

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2021年5月25日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型 D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型
<b>【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】</b>	各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

(以上を総称して、または個別に「DIAMバランス・ファンド<DC年金>」、「ファンド」、「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また各々、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」を「バランス・ファンド<DC年金>1」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」を「バランス・ファンド<DC年金>2」、「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型」を「バランス・ファンド<DC年金>3」という場合もあります。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権(以下「受益権」といいます。)

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等(後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関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、振替機関を含めます。)をいいます。以下同じ。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下、「委託会社」といいます。)は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### (3)【発行(売出)価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

各ファンドにつき、1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2021年5月26日から2021年11月25日まで

お申込みの取扱いは、販売会社の毎営業日に行われます。

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、下記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、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、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みの方法

お申込みに際しては、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、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で全額再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

なお、海外休業日には、お申込みの受付を行いません。

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

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

#### 振替受益権について

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

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、3本のファンドから構成され、安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

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<sup>(注)</sup>に概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 各資産につき、基本アロケーションにおける各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。
- 運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

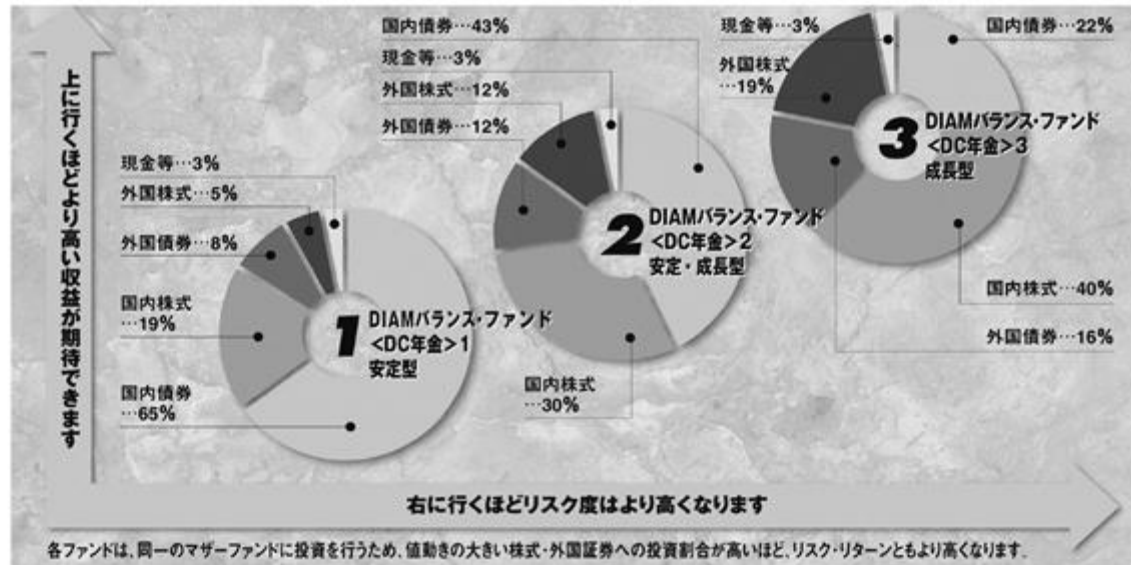
(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

## 2 ライフサイクルにあわせて、3つのファンドから選択できます

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

### 3ファンドの基本アロケーション

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



- DIAM/バランス・ファンド<DC年金>1 安定型  
比較的低リスクの低い資産（国内債券）を中心に組み入れ、安定運用を行います。
- DIAM/バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型  
各資産をバランスよく組み入れ、ミドルリスク・ミドルリターンをめざします。
- DIAM/バランス・ファンド<DC年金>3 成長型  
株式・外国証券等のリスク資産を中心に組み入れることにより、より高い収益をめざします。

## ■ 分配方針

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

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

## 商品分類表

「DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型」

「DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型」

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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

