

DIAMDC バランスインデックスファンド

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

追加型投信／内外／資産複合（インデックス型）

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

各ファンドは、実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券の4つのアセット（資産）に投資し、基本アロケーションによる合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

作成対象期間 2025年2月26日～2026年2月25日

| 第19期 | | 決算日：2026年2月25日 |
|-------------------------|-----------|----------------|
| 第19期末（2026年2月25日） | | |
| DIAMDC バランス30インデックスファンド | | |
| 基準価額 | 18,645円 | |
| 純資産総額 | 6,538百万円 | |
| 第19期 | 騰落率 | 9.5% |
| | 分配金合計 | 0円 |
| DIAMDC バランス50インデックスファンド | | |
| 基準価額 | 24,769円 | |
| 純資産総額 | 13,779百万円 | |
| 第19期 | 騰落率 | 19.1% |
| | 分配金合計 | 0円 |
| DIAMDC バランス70インデックスファンド | | |
| 基準価額 | 31,387円 | |
| 純資産総額 | 12,956百万円 | |
| 第19期 | 騰落率 | 28.5% |
| | 分配金合計 | 0円 |

(注1) 騰落率は分配金再投資基準価額の騰落率を表示しています。

(注2) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

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

■運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター **0120-104-694**

（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

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

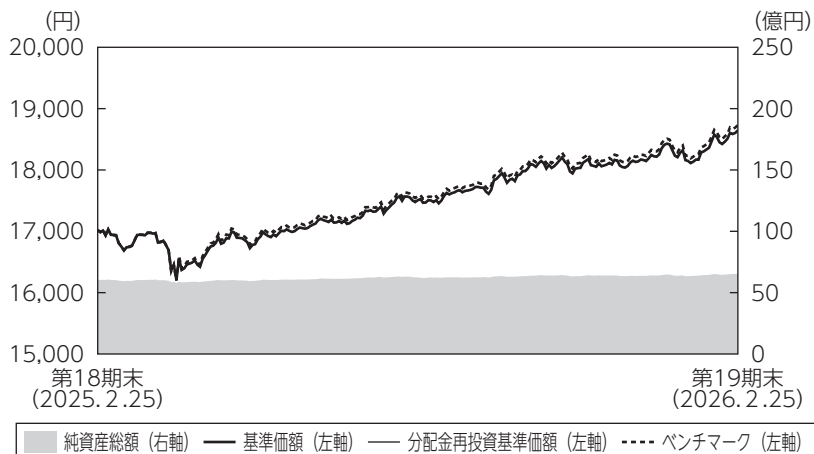
アセットマネジメントOne 株式会社

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

運用経過の説明

D I A M D C バランス30インデックスファンド

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

日銀の金融政策正常化の動きや財政拡張に対する懸念などから、国内の長期金利が上昇したこと等がマイナス寄与しました。一方、米国の底堅い景況感や利下げ期待、堅調な企業業績等から国内外の株式市場が上昇したこと、為替市場で多くの通貨に対して円安となったことがプラス寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 44.6% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △4.7% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 24.0% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 14.0% |

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第19期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
| | (2025年2月26日 ～2026年2月25日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 46円 | 0.264% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は17,509円です。 |
| (投信会社) | (17) | (0.099) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (23) | (0.132) | 販売会社分は、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 |
| (受託会社) | (6) | (0.033) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.000 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.008 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (1) | (0.004) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 48 | 0.273 | |

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

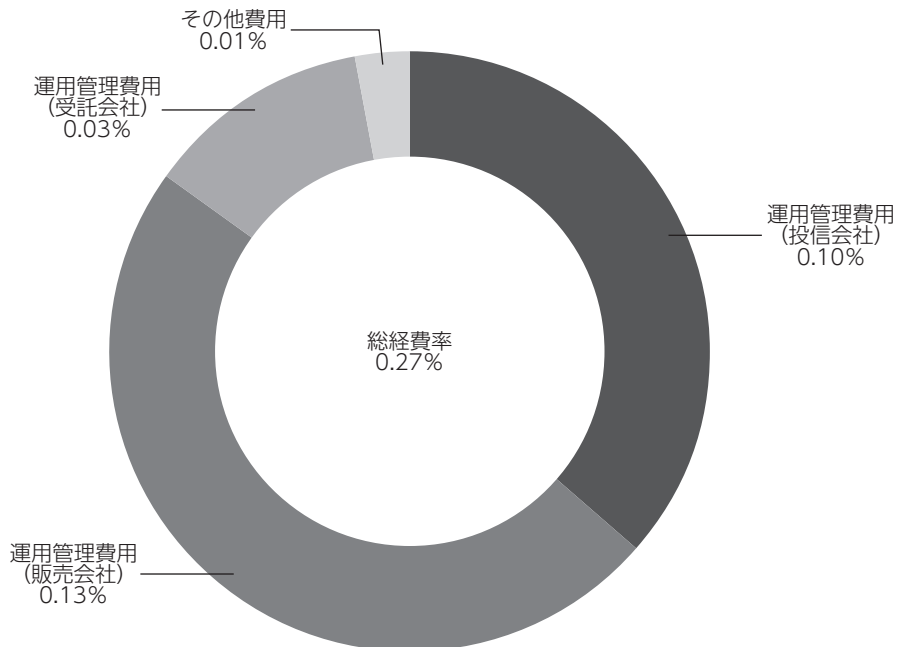
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

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



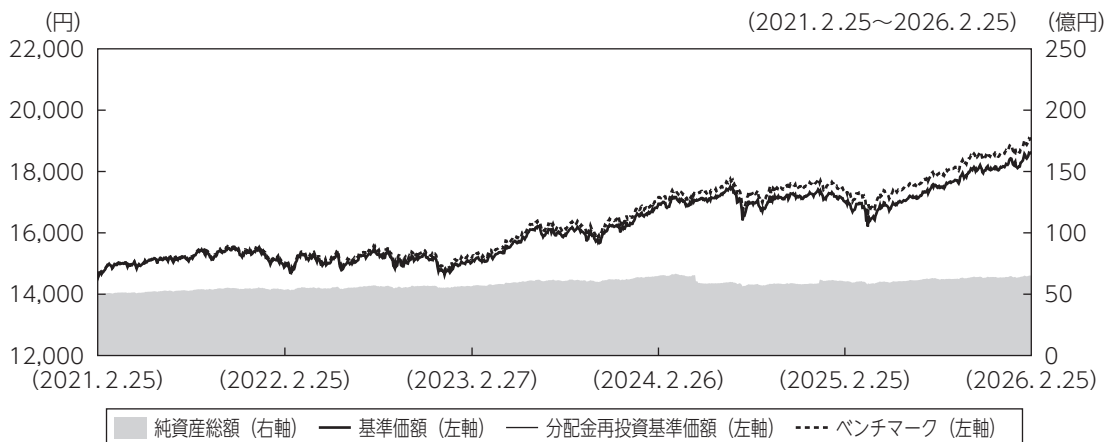
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

