常利益又は経常損失（△）	367,693,104	2,090,946,004
当期純利益又は当期純損失（△）	367,693,104	2,090,946,004
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（△）	23,061,268	89,169,672
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,766,441,464	4,120,866,524
剰余金増加額又は欠損金減少額	331,113,523	417,954,538
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	331,113,523	417,954,538
剰余金減少額又は欠損金増加額	321,320,299	377,073,500
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	321,320,299	377,073,500
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（△）	4,120,866,524	6,163,523,894

（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17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16期 2023年2月27日現在	第17期 2024年2月26日現在
１．　期首元本額	6,105,761,815円	6,089,632,029円
期中追加設定元本額	503,376,782円	505,531,553円
期中一部解約元本額	519,506,568円	553,620,050円
２．　受益権の総数	6,089,632,029口	6,041,543,532口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 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（160,248,178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（184,383,658円）、信託約款に規定される収益調整金（1,648,509,288円）及び分配準備積立金（2,703,140,286円）より分配対象収益は4,696,281,410円（1万口当たり7,711.92円）でありますが、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（187,379,861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（1,814,396,471円）、信託約款に規定される収益調整金（1,877,176,156円）及び分配準備積立金（2,782,755,219円）より分配対象収益は6,661,707,707円（1万口当たり11,026.49円）でありますが、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16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 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

	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。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 2023年2月27日現在	第17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	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第16期 2023年2月27日現在	第17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	366,903,479	2,026,036,877
合計	366,903,479	2,026,036,877

（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16期 2023年2月27日現在	第17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）	1.6767円 （16,767円）	2.0202円 （20,202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	959,707,882	4,477,996,977	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,760,892,923	3,429,581,188	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	228,321,872	1,946,969,099	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	854,188,656	1,988,978,285	
親投資信託受益証券　合計		4,803,111,333	11,843,525,549	
合計			11,843,525,549	

（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
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　森 重　　俊 寛

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンドの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、ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンドの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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 2023年2月27日現在	第17期 2024年2月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	241,076,429	328,604,928
親投資信託受益証券	7,333,650,511	9,651,070,474
未収入金	6,354,000	－
流動資産合計	7,581,080,940	9,979,675,402
資産合計	7,581,080,940	9,979,675,402
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,902,042	19,451,102
未払受託者報酬	1,249,883	1,519,121
未払委託者報酬	11,249,205	13,672,500
その他未払費用	148,230	180,197
流動負債合計	21,549,360	34,822,920
負債合計	21,549,360	34,822,920
純資産の部		
元本等		
元本	4,195,317,350	4,292,003,844
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,364,214,230	5,652,848,638
（分配準備積立金）	2,331,652,056	4,143,925,343
元本等合計	7,559,531,580	9,944,852,482
純資産合計	7,559,531,580	9,944,852,482
負債純資産合計	7,581,080,940	9,979,675,402

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 自　2023年2月28日 至　2024年2月26日
営業収益		
受取利息	1,785	2,423
有価証券売買等損益	484,473,864	2,230,117,963
営業収益合計	484,475,649	2,230,120,386
営業費用		
支払利息	86,915	102,782
受託者報酬	2,432,871	2,844,514
委託者報酬	21,896,427	25,601,441
その他費用	288,524	337,386
営業費用合計	24,704,737	28,886,123
営業利益又は営業損失（△）	459,770,912	2,201,234,263
経常利益又は経常損失（△）	459,770,912	2,201,234,263
当期純利益又は当期純損失（△）	459,770,912	2,201,234,263
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（△）	31,161,255	122,458,823
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,855,114,253	3,364,214,230
剰余金増加額又は欠損金減少額	408,401,814	630,970,034
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	408,401,814	630,970,034
剰余金減少額又は欠損金増加額	327,911,494	421,111,066
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	327,911,494	421,111,066
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（△）	3,364,214,230	5,652,848,638

（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17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16期 2023年2月27日現在	第17期 2024年2月26日現在
１．　期首元本額	4,129,903,425円	4,195,317,350円
期中追加設定元本額	537,178,278円	614,558,721円
期中一部解約元本額	471,764,353円	517,872,227円
２．　受益権の総数	4,195,317,350口	4,292,003,844口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 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（146,584,399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（282,025,258円）、信託約款に規定される収益調整金（1,675,017,982円）及び分配準備積立金（1,903,042,399円）より分配対象収益は4,006,670,038円（1万口当たり9,550.33円）でありますが、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（175,949,693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（1,902,825,747円）、信託約款に規定される収益調整金（2,034,993,202円）及び分配準備積立金（2,065,149,903円）より分配対象収益は6,178,918,545円（1万口当たり14,396.34円）でありますが、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16期 自　2022年2月26日 至　2023年2月27日	第17期 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

	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。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 2023年2月27日現在	第17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	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第16期 2023年2月27日現在	第17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	456,121,140	2,162,138,571
合計	456,121,140	2,162,138,571

（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16期 2023年2月27日現在	第17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）	1.8019円 （18,019円）	2.3171円 （23,171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	1,085,071,047	5,062,941,505	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	520,501,398	646,566,836	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	237,223,346	2,022,874,638	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	824,001,501	1,918,687,495	
親投資信託受益証券　合計		2,666,797,292	9,651,070,474	
合計			9,651,070,474	

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

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

（参考）
「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド」、「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド」、「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対

照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

	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＜ラップ専用＞	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
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,466,075,190円
Ｏｎｅグローバルバランス	44,410,502円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	895,699,678円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,302,701,027円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,859,431,007円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	288,206,993円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	959,707,882円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	282,382,237円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	332,825,964円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　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
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,609,480円
Ｏｎｅ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）	4.6660円 （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	
ニッスイ	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	
ホクリヨウ	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	
ＩＮＰＥＸ	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	
錢高組	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	
淺沼組	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ネッツエスアイ	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	
大氣社	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	
ニップン	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	
ＬＩＦＵＬＬ	51,300	173.00	8,874,900	
ＭＩＸＩ	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	
エプコ	1,800	890.00	1,602,000	
システナ	221,900	293.00	65,016,700	
ＮＪＳ	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	
綜合警備保障	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	
カカクコム	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	
ＳＢＳ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	
ブラス	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ＤＹ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	
Ａｏｂａ‐ＢＢＴ	2,500	392.00	980,000	
エスプール	43,200	315.00	13,608,000	
ＷＤＢ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	
ＣＤＧ	800	1,231.00	984,800	
アドウェイズ	20,700	494.00	10,225,800	
バリューコマース	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	