## 属性区分表

「DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型」

「DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型」

「DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型」

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。



## 属性区分定義

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

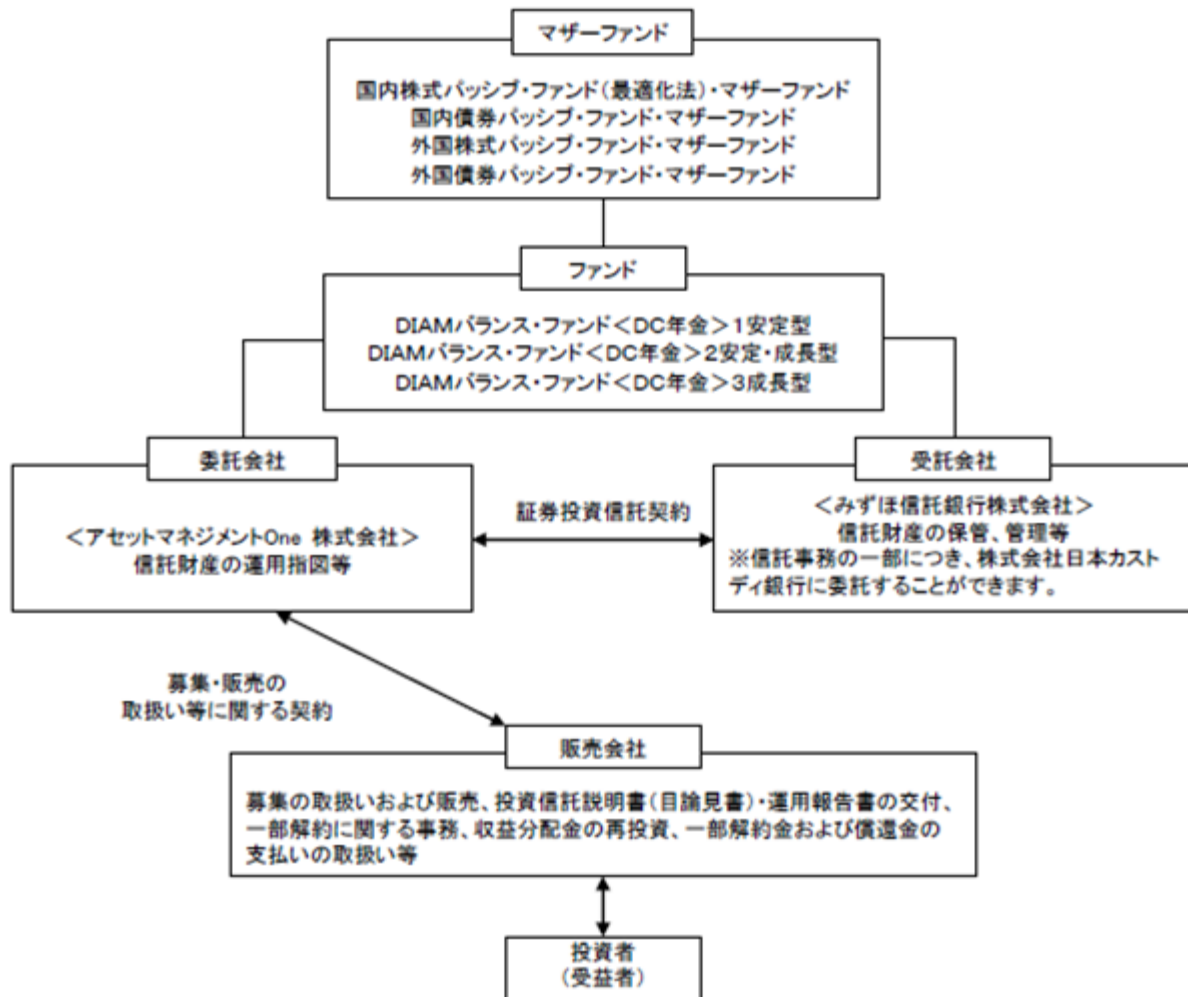
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