最近5年間の基準価額等の推移

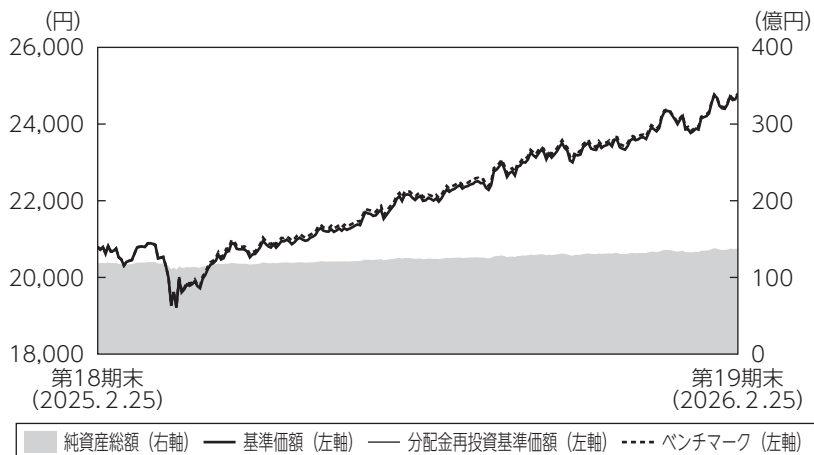


- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、2021年2月25日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2021年2月25日 期首 | 2022年2月25日 決算日 | 2023年2月27日 決算日 | 2024年2月26日 決算日 | 2025年2月25日 決算日 | 2026年2月25日 決算日 |
|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落) (円) | 14,732 | 14,905 | 15,060 | 16,947 | 17,020 | 18,645 |
| 期間分配金合計 (税引前) (円) | — | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | — | 1.2 | 1.0 | 12.5 | 0.4 | 9.5 |
| ベンチマークの騰落率 (%) | — | 1.6 | 1.6 | 12.9 | 1.1 | 10.1 |
| 純資産総額 (百万円) | 4,946 | 5,360 | 5,659 | 6,501 | 6,049 | 6,538 |

D I A M D C バランス50インデックスファンド

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

日銀の金融政策正常化の動きや財政拡張に対する懸念などから、国内の長期金利が上昇したこと等がマイナス寄与しました。一方、米国の底堅い景況感や利下げ期待、堅調な企業業績等から国内外の株式市場が上昇したこと、為替市場で多くの通貨に対して円安となったことがプラス寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 44.6% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △4.7% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 24.0% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 14.0% |

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第19期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
| | (2025年2月26日 ～2026年2月25日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 66円 | 0.297% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は22,090円です。 |
| (投信会社) | (26) | (0.115) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (33) | (0.148) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社) | (7) | (0.033) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.000 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.009 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (1) | (0.005) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 68 | 0.307 | |

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

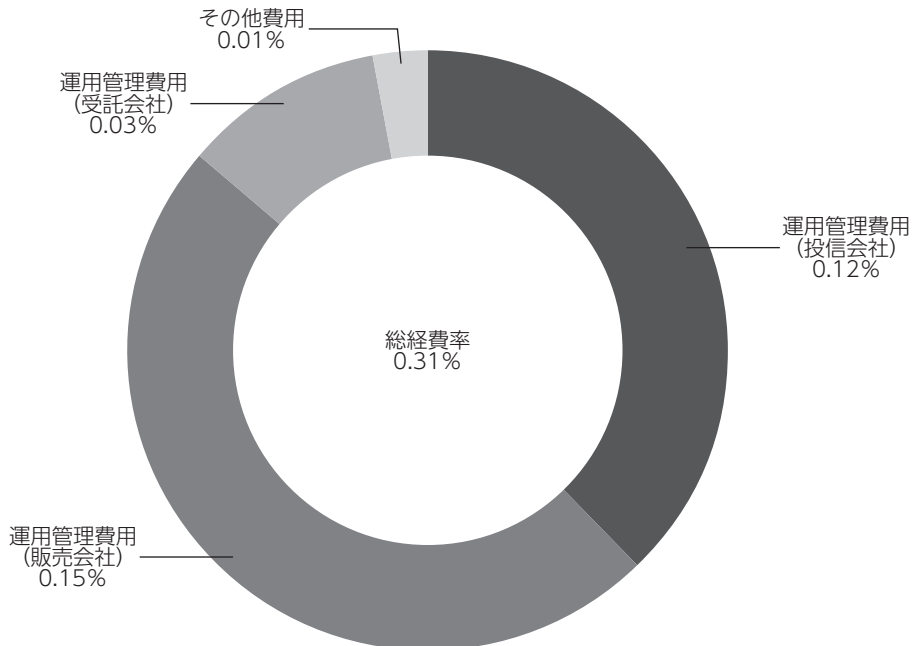
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

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



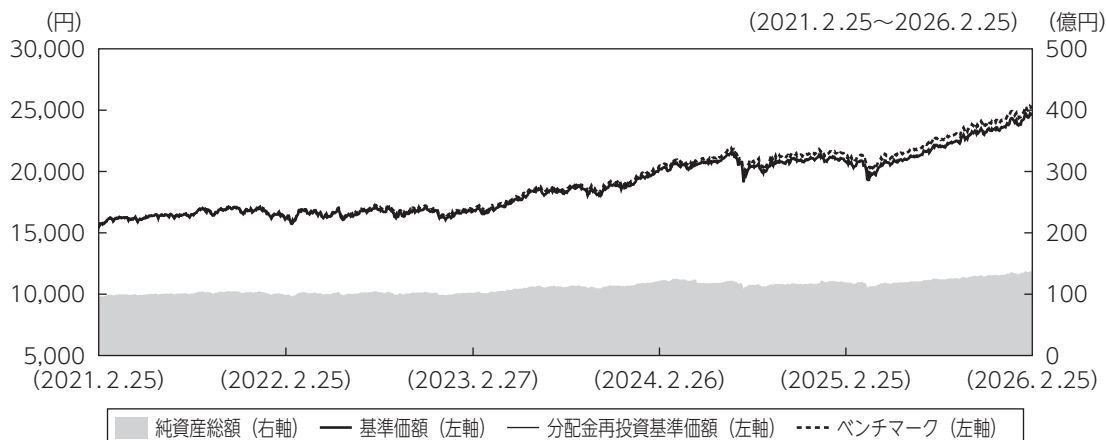
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