キリンホールディングス	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・ヴイ・エス・ベイエリア	900	724.00	651,600	
オルバ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	
キャンドゥ	5,500	2,705.00	14,877,500	
エレマテック	13,900	1,808.00	25,131,200	
ＩＫ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	
トーメンデバイス	2,200	5,250.00	11,550,000	
ハローズ	7,000	4,420.00	30,940,000	
ＪＰ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	
円谷フィールズホールディングス	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	
キユーピー	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	
イー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	
ピッ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	
ＢＥＥＮＯＳ	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	
日本フエルト	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	
クラウディアホールディングス	1,500	398.00	597,000	
ＴＳＩ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	
ＴＩＳ	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ペパボ	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	
ＡＧＳ	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	
ＫＬａｂ	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	
ｅｎｉｓｈ	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	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	
オプティム	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	
高圧ガス工業	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	
ギフティ	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	
ＤＩＣ	57,200	2,985.50	170,770,600	
サカタインクス	32,600	1,410.00	45,966,000	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	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	
ＬＩＮＥ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	
ＩＤ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	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,900	1,800.00	14,220,000	
ＳＢ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	
ＳＢＩ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	
ＣＩＪ	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－ｎｅ	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	
中部鋼鈑	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	
日本鋳鉄管	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	
日本軽金属ホールディングス	44,200	1,711.00	75,626,200	
三井金属鉱業	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	
住友金属鉱山	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	
平河ヒューテック	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	
文化シヤッター	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	
東洋シヤッター	1,500	723.00	1,084,500	
ＬＩＸＩＬ	235,500	1,948.00	458,754,000	
日本フイルコン	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	
ＫｅｅＰｅｒ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	
Ｇｕｎｏｓｙ	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	
ＩＢＪ	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	
ＥＲＩ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	
ＦＵＪＩ	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	
冨士ダイス	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	
フリュー	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	
日本エアーテック	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	
酉島製作所	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	
ＴＰＲ	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	
ユーシン精機	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	

ベイカレント・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・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	
ＥＩＺＯ	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	
ＴＤＫ	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	
ＴＯＡ	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	
オプテックスグループ	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	
日本車輌製造	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	
近畿車輌	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	
ジャパンク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	
佐鳥電機	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	
メディパ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	
ドウシシャ	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	
壱番屋	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	
前田工繊	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	
プロネクサス	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	
キヤ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	
ＧＳＩ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	
トーホー	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	
ＳＲＳ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	
ＰＡＬＴＡＣ	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ユナイテッド海運	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　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,800	6,380.00	43,384,000	
コー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	
キユ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	
エーアイテイー	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ＪＳＡＴ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	
カプコン	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	
ＪＢＣＣ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	
サックスバー　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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	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	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,154,420,152円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,531,018円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	5,858,136円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	57,166,412,976円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,376,396,069円
Ｏｎｅグローバルバランス	24,283,931円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	133,558,960円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	746,042,424円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,008,349,921円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	80,763,954円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	228,321,872円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	154,712,222円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	181,896,073円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　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
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）	352,358,499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）	34,973,270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）	1,003,666,343円
ＤＩＡＭ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
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）	897,249円
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	284,746円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,185,996円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	100,421,686円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	189,082,544円

ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	664,983,101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）	28,599,230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）	24,316,972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）	160,089,087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）	5,201,783円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	131,734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）	55,805,440円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,435,280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）	20,959,688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）	36,730,767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）	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1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	6,161,615,235	－	6,156,921,004	4,694,231
アメリカ・ドル	4,679,867,040	－	4,677,290,966	2,576,074
イギリス・ポンド	243,655,167	－	243,867,044	△211,877
オーストラリア・ドル	181,704,774	－	181,466,285	238,489
カナダ・ドル	198,992,712	－	198,425,043	567,669
ユーロ	857,395,542	－	855,871,666	1,523,876
買建	1,261,995,492	－	1,261,951,623	△43,869
アメリカ・ドル	993,164,240	－	993,127,901	△36,339
イギリス・ポンド	47,972,232	－	47,966,889	△5,343
カナダ・ドル	41,150,660	－	41,147,589	△3,071
ユーロ	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）	8.5273円 (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 SOFTWRE	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	
SYNOPSYS 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	
	ASHTEAD 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-GENUSSCHEIN	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	
BRENNTAG 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	72.89	－	－	－	75.63
	投資証券	34銘柄	－	－	－	1.63	
イギリス・ポンド	株式	81銘柄	3.95	－	－	－	4.04
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.03	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.10	－	－	－	0.10
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄	1.87	－	－	－	2.02
	投資信託受益証券	7銘柄	－	－	0.12	－	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.19	－	－	－	3.25
	新株予約権証券	1銘柄	－	0.00	－	－	
	投資証券	2銘柄	－	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.29	－	－	－	0.33
	投資信託受益証券	4銘柄	－	－	0.04	－	
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	9.14	－	－	－	9.32
	投資証券	5銘柄	－	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	29銘柄	0.52	－	－	－	0.55
	投資証券	1銘柄	－	－	－	0.02	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	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	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	26,493,292,856円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	56,606,049円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	82,559,567円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	13,254,045,205円
Ｏｎｅグローバルバランス	109,311,398円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	11,158,997,183円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	16,433,739,226円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	7,579,122,762円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,661,941,245円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,760,892,923円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	5,297,839,731円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,353,396,499円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　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
Ｏｎｅ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
ＤＩＡＭ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
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	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
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）	597,580,172円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	267,019,349円
Ｏｎｅ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
Ｏｎｅ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
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	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
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）	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	

１５６回　利付国庫債券（５年）	4,300,000,000	4,295,098,000	
１５７回　利付国庫債券（５年）	4,400,000,000	4,390,276,000	
１５８回　利付国庫債券（５年）	3,600,000,000	3,577,572,000	
１５９回　利付国庫債券（５年）	2,100,000,000	2,083,893,000	
１６０回　利付国庫債券（５年）	900,000,000	896,931,000	
１６１回　利付国庫債券（５年）	1,700,000,000	1,701,445,000	
１６２回　利付国庫債券（５年）	1,600,000,000	1,599,280,000	
１６３回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,012,120,000	
１６４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	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,930,000,000	1,545,968,600	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,040,000,000	799,312,800	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,420,000,000	968,070,800	
１３回　利付国庫債券（４０年）	2,090,000,000	1,406,695,400	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,100,000,000	1,507,716,000	
１５回　利付国庫債券（４０年）	2,340,000,000	1,854,356,400	
１６回　利付国庫債券（４０年）	1,800,000,000	1,563,120,000	
３３８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	

３６４回　利付国庫債券（１０年）	5,850,000,000	5,685,673,500	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	5,430,000,000	5,262,756,000	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	4,880,000,000	4,755,511,200	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	4,600,000,000	4,470,280,000	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	4,750,000,000	4,602,750,000	
３６９回　利付国庫債券（１０年）	5,220,000,000	5,178,448,800	
３７０回　利付国庫債券（１０年）	3,700,000,000	3,663,481,000	
３７１回　利付国庫債券（１０年）	5,200,000,000	5,090,332,000	
３７２回　利付国庫債券（１０年）	5,300,000,000	5,371,550,000	
３７３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	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	274,125,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	260,843,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	168,753,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	395,981,000	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	305,734,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	282,763,200	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	315,813,600	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	464,252,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	325,413,200	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	391,023,600	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	360,762,500	
２２回　利付国庫債券（３０	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	

４９回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,281,787,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,002,455,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,177,696,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,214,385,000	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,007,695,600	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,790,000,000	1,543,588,600	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,080,000,000	928,573,200	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	891,529,600	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,430,000,000	1,222,206,700	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,660,000,000	1,414,552,400	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	928,939,200	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,153,628,700	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,160,000,000	955,898,000	
６２回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	561,268,800	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	830,775,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	977,951,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	974,103,000	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,090,000,000	813,543,300	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	998,791,500	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	1,049,153,000	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,090,448,000	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,118,768,000	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,480,000,000	1,178,686,800	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,290,000,000	1,023,873,000	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,100,504,700	
７４回　利付国庫債券（３０	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	