## （２）【ファンドの沿革】

2002年12月13日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2005年10月 1日 信託報酬率の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】



## ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

## ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

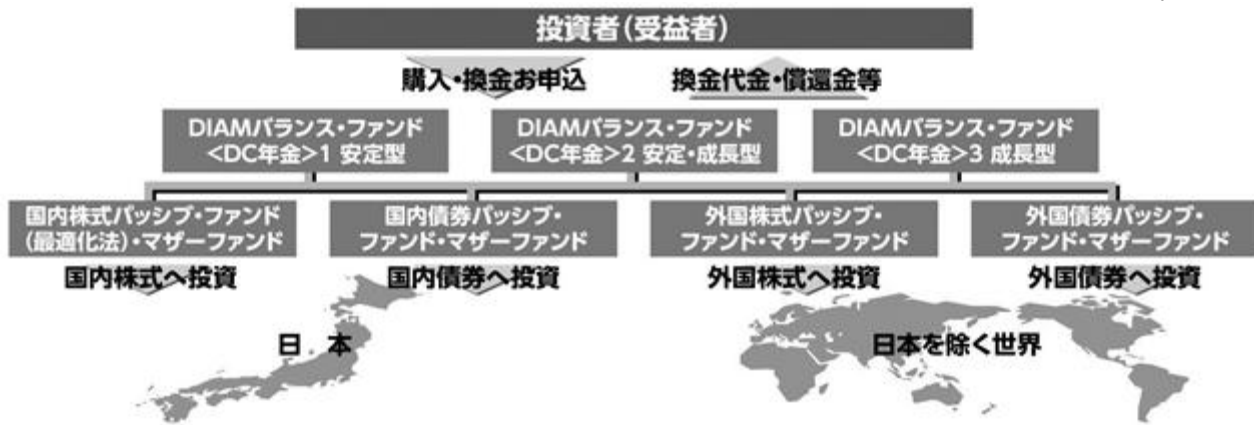
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

## ファミリーファンド方式とは

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



### 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

### 資本金の額

20億円（2021年2月26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

（2021年2月26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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

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

#### <投資対象>

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

#### <投資態度>

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

#### 2) 「DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が40%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が30%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用します。

#### 「DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が60%以下、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が50%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用します。

#### 「DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型」

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産について、株式への実質投資割合の上限が80%未満、かつ外貨建資産への実質投資割合の上限が55%以下の範囲内において配分した基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用します。

委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)<sup>(注1)</sup>、国内債券についてはNOMURA-BPI総合<sup>(注2)</sup>、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)<sup>(注3)</sup>、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)<sup>(注4)</sup>、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

(注1) 東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「㈱東京証券取引所」といいます。)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TOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

㈱東京証券取引所は、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TOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

㈱東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの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。

㈱東京証券取引所は、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、㈱東京証券取引所は、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。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンド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、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

(注2) NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(注3) 本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなく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。

(注4) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。

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

対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成インデックスに連動させるため、以下の対応を行います。

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

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針 (2)投資対象 (参考)ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要をご参照ください。

## (2) 【投資対象】

### 1. 投資の対象とする資産(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### 2. 有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

(1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

- (2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - (3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - (4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - (5) 株券または新株引受権証券
  - (6) 国債証券
  - (7) 地方債証券
  - (8) 特別の法律により法人の発行する債券
  - (9) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
  - (10) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - (11) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  - (12) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  - (13) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  - (14) コマーシャル・ペーパー
  - (15) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
  - (16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(5)から(15)までの証券または証書の性質を有するもの
  - (17) 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
  - (18) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  - (19) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - (20) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
  - (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せん。)
  - (24) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  - (25) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - (26) 外国の者に対する権利で上記(25)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(5)の証券または証書、(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(5)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(6)から(10)までの証券および(16)ならびに(21)の証券または証書のうち(6)から(10)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、(17)の証券および(18)の証券を以下「投資信託証券」といいます。