最近5年間の基準価額等の推移

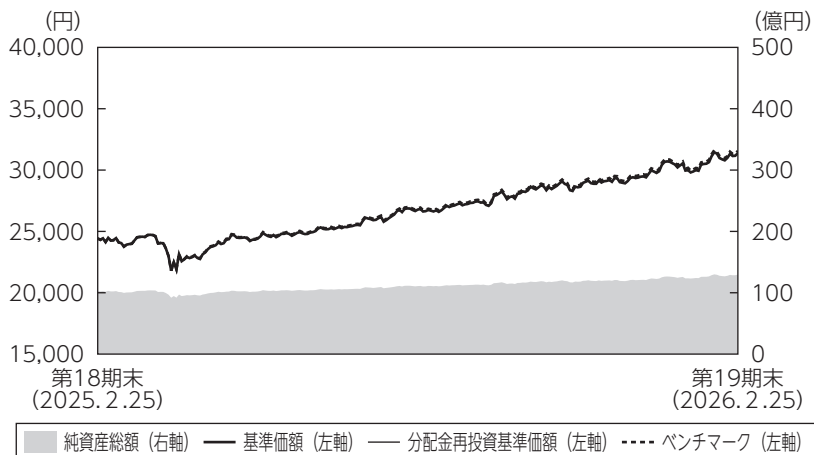


- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、2021年2月25日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2021年2月25日 期首 | 2022年2月25日 決算日 | 2023年2月27日 決算日 | 2024年2月26日 決算日 | 2025年2月25日 決算日 | 2026年2月25日 決算日 |
|----------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額（分配落） | (円) 15,834 | 16,169 | 16,767 | 20,202 | 20,795 | 24,769 |
| 期間分配金合計（税引前） | (円) - | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 | (%) - | 2.1 | 3.7 | 20.5 | 2.9 | 19.1 |
| ベンチマークの騰落率 | (%) - | 2.5 | 4.5 | 20.7 | 3.8 | 19.3 |
| 純資産総額 | (百万円) 9,692 | 9,872 | 10,210 | 12,205 | 11,895 | 13,779 |

DIAMDC バランス70インデックスファンド

基準価額等の推移



第19期首： 24,427円
 第19期末： 31,387円
 (既払分配金0円)
 騰落率： 28.5%
 (分配金再投資ベース)

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

基準価額の主な変動要因

日銀の金融政策正常化の動きや財政拡張に対する懸念などから、国内の長期金利が上昇したこと等がマイナス寄与しました。一方、米国の底堅い景況感や利下げ期待、堅調な企業業績等から国内外の株式市場が上昇したこと、為替市場で多くの通貨に対して円安となったことがプラス寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|-----------------------------|-------|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 44.6% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △4.7% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 24.0% |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 14.0% |

1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第19期 | | 項目の概要 |
|-------------|-----------------------------|---------|--|
| | (2025年2月26日 ～2026年2月25日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 88円 | 0.330% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は26,766円です。 |
| (投信会社) | (35) | (0.132) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (44) | (0.165) | 販売会社分は、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 |
| (受託会社) | (9) | (0.033) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 3 | 0.010 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (2) | (0.006) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.004) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 92 | 0.342 | |

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

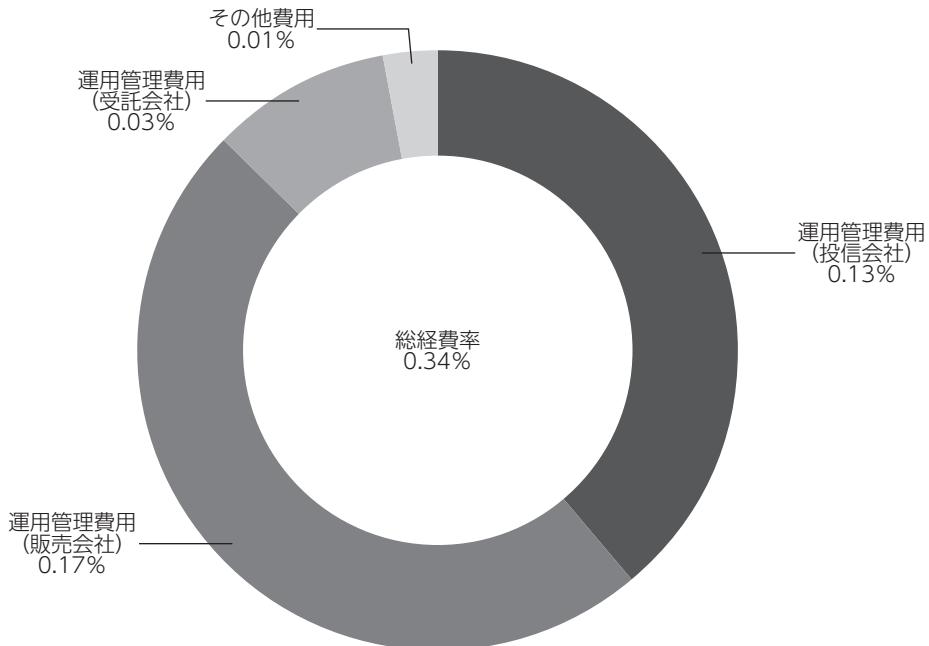
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

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



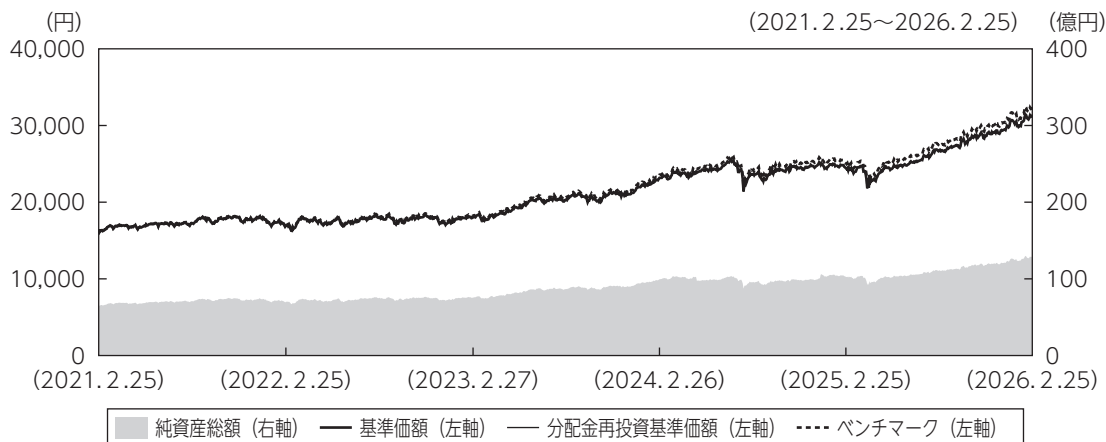
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