９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	127,579,200	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	706,675,200	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	170,750,400	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	803,130,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	895,188,200	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	249,911,100	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	545,365,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	173,835,200	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	118,574,500	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	691,840,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	542,750,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	650,442,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	741,474,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	377,331,500	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	478,737,600	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	504,882,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	808,346,400	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,502,013,200	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	410,000,000	451,246,000	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	398,268,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	588,331,800	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	518,941,100	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	611,338,050	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	511,754,800	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	702,502,400	
１２２回　利付国庫債券（２	570,000,000	622,012,500	

０年）			
１２３回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	723,742,500	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	673,662,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	565,615,500	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	595,188,000	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	408,398,600	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	999,107,200	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	32,755,500	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	692,603,100	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	220,138,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	142,027,600	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	390,520,800	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	524,904,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,141,832,000	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,063,878,200	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	929,925,500	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,060,000,000	1,160,488,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	474,569,500	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,336,813,200	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	808,680,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,467,125,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,457,257,600	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,290,000,000	1,402,371,900	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,730,000,000	2,940,728,700	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,290,000,000	2,466,146,800	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	2,930,000,000	3,125,548,200	

１５１回　利付国庫債券（２０年）	3,160,000,000	3,303,843,200	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,548,189,600	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,740,000,000	2,888,069,600	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	3,020,000,000	3,146,145,400	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,320,424,400	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,159,502,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,580,000,000	2,374,580,400	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,140,000,000	2,037,643,800	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,840,000,000	1,768,460,800	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,820,000,000	1,766,109,800	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,760,000,000	1,680,254,400	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	1,930,000,000	1,836,703,800	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,130,000,000	2,019,240,000	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,750,000,000	2,561,570,000	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,086,942,500	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,540,000,000	1,464,509,200	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	2,350,000,000	2,162,141,000	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,590,000,000	1,434,180,000	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	1,720,000,000	1,519,774,800	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,671,373,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,740,000,000	1,522,778,400	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,380,000,000	1,222,307,400	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,360,000,000	2,079,773,600	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	2,400,000,000	2,104,200,000	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,020,000,000	1,793,335,800	
１７６回　利付国庫債券（２	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			
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	206,278,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,207,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	398,148,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,585,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	94,185,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,835,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,652,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,454,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,260,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	253,164,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	224,001,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,590,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	217,154,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,580,790	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	103,242,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	103,003,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	204,416,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	156,718,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	104,615,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	100,372,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	217,624,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,774,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	385,392,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,247,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,686,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,880,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	266,455,000	

１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,268,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,372,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,541,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,960,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,122,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,711,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	496,125,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	496,125,000	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,840,000	39,907,329	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,543,000	15,064,221	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,485,000	95,785,709	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,552,000	142,884,891	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,385,000	20,082,278	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,717,000	17,323,827	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,533,000	20,165,283	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,588,000	21,254,433	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,093,000	25,847,797	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,990,000	63,256,455	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,869,000	28,521,970	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,215,000	34,628,317	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,841,000	35,263,621	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,462,000	38,844,696	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,819,000	39,913,371	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,186,000	44,456,246	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,831,000	50,305,407	
９９回貸付債権担保住宅金融	52,733,000	52,493,592	

支援機構債券			
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,941,000	191,597,462	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,846,000	65,350,624	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,335,000	64,949,320	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,696,000	65,224,419	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,506,000	202,512,764	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,575,000	202,466,696	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,312,000	137,950,727	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	215,997,000	205,963,939	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	214,077,000	204,190,924	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	373,440,000	357,221,500	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,406,000	71,119,486	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,806,000	72,557,092	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	248,163,000	232,737,187	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	330,528,000	310,894,636	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,616,000	239,825,356	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,364,000	245,340,997	
１７０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	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,518,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,686,000	
い第８５１号　利付商工債	300,000,000	297,939,000	
い第８５４号　利付商工債	300,000,000	297,525,000	
い第８５５号　利付商工債	200,000,000	198,268,000	
３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	398,684,000	
３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	298,128,000	
１５回　国際協力機構債	100,000,000	107,994,000	
７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,302,000	
７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	296,343,000	
８５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（２０１６）	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　ブリヂストン社債	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	

１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	93,764,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,387,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	91,615,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,677,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	70,904,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,969,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	170,856,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	151,326,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,064,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,132,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,165,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,315,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,483,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	170,356,000	
３２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	
４７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	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	389,628,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	188,000,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	91,992,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	194,884,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	100,812,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	299,259,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	392,436,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	172,942,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	287,532,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	194,108,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	97,410,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	101,369,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	100,988,000	
４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,502,000	
５２１回　東北電力社債	400,000,000	391,648,000	
５２５回　東北電力社債	200,000,000	197,420,000	
５３６回　東北電力社債	300,000,000	286,116,000	
３２０回　四国電力社債	300,000,000	290,127,000	
４６３回　九州電力社債	100,000,000	90,067,000	
４６６回　九州電力社債	100,000,000	88,883,000	
４９１回　九州電力社債	300,000,000	288,645,000	
４９２回　九州電力社債	100,000,000	84,127,000	
４９３回　九州電力社債	200,000,000	198,336,000	

	５０７回　九州電力社債	200,000,000	194,290,000	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	299,586,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	179,456,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	204,450,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	99,258,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	191,400,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	184,154,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	87,000,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	83,634,000	
	５７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	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	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	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,944,749,459円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,145,444円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,074,073円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,857,780,849円
Ｏｎｅ　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

ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,512,264円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,413,721円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,250,390,839円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,241,860,455円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,352,401,710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）	50,385,127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）	100,205,864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）	1,139,586,017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）	202,871,976円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	155,039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）	199,396,876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）	259,826,276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）	336,700,092円
ＤＩＡＭ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）
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 １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,712,000,000	－	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）	2.3285円 (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・シュケル　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 3.02 05/27/31	18,500,000.000	19,314,338.550	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	54,000,000.000	55,121,563.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52	9,500,000.000	10,403,317.950	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29	8,000,000.000	8,327,834.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	8,500,000.000	9,555,376.150	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	18,450,000.000	18,966,136.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30	3,000,000.000	3,175,899.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	18,500,000.000	19,310,547.900	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	4,000,000.000	4,201,476.400	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	15,820,000.000	17,907,044.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	19,100,000.000	21,695,976.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	12,450,000.000	14,560,253.830	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	5,000,000.000	5,268,585.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,600,000.000	9,149,241.760	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50	17,500,000.000	21,305,907.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	5,800,000.000	7,065,851.160	
		CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48	10,300,000.000	12,841,141.840	
	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・シュケル	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
オフショア・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・リンギット	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。

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

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「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18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
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンドの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　ＤＣ　バランス３０インデックスファンドの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、継続企業の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、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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）ＸＢＲＬ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】

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 2024年2月26日現在	第18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	206,164,871	187,897,153
親投資信託受益証券	6,308,285,211	5,595,479,540
未収入金	18,072,000	692,000
流動資産合計	6,532,522,082	5,784,068,693
資産合計	6,532,522,082	5,784,068,693
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,600,920	7,799,238
未払受託者報酬	1,039,665	1,008,134
未払委託者報酬	7,277,971	7,057,239
その他未払費用	123,293	119,537
流動負債合計	31,041,849	15,984,148
負債合計	31,041,849	15,984,148
純資産の部		
元本等		
元本	3,836,384,514	3,407,263,398
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,665,095,719	2,360,821,147
（分配準備積立金）	1,506,997,770	1,239,300,088
元本等合計	6,501,480,233	5,768,084,545
純資産合計	6,501,480,233	5,768,084,545
負債純資産合計	6,532,522,082	5,784,068,693

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自　2023年2月28日 至　2023年8月27日	第18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	1,026	78,056
有価証券売買等損益	337,053,593	4,656,329
営業収益合計	337,054,619	4,734,385
営業費用		
支払利息	48,983	838
受託者報酬	974,551	1,008,134
委託者報酬	6,822,194	7,057,239
その他費用	115,554	119,537
営業費用合計	7,961,282	8,185,748
営業利益又は営業損失（△）	329,093,337	△3,451,363
経常利益又は経常損失（△）	329,093,337	△3,451,363
中間純利益又は中間純損失（△）	329,093,337	△3,451,363
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（△）	12,850,835	5,925,319
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,901,612,355	2,665,095,719
剰余金増加額又は欠損金減少額	152,442,303	197,875,612
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	152,442,303	197,875,612
剰余金減少額又は欠損金増加額	108,417,952	492,773,502
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	108,417,952	492,773,502
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（△）	2,261,879,208	2,360,821,147

（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18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17期 2024年2月26日現在	第18期中間計算期間末 2024年8月26日現在
１．　期首元本額	3,757,866,453円	3,836,384,514円
期中追加設定元本額	536,540,036円	279,835,018円
期中一部解約元本額	458,021,975円	708,956,134円
２．　受益権の総数	3,836,384,514口	3,407,263,398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17期 2024年2月26日現在	第18期中間計算期間末 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17期 2024年2月26日現在	第18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）	1.6947円 （16,947円）	1.6929円 （16,929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
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンドの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　ＤＣ　バランス５０インデックスファンドの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、継続企業の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、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 2024年2月26日現在	第18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	385,369,865	368,393,435
親投資信託受益証券	11,843,525,549	11,123,621,471
未収入金	10,830,000	15,835,000
流動資産合計	12,239,725,414	11,507,849,906
資産合計	12,239,725,414	11,507,849,906
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,211,142	34,745,085
未払受託者報酬	1,913,294	1,968,686
未払委託者報酬	15,306,591	15,749,733
その他未払費用	226,961	233,526
流動負債合計	34,657,988	52,697,030
負債合計	34,657,988	52,697,030
純資産の部		
元本等		
元本	6,041,543,532	5,630,898,822
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,163,523,894	5,824,254,054
（分配準備積立金）	4,784,531,551	4,244,906,406
元本等合計	12,205,067,426	11,455,152,876
純資産合計	12,205,067,426	11,455,152,876
負債純資産合計	12,239,725,414	11,507,849,906

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自　2023年2月28日 至　2023年8月27日	第18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	1,889	151,020
有価証券売買等損益	952,872,719	109,845,922
営業収益合計	952,874,608	109,996,942
営業費用		
支払利息	88,933	1,555
受託者報酬	1,773,503	1,968,686
委託者報酬	14,188,306	15,749,733
その他費用	210,373	233,526
営業費用合計	16,261,115	17,953,500
営業利益又は営業損失（△）	936,613,493	92,043,442
経常利益又は経常損失（△）	936,613,493	92,043,442
中間純利益又は中間純損失（△）	936,613,493	92,043,442
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（△）	27,260,937	22,929,580
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,120,866,524	6,163,523,894
剰余金増加額又は欠損金減少額	186,798,429	305,661,676
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	186,798,429	305,661,676
剰余金減少額又は欠損金増加額	169,343,910	714,045,378
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	169,343,910	714,045,378
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（△）	5,047,673,599	5,824,254,054

（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18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17期 2024年2月26日現在	第18期中間計算期間末 2024年8月26日現在
１．　期首元本額	6,089,632,029円	6,041,543,532円
期中追加設定元本額	505,531,553円	288,782,243円
期中一部解約元本額	553,620,050円	699,426,953円
２．　受益権の総数	6,041,543,532口	5,630,898,822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17期 2024年2月26日現在	第18期中間計算期間末 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17期 2024年2月26日現在	第18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）	2.0202円 （20,202円）	2.0343円 （20,343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
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンドの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　ＤＣ　バランス７０インデックスファンドの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、継続企業の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、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

【ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第17期 2024年2月26日現在	第18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	328,604,928	299,999,135
親投資信託受益証券	9,651,070,474	9,230,221,831
未収入金	－	6,210,000
流動資産合計	9,979,675,402	9,536,430,966
資産合計	9,979,675,402	9,536,430,966
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,451,102	11,955,869
未払受託者報酬	1,519,121	1,633,106
未払委託者報酬	13,672,500	14,698,333
その他未払費用	180,197	193,723
流動負債合計	34,822,920	28,481,031
負債合計	34,822,920	28,481,031
純資産の部		
元本等		
元本	4,292,003,844	4,045,076,670
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	5,652,848,638	5,462,873,265
（分配準備積立金）	4,143,925,343	3,609,236,248
元本等合計	9,944,852,482	9,507,949,935
純資産合計	9,944,852,482	9,507,949,935
負債純資産合計	9,979,675,402	9,536,430,966

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期中間計算期間 自　2023年2月28日 至　2023年8月27日	第18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	1,466	127,771
有価証券売買等損益	968,902,977	163,835,357
営業収益合計	968,904,443	163,963,128
営業費用		
支払利息	68,938	1,298
受託者報酬	1,341,035	1,633,106
委託者報酬	12,069,733	14,698,333
その他費用	159,045	193,723
営業費用合計	13,638,751	16,526,460
営業利益又は営業損失（△）	955,265,692	147,436,668
経常利益又は経常損失（△）	955,265,692	147,436,668
中間純利益又は中間純損失（△）	955,265,692	147,436,668
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（△）	31,358,183	34,497,215
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,364,214,230	5,652,848,638
剰余金増加額又は欠損金減少額	274,036,137	457,314,346
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	274,036,137	457,314,346
剰余金減少額又は欠損金増加額	186,055,460	760,229,172
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	186,055,460	760,229,172
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（△）	4,376,102,416	5,462,873,265

（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18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17期 2024年2月26日現在	第18期中間計算期間末 2024年8月26日現在
１．　期首元本額	4,195,317,350円	4,292,003,844円
期中追加設定元本額	614,558,721円	329,458,673円
期中一部解約元本額	517,872,227円	576,385,847円
２．　受益権の総数	4,292,003,844口	4,045,076,670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17期 2024年2月26日現在	第18期中間計算期間末 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17期 2024年2月26日現在	第18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）	2.3171円 (23,171円)	2.3505円 (23,505円)