最近5年間の基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、2021年2月25日の基準価額に合わせて指数化しています。

| | 2021年2月25日 期首 | 2022年2月25日 決算日 | 2023年2月27日 決算日 | 2024年2月26日 決算日 | 2025年2月25日 決算日 | 2026年2月25日 決算日 |
|--------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基準価額 (分配落) (円) | 16,441 | 16,913 | 18,019 | 23,171 | 24,427 | 31,387 |
| 期間分配金合計 (税引前) (円) | — | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 分配金再投資基準価額の騰落率 (%) | — | 2.9 | 6.5 | 28.6 | 5.4 | 28.5 |
| ベンチマークの騰落率 (%) | — | 3.3 | 7.4 | 29.2 | 6.4 | 29.2 |
| 純資産総額 (百万円) | 6,631 | 6,985 | 7,559 | 9,944 | 10,268 | 12,956 |

投資環境

国内株式市場は、期初から2025年3月まではほぼ横ばいの推移となりましたが、4月初には米国政府による関税政策が嫌気され急落しました。その後、日米政府間の交渉が進むなかで、徐々に値を戻しました。8月から12月末までは、企業業績の拡大期待、石破首相の辞任表明や高市新首相への政策期待などを要因として上昇しました。期末にかけても、衆議院選挙での自民党大勝を受けて積極財政への期待が高まったことなどを要因として続伸しました。

国内債券市場は、下落（利回りは上昇）しました。期初から4月にかけては、米トランプ大統領の関税政策などを巡り市場が混乱する中で、利回りは乱高下しました。5月から11月にかけては、米国債格下げを受けた米金利上昇、軟調な入札結果、参院選後の財政悪化を懸念する見方などを受けて、利回りは上昇しました。12月から期末にかけては、日銀の利上げ観測、財政悪化懸念の高まりなどから利回りは上昇しました。

外国株式市場は、多くの市場が下落後、上昇に転じました。期前半はトランプ米大統領の関税政策による世界的な景気後退への懸念から下落後、米国より中国等を除いた国・地域について関税の上乗せ分の適用猶予が発表され大幅に反発しました。その後、米中による関税の大幅な引き下げや中東情勢の緊張緩和を受けて一段高となりました。期後半はF R B（米連邦準備理事会）高官のハト派的な姿勢を受けた2025年12月の米利下げ観測の強まりなどを背景に堅調に推移しました。

外国債券市場では、米国債利回りは低下、ドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、底堅い雇用統計の発表を受けて、利回りが上昇する局面もありましたが、その後雇用統計が大幅下方修正され、F R B（米連邦準備理事会）が利下げを再開したことで利回りは低下しました。その後地政学リスクから安全資産が買われ、利回りは低下幅を拡大しました。ドイツ債については、フランス政局の不透明感などから利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。米ドル/円相場は、内外金利差が縮小したものの、日銀が追加利上げに慎重な姿勢を継続したことや、財政拡張懸念などから円安米ドル高となりました。その他主要通貨においても、日銀の追加利上げに慎重な姿勢や財政拡張懸念などから円安現地通貨高の動きとなりました。

■ ポートフォリオについて

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

<基本アロケーション>

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

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

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

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

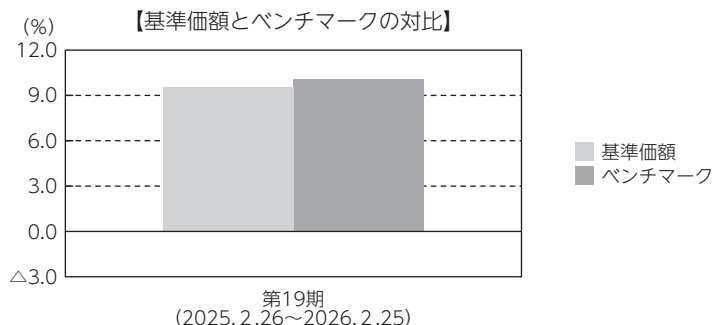
D I A M D C バランス30インデックスファンド

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは10.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.5%のパフォーマンスとなりました。

なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

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

分配原資の内訳(1万口当たり)

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2025年2月26日 ~2026年2月25日 |
| 当期分配金(税引前) | -円 |
| 対基準価額比率 | -% |
| 当期の収益 | -円 |
| 当期の収益以外 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 8,801円 |

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

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

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

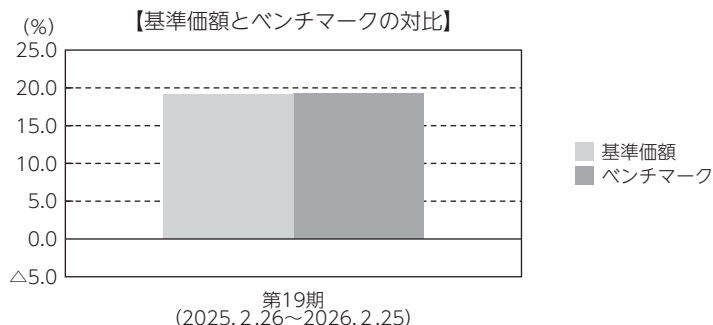
DIAM DC バランス50インデックスファンド

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは19.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%のパフォーマンスとなりました。

なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

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

分配原資の内訳(1万口当たり)

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2025年2月26日 ~2026年2月25日 |
| 当期分配金(税引前) | -円 |
| 対基準価額比率 | -% |
| 当期の収益 | -円 |
| 当期の収益以外 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 15,422円 |

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

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

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

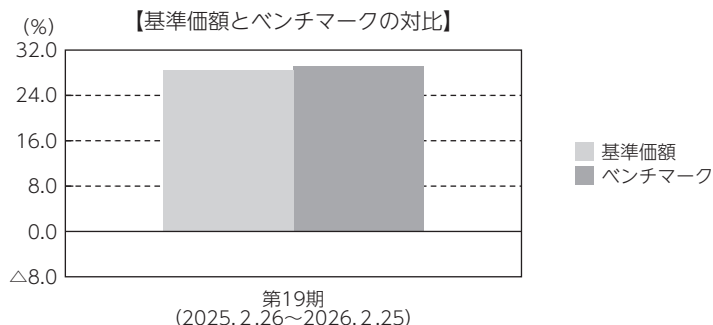
D I A M D C バランス70インデックスファンド

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは29.2%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.7%のパフォーマンスとなりました。

なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

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

分配原資の内訳(1万口当たり)

| 項目 | 当期 |
|------------|---------------------------|
| | 2025年2月26日 ～2026年2月25日 |
| 当期分配金(税引前) | －円 |
| 対基準価額比率 | －% |
| 当期の収益 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 22,141円 |

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

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

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

今後の運用方針

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

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

お知らせ

約款変更のお知らせ

- 各ファンドおよび各ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・ファンド・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」および「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

(2025年4月1日)

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

- 各ファンドが投資対象とする「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を3兆円から5兆円に変更しました。

(2025年5月17日)

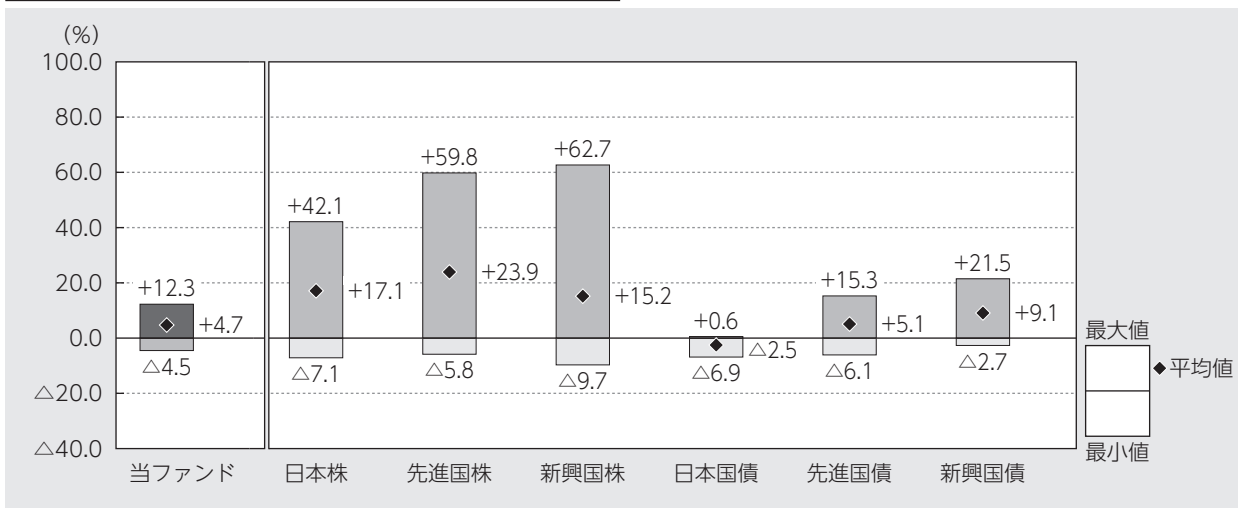
当ファンドの概要

| | | |
|--------|---|---|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合（インデックス型） | |
| 信託期間 | 2006年12月27日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。 | |
| 主要投資対象 | ベビーファンド* | 以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。 |
| | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 海外の株式を主要投資対象とします。 |
| | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 海外の公社債を主要投資対象とします。 |
| 運用方法 | マザーファンドへの投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。 基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用します。 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。 | |
| 分配方針 | 決算日（原則として2月25日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等から基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。 | |

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

代表的な資産クラスとの騰落率の比較

DIAMDC バランス30インデックスファンド



2021年2月～2026年1月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

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

*各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

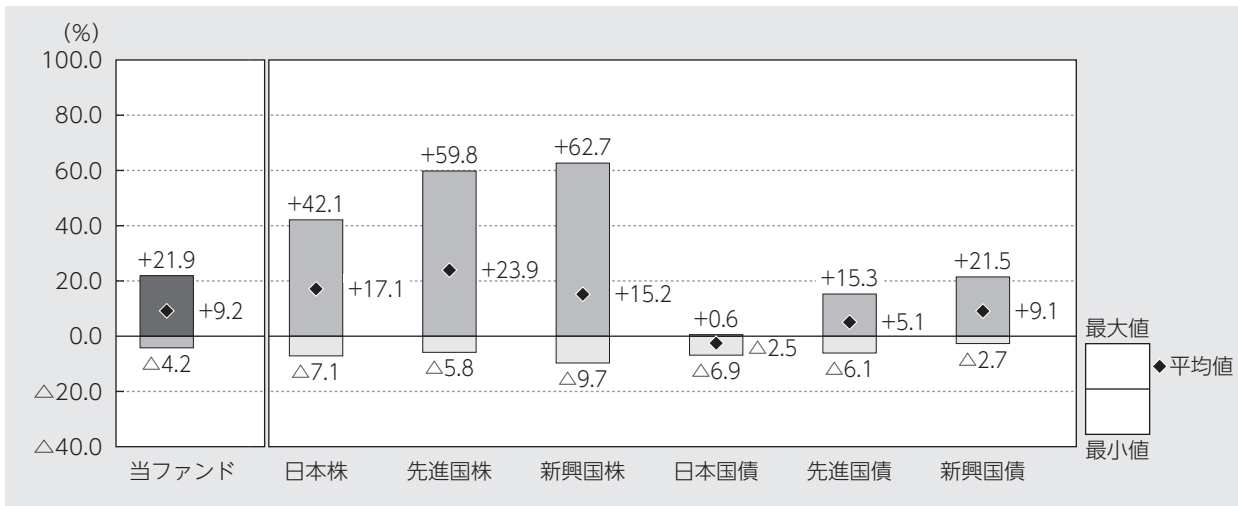
先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