（参考）
「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド」、「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド」、「ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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＜ラップ専用＞	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
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,416,703,253円
Ｏｎｅグローバルバランス	83,943,719円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	872,110,548円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,209,720,073円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,889,269,523円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	243,375,699円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	851,939,319円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	257,237,298円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	324,600,113円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	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
ＤＩＡＭ　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２０４５）	87,190,652円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	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２０３５）	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２０４０）	83,112,314円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	49,223,152円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	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２０６５）	7,688,024円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	992,177円
Ｏｎｅ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２０１９－１２（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２０２０－０６（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２０－０８（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２０２０－０９（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２０２１－０３（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　２０２１－０４（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。

（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１年超	時価（円）	評価損益（円）
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

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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 （1万口当たり純資産額）	4.6988円 （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	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	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	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,846,185,102円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,326,759円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,348,704円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	58,056,431,491円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	3,628,081,008円
Ｏｎｅグローバルバランス	42,936,672円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	115,779,355円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	658,288,658円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	953,681,426円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	61,630,055円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	188,107,574円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	131,814,629円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	168,823,148円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　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

ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,022円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	272,595円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,185,006円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	81,153,480円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	164,930,121円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	586,172,071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）	25,824,591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）	20,654,200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）	127,486,654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）	4,116,400円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	122,903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）	39,960,185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）	3,678,774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）	14,863,447円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,057,351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）	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）

通貨関連

種類	2024年8月26日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	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１年超	時価（円）	評価損益（円）
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 （1万口当たり純資産額）	9.0241円 (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。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	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	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	31,072,566,151円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	49,680,795円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	91,497,323円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,651,078,010円
Ｏｎｅグローバルバランス	207,090,854円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	11,731,261,961円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	17,699,667,542円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	8,077,403,023円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,504,735,230円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,852,368,441円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	5,765,367,836円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	2,613,532,798円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　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
Ｏｎｅ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
ＤＩＡＭ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
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	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
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）	201,195,176円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	271,240,981円
Ｏｎｅ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
Ｏｎｅ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 （1万口当たり純資産額）	1.2202円 （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	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	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	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,462,016,258円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,477,145円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,887,977円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	7,004,210,936円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	2,088,358,771円
Ｏｎｅグローバルバランス	115,080,200円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	717,155,503円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,518,705,542円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,997,355,272円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	358,167,122円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	828,811,106円
ＤＩＡＭ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	154,157,168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）	280,555,631円
クルーズコントロール	109,636,898円
ＤＩＡＭ　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
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	5,086,434円
Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	54,460,068円
ＤＩＡＭ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
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）	6,014,090,179円
ＤＩＡＭ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
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）	75,955,441円
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,671,453円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,813,409円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,343円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,563,651円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,021,830円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,086,642,851円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,171,364,152円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,241,253,637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）	48,527,723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）	90,598,157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）	973,648,995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）	178,494,892円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	153,671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）	152,774,994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）	153,086,731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）	314,980,576円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（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 （1万口当たり純資産額）	2.3438円 （23,438円）

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド

2024年8月30日現在

Ⅰ　資産総額	5,819,435,921円
Ⅱ　負債総額	7,556,884円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,811,879,037円
Ⅳ　発行済数量	3,419,476,558口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6996円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド

2024年8月30日現在

Ⅰ　資産総額	11,586,541,754円
Ⅱ　負債総額	10,484,691円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,576,057,063円
Ⅳ　発行済数量	5,648,882,086口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0493円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド

2024年8月30日現在

Ⅰ　資産総額	9,652,085,274円
Ⅱ　負債総額	13,287,295円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,638,797,979円
Ⅳ　発行済数量	4,057,238,771口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3757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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【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、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）ＸＢＲＬ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
ソフトウエア		3,367		2,951
ソフトウエア仮勘定		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								
	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	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

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、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 (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エアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。 (3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6. 収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

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

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	ソフトウエア仮勘定	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エ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エア仮勘定について、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 A種種類 株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日

(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

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
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	2,895	3,406
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	－	－
繰延税金資産の純額	2,895	3,406

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

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (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	26.87 %	29.04 %

（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. 発生したのれんの金額	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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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 ＤＣ バランス３０インデックスファンド
約　　款

運用の基本方針

約款第19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35％以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、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35％以下とします。

7）有価証券先物取引等は約款第24条の範囲で行います。

8）スワップ取引は約款第25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26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 ＤＣ バランス３０インデックスファンド
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（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

＜信託の目的、金額および限度額＞
第3条　委託者は、金300,000,000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52条第7項、第53条第1項、第54条第１項、第55条第1項および第57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300,000,000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、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。

＜受益証券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証券の取得申込みの勧誘は、証券取引法第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13項で定める公募により行われます。
＜平成19年1月4日以降、第6条は以下の通り変更されます。＞
＜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証券取得申込者とし、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。
＜平成19年1月4日以降、第7条は以下の通り変更されます。＞
＜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計算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32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。

＜受益証券の発行および種類＞

第10条　委託者は第5条の規定により分割された受益権を表示する無記名式の受益証券を発行します。

②委託者は、１口の整数倍の口数を表示した無記名式の受益証券を発行します。

③前2項の規定により発行された受益証券は、「累積投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下、「別に定める契約」といいます。）または第47条の規定に基づいて大券をもって混蔵保管されるため、委託者は受益者の請求に基づく記名式の受益証券への変更を行いません。

④この信託のすべての受益権は、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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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。）。

⑤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、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。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（証券取引法第2条第9項に規定する証券会社をいい、外国証券業者に関する法律第2条第2号に規定する外国証券会社を含みます。以下同じ。）および登録金融機関（証券取引法第65条の2第3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。

⑥この信託のすべての受益権は、社振法に基づく投資信託振替制度へ移行するため、受益者は受益証券を保護預り契約にしたがって委託者の指定する証券会社および登録金融機関の保護預りとするものとし、受益証券の引き出しの請求は行わないものとします。

＜平成19年1月4日以降、第10条は以下の通り変更されます。＞

＜受益権の帰属と受益証券の不発行＞

第10条　この信託のすべての受益権は、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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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います。

＜受益証券の発行についての受託者の認証＞

第11条　委託者は、前条の規定により受益証券を発行する時は、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

②前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

＜平成19年1月4日以降、第11条は以下の通り変更されます。＞

＜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います。

＜受益証券の申込単位および取得価額等＞

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10条の規定により発行された受益証券を、別に定める契約を結んだ受益証券取得申込者に限り、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（以下、「海外休業日」といいます。）に該当する場合は、受益証券の取得申込みに応じません。

なお、第10条の規定により発行される受益証券の取得申込者は、社振法に基づく投資信託振替制度への移行の取り扱いを規定した別に定める保護預り約款および当該投資信託振替制度に移行した振替受益権の管理について定めた投資信託受益権振替決済口座管理約款にしたがって委託者の指定する証券会社および登録金融機関と契約を結んだものに限るものとします。

②前項の受益証券の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第3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3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。

③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。

④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49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証券の取得価額は、第42条に規定する各

計算期間終了日の基準価額とします。

⑤前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券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、受益証券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。

＜平成19年1月4日以降、第12条は以下の通り変更となります。＞

＜受益権の申込単位および取得価額等＞

第12条　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。）は、第5条の規定により分割される受益権を、「累積投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下、「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、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（以下、「海外休業日」といいます。）に該当する場合には、受益権の取得申込みに応じません。