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

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

DIAMDC バランス50インデックスファンド



2021年2月～2026年1月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

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

*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

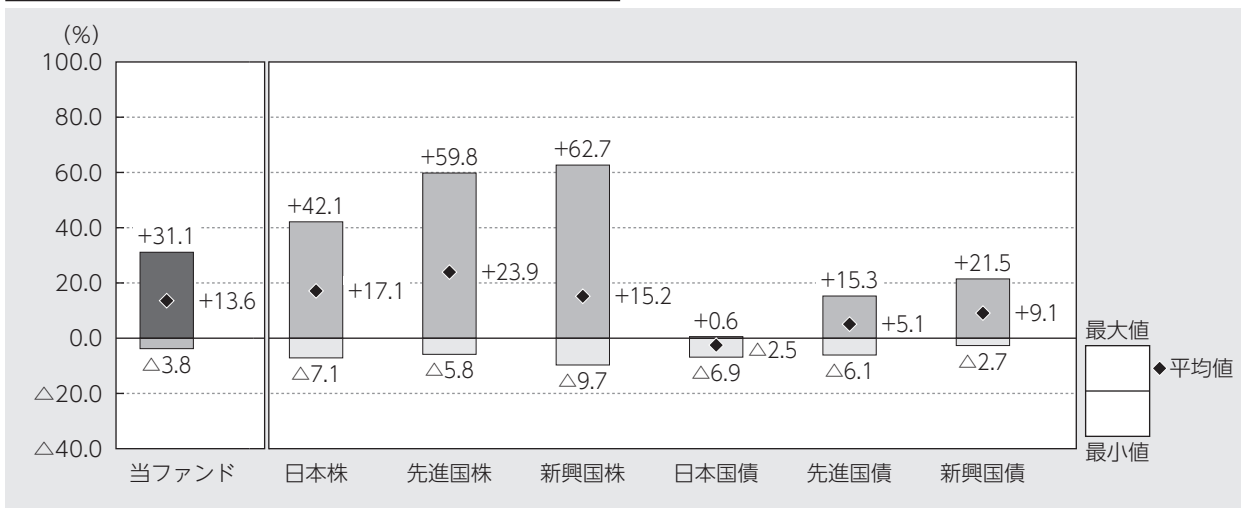
先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

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

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

DIAMDC バランス70インデックスファンド



2021年2月～2026年1月

(注1) すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

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

*各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

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

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

当ファンドのデータ

当ファンドの組入資産の内容（2026年2月25日現在）

D I A M D C バランス30インデックスファンド

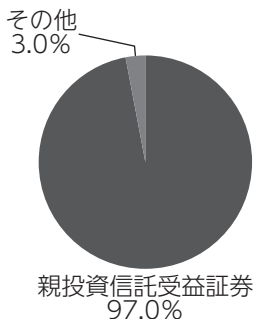
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

| | 当期末 |
|-----------------------------|------------|
| | 2026年2月25日 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 50.8% |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 21.2 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 15.0 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 10.0 |
| その他 | 3.0 |

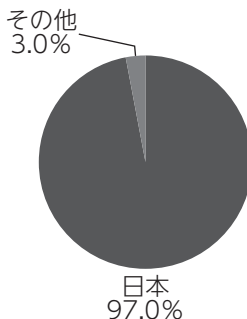
(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

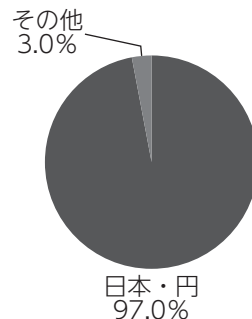
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。

純資産等

| 項目 | 当期末 |
|------------|----------------|
| | 2026年2月25日 |
| 純資産総額 | 6,538,078,496円 |
| 受益権総口数 | 3,506,584,339口 |
| 1万口当たり基準価額 | 18,645円 |

(注) 当期中における追加設定元本額は439,206,024円、同解約元本額は486,825,387円です。

DIAMDC バランス50インデックスファンド

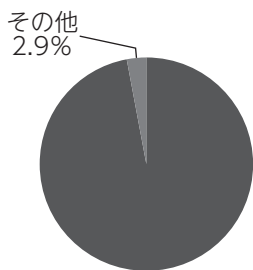
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

| | 当期末 |
|-----------------------------|------------|
| | 2026年2月25日 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 38.3% |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 26.4 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 16.6 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 15.8 |
| その他 | 2.9 |

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

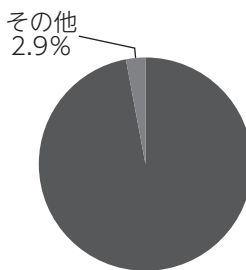
(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

◆資産別配分



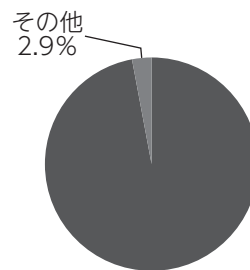
親投資信託受益証券
97.1%

◆国別配分



日本
97.1%

◆通貨別配分



日本・円
97.1%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。

純資産等

| 項目 | 当期末 |
|------------|-----------------|
| | 2026年2月25日 |
| 純資産総額 | 13,779,697,911円 |
| 受益権総口数 | 5,563,364,580口 |
| 1万口当たり基準価額 | 24,769円 |

(注) 当期中における追加設定元本額は434,296,162円、同解約元本額は591,376,178円です。

DIAMDC バランス70インデックスファンド

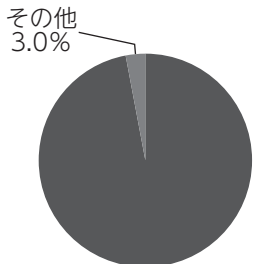
◆組入ファンド等 (組入ファンド数：4ファンド)

| | 当期末 |
|-----------------------------|------------|
| | 2026年2月25日 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 52.1% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 19.2 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 19.2 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 6.5 |
| その他 | 3.0 |

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

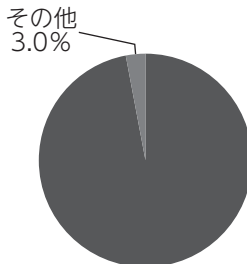
(注2) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

◆資産別配分



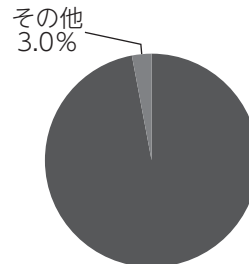
親投資信託受益証券
97.0%

◆国別配分



日本
97.0%

◆通貨別配分



日本・円
97.0%

(注1) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 現金等はその他として表示しています。

純資産等

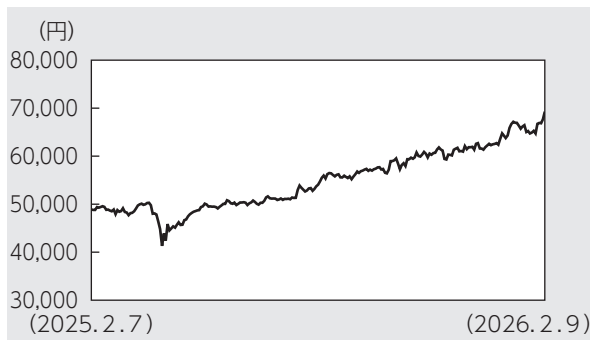
| 項目 | 当期末 |
|------------|-----------------|
| | 2026年2月25日 |
| 純資産総額 | 12,956,747,534円 |
| 受益権総口数 | 4,128,023,304口 |
| 1万口当たり基準価額 | 31,387円 |

(注) 当期中における追加設定元本額は455,684,302円、同解約元本額は531,438,907円です。

組入ファンドの概要

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド】（計算期間 2025年2月8日～2026年2月9日）

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄（現物）

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|---------|------|
| トヨタ自動車 | 日本・円 | 3.6% |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本・円 | 3.4 |
| 日立製作所 | 日本・円 | 2.7 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 日本・円 | 2.4 |
| ソニーグループ | 日本・円 | 2.2 |
| みずほフィナンシャルグループ | 日本・円 | 1.9 |
| 三菱商事 | 日本・円 | 1.9 |
| 三菱重工業 | 日本・円 | 1.7 |
| アドバンテスト | 日本・円 | 1.6 |
| 東京エレクトロン | 日本・円 | 1.6 |
| 組入銘柄数 | 1,650銘柄 | |

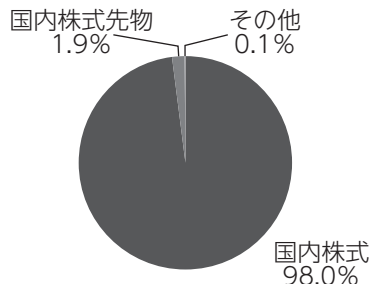
◆1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | |
|-----------------------------------|------------------|------------------------------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) | 0円 (0) (0) | 0.001% (0.000) (0.001) |
| 合計 | 0 | 0.001 |
| 期中の平均基準価額は54,937円です。 | | |

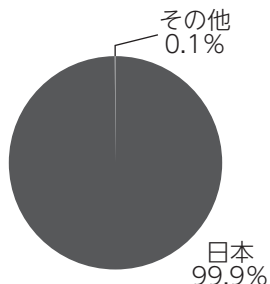
◆組入上位銘柄（先物）

| 銘柄名 | 売買 買建 | 比率 |
|-------|----------|------|
| TOPIX | | 1.9% |
| 組入銘柄数 | 1銘柄 | |

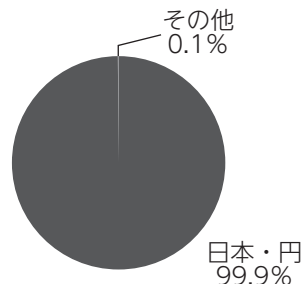
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



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

(注2) 「1万口当たりの費用明細」期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。

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

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

(注6) その他は、純資産総額を100%として、現物と先物の比率を差し引いたものです。

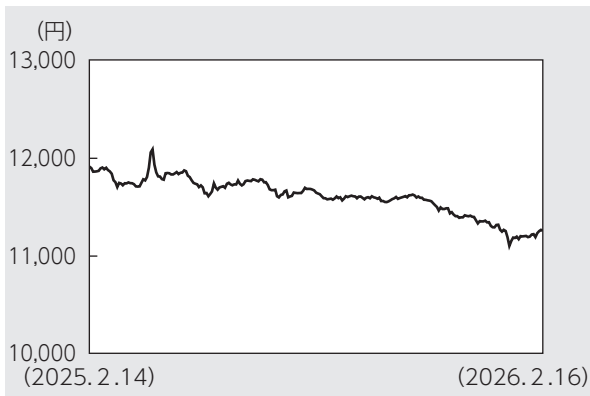
(注7) 現金等はその他として表示しています。

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

【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド】

(計算期間 2025年2月15日～2026年2月16日)

◆基準価額の推移



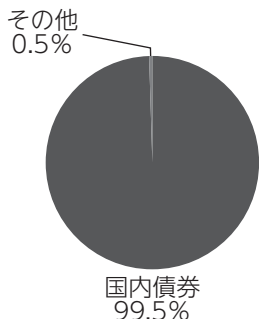
◆組入上位10銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------|-------|------|
| 153回 利付国庫債券(5年) | 日本・円 | 1.1% |
| 163回 利付国庫債券(5年) | 日本・円 | 1.0 |
| 378回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 377回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 374回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 375回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 347回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 371回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 380回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 366回 利付国庫債券(10年) | 日本・円 | 1.0 |
| 組入銘柄数 | 607銘柄 | |

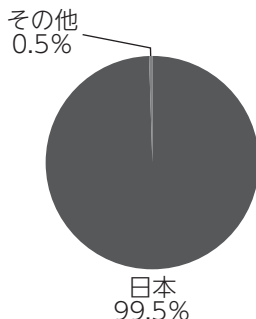
◆1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

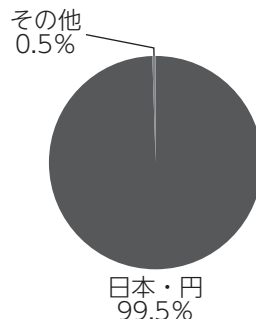
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



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

(注2) 「1万口当たりの費用明細」期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

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

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

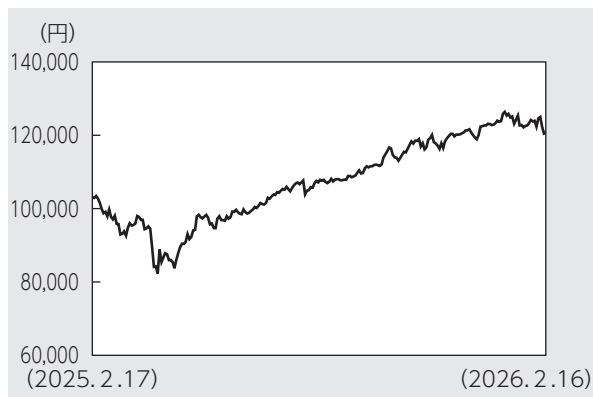
(注5) 現金等はその他として表示しています。

(注6) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書(全体版)に記載されています。

【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド】

(計算期間 2025年2月18日～2026年2月16日)

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄（現物）

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|--------------------|---------|------|
| NVIDIA CORP | アメリカ・ドル | 5.5% |
| APPLE INC | アメリカ・ドル | 4.7 |
| MICROSOFT CORP | アメリカ・ドル | 3.5 |
| AMAZON.COM INC | アメリカ・ドル | 2.4 |
| ALPHABET INC-CL A | アメリカ・ドル | 2.2 |
| ALPHABET INC-CL C | アメリカ・ドル | 1.9 |
| BROADCOM INC | アメリカ・ドル | 1.8 |
| META PLATFORMS INC | アメリカ・ドル | 1.7 |
| TESLA INC | アメリカ・ドル | 1.5 |
| ELI LILLY & CO | アメリカ・ドル | 1.0 |
| 組入銘柄数 | 1,140銘柄 | |