②前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、当該基準価額に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および当該手数料にかかる消費税ならびに地方消費税（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みにかかる取得価額は、1口につき1円に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および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

③前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第42条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

④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、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2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うことができます。

⑤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。）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、受益権の取得申込みの受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。

＜受益証券の再交付＞

第13条　受益証券を喪失した受益者が、当該受益証券の公示催告による除権判決の謄本を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求したときは、委託者は、受益証券を再交付します。

＜平成19年1月4日以降、第13条は以下の通り変更となり、また第13条の2が追加されます。＞

＜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ます。

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ます。ただし、前項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13条の2　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。

＜受益証券を毀損した場合等の再交付＞

第14条　受益証券を毀損または汚損した受益者が、受益証券を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求した時は、委託者は、受益証券を再交付します。ただし、真偽を鑑別しがたいときは、前条の規定を準用します。

＜平成19年1月4日以降、第14条は削除されます。＞

＜受益証券の再交付の費用＞

第15条　受益証券を再交付するときは、委託者は、受益者に対して実費を請求することができます。

＜平成19年1月4日以降、第15条は削除されます。＞

＜投資の対象とする資産の種類＞

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）
   ハ. 金銭債権
   ニ. 約束手形
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17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（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定

めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で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。

＜受託者の自己または利害関係人等との取引＞

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第33条において同じ。）、第33条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条、第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

②前項の取扱いは、第23条から第29条、第32条、第37条、第38条における委託者の指図による取引についても同様とします。

＜運用の基本方針＞

第19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20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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②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ます。

＜同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限＞

第21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22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定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第22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23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書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24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17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17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17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17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17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25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。

＜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26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、当該信託財産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。

＜デリバティブ取引等にかかる投資制限＞

第26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27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たときは、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28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29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たときは、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30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35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35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31条　外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる

場合には、制約されることがあります。

＜外国為替予約の指図＞

第32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。

＜信託業務の委託等＞

第33条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１.委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２.委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３.委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること

４.内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１.信託財産の保存に係る業務

２.信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３.委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

４.受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第34条　（削除）

＜混蔵寄託＞

第35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36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37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38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39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40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41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42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計算期間は信託契約締結日から平成20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43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44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42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45条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第42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年10,000分の24の率を乗じて得た額とします。

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

２.売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」と言います。）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、監査報酬および当該監査報酬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前項第1号および第2号におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

＜受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い＞

第47条　委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該証券会社および登録金融機関の募集にかかる第10条の規定により発行された受益証券の混蔵保管および返還請求等の取扱いについては、別に定める契約によるものとします。

＜平成19年1月4日以降、第47条は削除されます。＞

＜収益分配金、償還金および一部解約金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責＞

第48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50条第1項に規定する支払開始日の前日までに、一部解約金（第52条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第50条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者に交付します。

②受託者は、前項の規定により委託者に収益分配金、償還金および一部解約金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

＜平成19年1月4日以降、第48条は以下の通り変更となります。＞

＜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48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50条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第52条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第50条第2項に規定する支払開始日までに、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49条　委託者は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付します。

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証券の売付けを行います。

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証券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50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証券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証券の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益証券の価額をいい、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。

＜平成19年1月4日以降、第49条は以下の通り変更となります。＞

＜収益分配金の再投資等＞

第49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50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50条　償還金は、信託終了後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証券の価額等に応じて計算されるものとします。

＜平成19年1月4日以降、第50条は以下の通り変更となります。＞

＜償還金および一部解約金の支払い＞

第50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。

②一部解約金は、第52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51条　受益者が、信託終了による償還金について第50条第1項に規定する支払開始日から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。

＜平成19年1月4日以降、第51条は以下の通り変更となります。＞

＜償還金の時効＞

第51条　受益者が、信託終了による償還金について第50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52条　受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己の有する受益証券につき、委託者に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海外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受益者が前項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、受益証券をもって行うものとします。

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。

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、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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、当該受益証券の一部解約の価額は、当該受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53条の規定を準用するものとします。

＜平成19年1月4日以降、第52条は以下の通り変更となります。＞

＜信託契約の一部解約＞

第52条　受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に、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海外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この信託の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、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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53条の規定を準用するものとします。

＜信託契約の解約＞

第53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54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58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55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58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56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57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58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58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59条　第53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53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、受益証券の買取を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、第53条第2項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

＜平成19年1月4日以降、第59条は以下の通り変更となります。＞

＜反対者の買取請求権＞

第59条　第53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53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、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、第53条第2項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

＜公告＞

第60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。

＜平成19年1月4日以降、第60条の次に第60条の2として以下が追加となります。＞

＜質権口記載又は記録の受益権の取り扱い＞

第60条の2　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。

＜運用報告書に記載すべき事項の提供＞

第61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62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。

（付則）

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証券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。

＜平成19年1月4日以降、付則第1条は以下の通り変更となり、付則第2条が追加されます。＞

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26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26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１８年１２月２７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 ＤＣ バランス５０インデックスファンド
約　　款

運用の基本方針

約款第19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45％以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、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45％以下とします。

7）有価証券先物取引等は約款第24条の範囲で行います。

8）スワップ取引は約款第25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26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 ＤＣ バランス５０インデックスファンド
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（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

＜信託の目的、金額および限度額＞
第3条　委託者は、金300,000,000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52条第7項、第53条第1項、第54条第１項、第55条第1項および第57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300,000,000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、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。

＜受益証券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証券の取得申込みの勧誘は、証券取引法第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13項で定める公募により行われます。
＜平成19年1月4日以降、第6条は以下の通り変更されます。＞
＜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証券取得申込者とし、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。
＜平成19年1月4日以降、第7条は以下の通り変更されます。＞
＜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計算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32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。

＜受益証券の発行および種類＞

第10条　委託者は第5条の規定により分割された受益権を表示する無記名式の受益証券を発行します。

②委託者は、１口の整数倍の口数を表示した無記名式の受益証券を発行します。

③前2項の規定により発行された受益証券は、「累積投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下、「別に定める契約」といいます。）または第47条の規定に基づいて大券をもって混蔵保管されるため、委託者は受益者の請求に基づく記名式の受益証券への変更を行いません。

④この信託のすべての受益権は、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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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。）。

⑤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、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。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（証券取引法第2条第9項に規定する証券会社をいい、外国証券業者に関する法律第2条第2号に規定する外国証券会社を含みます。以下同じ。）および登録金融機関（証券取引法第65条の2第3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。

⑥この信託のすべての受益権は、社振法に基づく投資信託振替制度へ移行するため、受益者は受益証券を保護預り契約にしたがって委託者の指定する証券会社および登録金融機関の保護預りとするものとし、受益証券の引き出しの請求は行わないものとします。

＜平成19年1月4日以降、第10条は以下の通り変更されます。＞

＜受益権の帰属と受益証券の不発行＞

第10条　この信託のすべての受益権は、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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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います。

＜受益証券の発行についての受託者の認証＞

第11条　委託者は、前条の規定により受益証券を発行する時は、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

②前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

＜平成19年1月4日以降、第11条は以下の通り変更されます。＞

＜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います。

＜受益証券の申込単位および取得価額等＞

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10条の規定により発行された受益証券を、別に定める契約を結んだ受益証券取得申込者に限り、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（以下、「海外休業日」といいます。）に該当する場合は、受益証券の取得申込みに応じません。