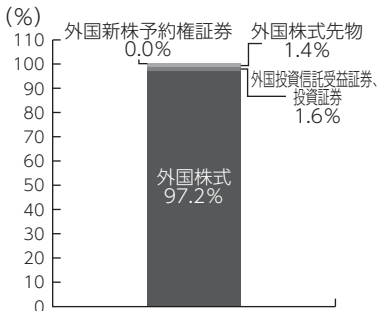
◆1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | |
|-----------------------|------|---------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) 売買委託手数料 | 1円 | 0.001% |
| (株式) | (1) | (0.001) |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投資証券) | (0) | (0.000) |
| (b) 有価証券取引税 | 5 | 0.005 |
| (株式) | (5) | (0.005) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投資証券) | (0) | (0.000) |
| (c) その他費用 | 16 | 0.015 |
| (保管費用) | (16) | (0.015) |
| (その他) | (1) | (0.000) |
| 合計 | 23 | 0.021 |
| 期中の平均基準価額は107,454円です。 | | |

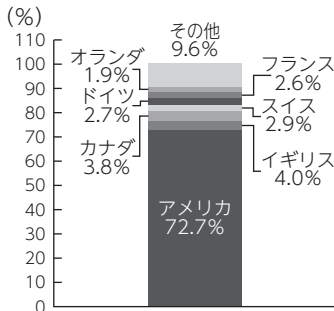
◆組入上位銘柄（先物）

| 銘柄名 | 売買 | 比率 |
|-----------------------|-----|------|
| S&P500 EMINI FUTURES | 買建 | 1.0% |
| DJ EURO STOXX 50 | 買建 | 0.2 |
| S&P/TSE 60 IX FUTURES | 買建 | 0.1 |
| FTSE 100 INDEX FUTURE | 買建 | 0.1 |
| SPI 200 FUTURES | 買建 | 0.0 |
| 組入銘柄数 | 5銘柄 | |

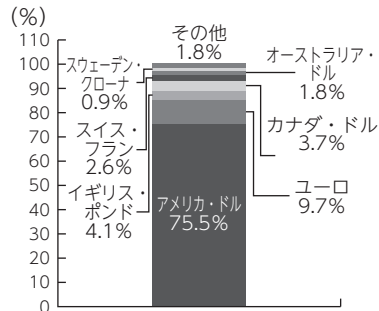
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分

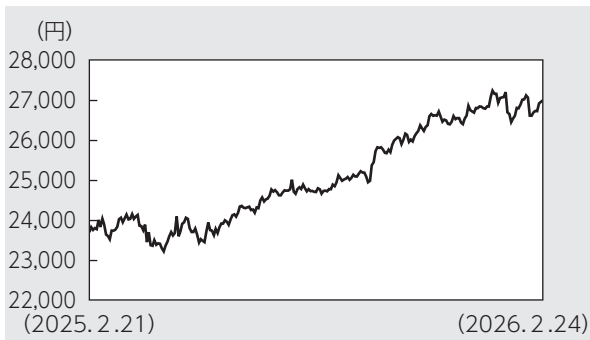


- (注1) 基準価額の推移、1万口当たりの費用明細は組入ファンドの直近の計算期間のものであります。
- (注2) 「1万口当たりの費用明細」期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書（全体版）をご参照ください。
- (注3) 組入上位銘柄、資産別配分・国別配分・通貨別配分のデータは組入ファンドの直近の決算日現在のものです。
- (注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。
- (注5) 国別配分につきましては発行国（地域）で表示しております。
- (注6) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。
- (注7) 国別配分、通貨別配分については、現物と先物の比率を合計して表示しています。
- (注8) 計算期間中の運用経過や組入全銘柄に関する詳細な情報等については、運用報告書（全体版）に記載されています。

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド】

(計算期間 2025年2月22日～2026年2月24日)

◆基準価額の推移



◆組入上位10銘柄

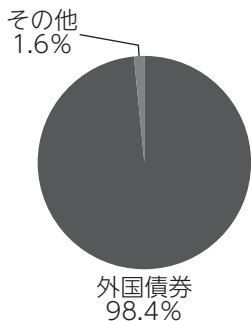
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------------------------|-----------|------|
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.45 02/25/28 | オフショア・人民元 | 0.6% |
| US T N/B 4.5 05/15/27 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 4.25 08/15/35 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 3.75 04/15/28 | アメリカ・ドル | 0.5 |
| US T N/B 4.125 07/31/31 | アメリカ・ドル | 0.4 |
| US T N/B 4.625 02/15/35 | アメリカ・ドル | 0.4 |
| US T N/B 3.375 05/15/33 | アメリカ・ドル | 0.4 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 | オフショア・人民元 | 0.4 |
| US T N/B 4.25 05/15/35 | アメリカ・ドル | 0.4 |
| US T N/B 3.5 02/15/33 | アメリカ・ドル | 0.4 |
| 組入銘柄数 | 966銘柄 | |

◆1万口当たりの費用明細

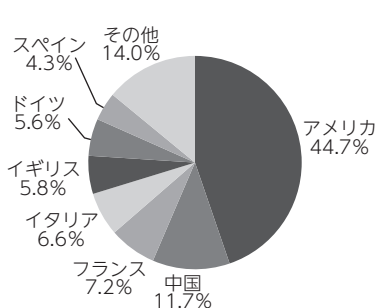
| 項目 | 当期 | |
|---------------------|-----|---------|
| | 金額 | 比率 |
| (a) その他費用 (保管費用) | 4円 | 0.017% |
| (その他) | (4) | (0.016) |
| | (0) | (0.001) |
| 合計 | 4 | 0.017 |

期中の平均基準価額は25,091円です。

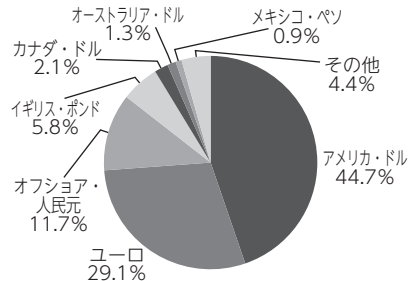
◆資産別配分



◆国別配分



◆通貨別配分



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

(注2) 「1万口当たりの費用明細」期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。なお、項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

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

(注4) 比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注5) 国別配分につきましては発行国(地域)で表示しております。

(注6) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。

(注7) 現金等はその他として表示しています。

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

<当ファンドのベンチマークについて>

- 合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて委託会社が独自に合成したものです。基本アロケーションについては、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。
- 運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 東証株価指数（TOPIX）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。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、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JPXは責任を負いません。
- 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。
- MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

<代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

- 「東証株価指数（TOPIX）」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村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。
- 「FTSE世界国債インデックス（除く日本）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(このページは白紙です)

(このページは白紙です)