なお、第10条の規定により発行される受益証券の取得申込者は、社振法に基づく投資信託振替制度への移行の取り扱いを規定した別に定める保護預り約款および当該投資信託振替制度に移行した振替受益権の管理について定めた投資信託受益権振替決済口座管理約款にしたがって委託者の指定する証券会社および登録金融機関と契約を結んだものに限るものとします。

②前項の受益証券の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第3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3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。

③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。

④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49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証券の取得価額は、第42条に規定する各

計算期間終了日の基準価額とします。

⑤前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券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、受益証券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。

＜平成19年1月4日以降、第12条は以下の通り変更となります。＞

＜受益権の申込単位および取得価額等＞

第12条　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。）は、第5条の規定により分割される受益権を、「累積投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下、「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、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（以下、「海外休業日」といいます。）に該当する場合には、受益権の取得申込みに応じません。

②前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、当該基準価額に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および当該手数料にかかる消費税ならびに地方消費税（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みにかかる取得価額は、1口につき1円に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および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

③前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第42条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

④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、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2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うことができます。

⑤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。）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、受益権の取得申込みの受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。

＜受益証券の再交付＞

第13条　受益証券を喪失した受益者が、当該受益証券の公示催告による除権判決の謄本を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求したときは、委託者は、受益証券を再交付します。

＜平成19年1月4日以降、第13条は以下の通り変更となり、また第13条の2が追加されます。＞

＜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ます。

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ます。ただし、前項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13条の2　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。

＜受益証券を毀損した場合等の再交付＞

第14条　受益証券を毀損または汚損した受益者が、受益証券を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求した時は、委託者は、受益証券を再交付します。ただし、真偽を鑑別しがたいときは、前条の規定を準用します。

＜平成19年1月4日以降、第14条は削除されます。＞

＜受益証券の再交付の費用＞

第15条　受益証券を再交付するときは、委託者は、受益者に対して実費を請求することができます。

＜平成19年1月4日以降、第15条は削除されます。＞

＜投資の対象とする資産の種類＞

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）
   ハ. 金銭債権
   ニ. 約束手形
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17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（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定

めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で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。

＜受託者の自己または利害関係人等との取引＞

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第33条において同じ。）、第33条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条、第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

②前項の取扱いは、第23条から第29条、第32条、第37条、第38条における委託者の指図による取引についても同様とします。

＜運用の基本方針＞

第19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20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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②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ます。

＜同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限＞

第21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22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定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第22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23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書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24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17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17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17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17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17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25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。

＜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26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、当該信託財産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。

＜デリバティブ取引等にかかる投資制限＞

第26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27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たときは、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28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29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たときは、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30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45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45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31条　外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる

場合には、制約されることがあります。

＜外国為替予約の指図＞

第32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。

＜信託業務の委託等＞

第33条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１.委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２.委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３.委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること

４.内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１.信託財産の保存に係る業務

２.信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３.委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

４.受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第34条　（削除）

＜混蔵寄託＞

第35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36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37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38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39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40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41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42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計算期間は信託契約締結日から平成20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43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44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42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45条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第42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年10,000分の27の率を乗じて得た額とします。

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

２.売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」と言います。）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、監査報酬および当該監査報酬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前項第1号および第2号におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

＜受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い＞

第47条　委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該証券会社および登録金融機関の募集にかかる第10条の規定により発行された受益証券の混蔵保管および返還請求等の取扱いについては、別に定める契約によるものとします。

＜平成19年1月4日以降、第47条は削除されます。＞

＜収益分配金、償還金および一部解約金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責＞

第48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50条第1項に規定する支払開始日の前日までに、一部解約金（第52条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第50条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者に交付します。

②受託者は、前項の規定により委託者に収益分配金、償還金および一部解約金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

＜平成19年1月4日以降、第48条は以下の通り変更となります。＞

＜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48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50条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第52条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第50条第2項に規定する支払開始日までに、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49条　委託者は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付します。

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証券の売付けを行います。

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証券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50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証券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証券の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益証券の価額をいい、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。

＜平成19年1月4日以降、第49条は以下の通り変更となります。＞

＜収益分配金の再投資等＞

第49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50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50条　償還金は、信託終了後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証券の価額等に応じて計算されるものとします。

＜平成19年1月4日以降、第50条は以下の通り変更となります。＞

＜償還金および一部解約金の支払い＞

第50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。

②一部解約金は、第52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51条　受益者が、信託終了による償還金について第50条第1項に規定する支払開始日から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。

＜平成19年1月4日以降、第51条は以下の通り変更となります。＞

＜償還金の時効＞

第51条　受益者が、信託終了による償還金について第50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52条　受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己の有する受益証券につき、委託者に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海外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受益者が前項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、受益証券をもって行うものとします。

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。

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、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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、当該受益証券の一部解約の価額は、当該受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53条の規定を準用するものとします。

＜平成19年1月4日以降、第52条は以下の通り変更となります。＞

＜信託契約の一部解約＞

第52条　受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に、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海外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この信託の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、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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53条の規定を準用するものとします。

＜信託契約の解約＞

第53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54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58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55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58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56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57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58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58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59条　第53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53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、受益証券の買取を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、第53条第2項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

＜平成19年1月4日以降、第59条は以下の通り変更となります。＞

＜反対者の買取請求権＞

第59条　第53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53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、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、第53条第2項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

＜公告＞

第60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。

＜平成19年1月4日以降、第60条の次に第60条の2として以下が追加となります。＞

＜質権口記載又は記録の受益権の取り扱い＞

第60条の2　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。

＜運用報告書に記載すべき事項の提供＞

第61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62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。

（付則）

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証券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。

＜平成19年1月4日以降、付則第1条は以下の通り変更となり、付則第2条が追加されます。＞

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26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26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１８年１２月２７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 ＤＣ バランス７０インデックスファンド
約　　款

運用の基本方針

約款第19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％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80％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24条の範囲で行います。

8）スワップ取引は約款第25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26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 ＤＣ バランス７０インデックスファンド
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（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

＜信託の目的、金額および限度額＞
第3条　委託者は、金300,000,000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52条第7項、第53条第1項、第54条第１項、第55条第1項および第57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300,000,000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、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。

＜受益証券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証券の取得申込みの勧誘は、証券取引法第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13項で定める公募により行われます。
＜平成19年1月4日以降、第6条は以下の通り変更されます。＞
＜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証券取得申込者とし、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。
＜平成19年1月4日以降、第7条は以下の通り変更されます。＞
＜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計算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32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。

＜受益証券の発行および種類＞

第10条　委託者は第5条の規定により分割された受益権を表示する無記名式の受益証券を発行します。

②委託者は、１口の整数倍の口数を表示した無記名式の受益証券を発行します。

③前2項の規定により発行された受益証券は、「累積投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下、「別に定める契約」といいます。）または第47条の規定に基づいて大券をもって混蔵保管されるため、委託者は受益者の請求に基づく記名式の受益証券への変更を行いません。

④この信託のすべての受益権は、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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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。）。

⑤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、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。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（証券取引法第2条第9項に規定する証券会社をいい、外国証券業者に関する法律第2条第2号に規定する外国証券会社を含みます。以下同じ。）および登録金融機関（証券取引法第65条の2第3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。

⑥この信託のすべての受益権は、社振法に基づく投資信託振替制度へ移行するため、受益者は受益証券を保護預り契約にしたがって委託者の指定する証券会社および登録金融機関の保護預りとするものとし、受益証券の引き出しの請求は行わないものとします。

＜平成19年1月4日以降、第10条は以下の通り変更されます。＞

＜受益権の帰属と受益証券の不発行＞

第10条　この信託のすべての受益権は、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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの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います。

＜受益証券の発行についての受託者の認証＞

第11条　委託者は、前条の規定により受益証券を発行する時は、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

②前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

＜平成19年1月4日以降、第11条は以下の通り変更されます。＞

＜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います。

＜受益証券の申込単位および取得価額等＞

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10条の規定により発行された受益証券を、別に定める契約を結んだ受益証券取得申込者に限り、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（以下、「海外休業日」といいます。）に該当する場合は、受益証券の取得申込みに応じません。

なお、第10条の規定により発行される受益証券の取得申込者は、社振法に基づく投資信託振替制度への移行の取り扱いを規定した別に定める保護預り約款および当該投資信託振替制度に移行した振替受益権の管理について定めた投資信託受益権振替決済口座管理約款にしたがって委託者の指定する証券会社および登録金融機関と契約を結んだものに限るものとします。

②前項の受益証券の取得価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、第3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3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。

③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。

④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49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証券の取得価額は、第42条に規定する各

計算期間終了日の基準価額とします。

⑤前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券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、受益証券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。

＜平成19年1月4日以降、第12条は以下の通り変更となります。＞

＜受益権の申込単位および取得価額等＞

第12条　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。）は、第5条の規定により分割される受益権を、「累積投資約款」に基づいて取得申込者が結んだ契約（以下、「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、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（以下、「海外休業日」といいます。）に該当する場合には、受益権の取得申込みに応じません。

②前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、当該基準価額に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および当該手数料にかかる消費税ならびに地方消費税（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みにかかる取得価額は、1口につき1円に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および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

③前項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第42条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

④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、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2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うことができます。

⑤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。）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、受益権の取得申込みの受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。

＜受益証券の再交付＞

第13条　受益証券を喪失した受益者が、当該受益証券の公示催告による除権判決の謄本を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求したときは、委託者は、受益証券を再交付します。

＜平成19年1月4日以降、第13条は以下の通り変更となり、また第13条の2が追加されます。＞

＜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ます。

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ます。ただし、前項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13条の2　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。

＜受益証券を毀損した場合等の再交付＞

第14条　受益証券を毀損または汚損した受益者が、受益証券を添え、委託者の定める手続きにより再交付を請求した時は、委託者は、受益証券を再交付します。ただし、真偽を鑑別しがたいときは、前条の規定を準用します。

＜平成19年1月4日以降、第14条は削除されます。＞

＜受益証券の再交付の費用＞

第15条　受益証券を再交付するときは、委託者は、受益者に対して実費を請求することができます。

＜平成19年1月4日以降、第15条は削除されます。＞

＜投資の対象とする資産の種類＞

第16条　この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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24条、第25条および第26条に定めるものに限ります。）
   ハ. 金銭債権
   ニ. 約束手形
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17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（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定

めるものをいいます。）
12. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
16. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、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. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
18. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
26. 外国の者に対する権利で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80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。

＜受託者の自己または利害関係人等との取引＞

第18条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第33条において同じ。）、第33条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条、第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

②前項の取扱いは、第23条から第29条、第32条、第37条、第38条における委託者の指図による取引についても同様とします。

＜運用の基本方針＞

第19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20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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②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ます。

＜同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限＞

第21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22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定めがあるものの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第22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23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書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24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17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17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17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17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17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25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。

＜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26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、当該信託財産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。

＜デリバティブ取引等にかかる投資制限＞

第26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27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たときは、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28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29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たときは、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30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31条　外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる

場合には、制約されることがあります。

＜外国為替予約の指図＞

第32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。

＜信託業務の委託等＞

第33条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

１.委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと

２.委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること

３.委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること

４.内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前２項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

１.信託財産の保存に係る業務

２.信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務

３.委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

４.受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第34条　（削除）

＜混蔵寄託＞

第35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36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37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38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39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40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41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42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計算期間は信託契約締結日から平成20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43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44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42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45条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第42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年10,000分の30の率を乗じて得た額とします。

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

２.売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」と言います。）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、監査報酬および当該監査報酬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前項第1号および第2号におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

＜受益証券の混蔵保管および返還請求の取扱い＞

第47条　委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該証券会社および登録金融機関の募集にかかる第10条の規定により発行された受益証券の混蔵保管および返還請求等の取扱いについては、別に定める契約によるものとします。

＜平成19年1月4日以降、第47条は削除されます。＞

＜収益分配金、償還金および一部解約金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責＞

第48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50条第1項に規定する支払開始日の前日までに、一部解約金（第52条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第50条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者に交付します。

②受託者は、前項の規定により委託者に収益分配金、償還金および一部解約金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

＜平成19年1月4日以降、第48条は以下の通り変更となります。＞

＜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48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50条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第52条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第50条第2項に規定する支払開始日までに、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49条　委託者は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付します。

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証券の売付けを行います。

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証券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50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証券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証券の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益証券の価額をいい、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。

＜平成19年1月4日以降、第49条は以下の通り変更となります。＞

＜収益分配金の再投資等＞

第49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50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50条　償還金は、信託終了後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証券の価額等に応じて計算されるものとします。

＜平成19年1月4日以降、第50条は以下の通り変更となります。＞

＜償還金および一部解約金の支払い＞

第50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。

②一部解約金は、第52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51条　受益者が、信託終了による償還金について第50条第1項に規定する支払開始日から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。

＜平成19年1月4日以降、第51条は以下の通り変更となります。＞

＜償還金の時効＞

第51条　受益者が、信託終了による償還金について第50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52条　受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己の有する受益証券につき、委託者に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海外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受益者が前項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、受益証券をもって行うものとします。

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。

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、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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、当該受益証券の一部解約の価額は、当該受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53条の規定を準用するものとします。

＜平成19年1月4日以降、第52条は以下の通り変更となります。＞

＜信託契約の一部解約＞

第52条　受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に、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海外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この信託の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、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受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付けが中止された場合には、受益者は当該受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53条の規定を準用するものとします。

＜信託契約の解約＞

第53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54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58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55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58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56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57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58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58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59条　第53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53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、受益証券の買取を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、第53条第2項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

＜平成19年1月4日以降、第59条は以下の通り変更となります。＞

＜反対者の買取請求権＞

第59条　第53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53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、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、第53条第2項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

＜公告＞

第60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。

＜平成19年1月4日以降、第60条の次に第60条の2として以下が追加となります。＞

＜質権口記載又は記録の受益権の取り扱い＞

第60条の2　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。

＜運用報告書に記載すべき事項の提供＞

第61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62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。

（付則）

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証券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。

＜平成19年1月4日以降、付則第1条は以下の通り変更となり、付則第2条が追加されます。＞

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26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26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１８年１２月２７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条の範囲で行ないます。
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。