### 3. 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

- (1) 預金
- (2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形
- (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3. の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。（約款第16条第3項）

#### （参考）ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

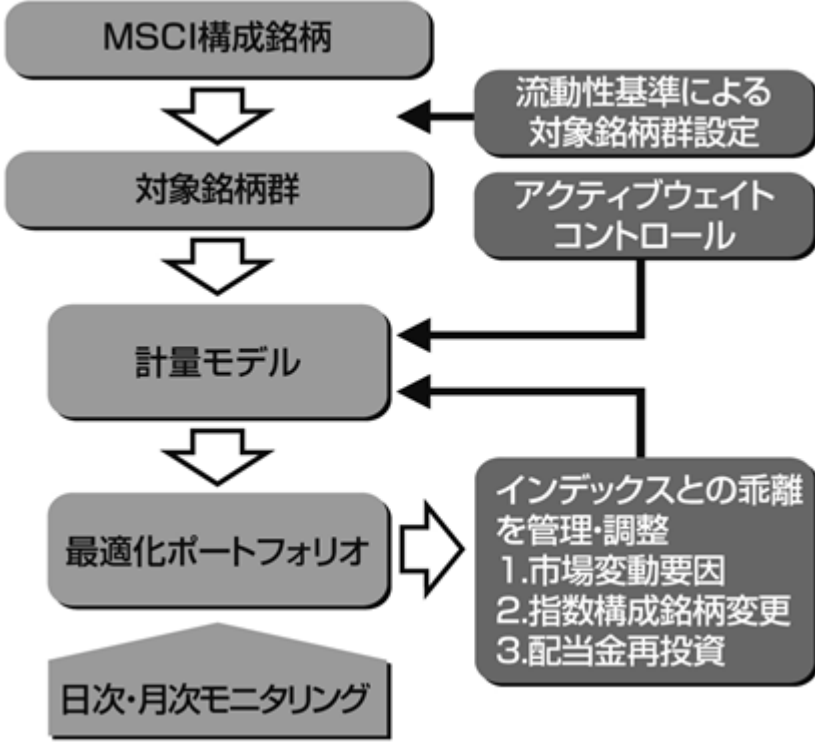
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

<p>運用プロセス</p>	<p>1)流動性基準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、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築        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。</p> <p>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。        インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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 - B P I 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	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
運用プロセス	<p>1) 流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2) 最適化法によるポートフォリオの構築 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 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、 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。</p> <p>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。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン、償還再投資</li> </ul>

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

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

運用プロセス	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul> 
--------	---

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

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

## 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

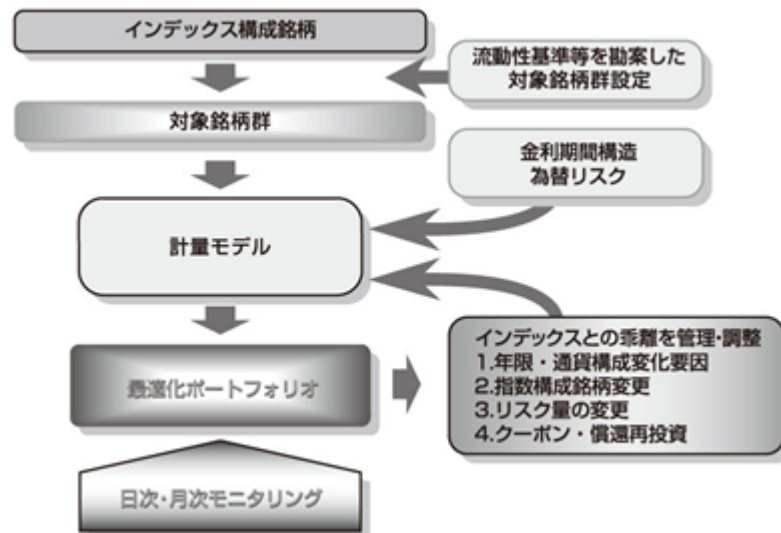
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

## 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

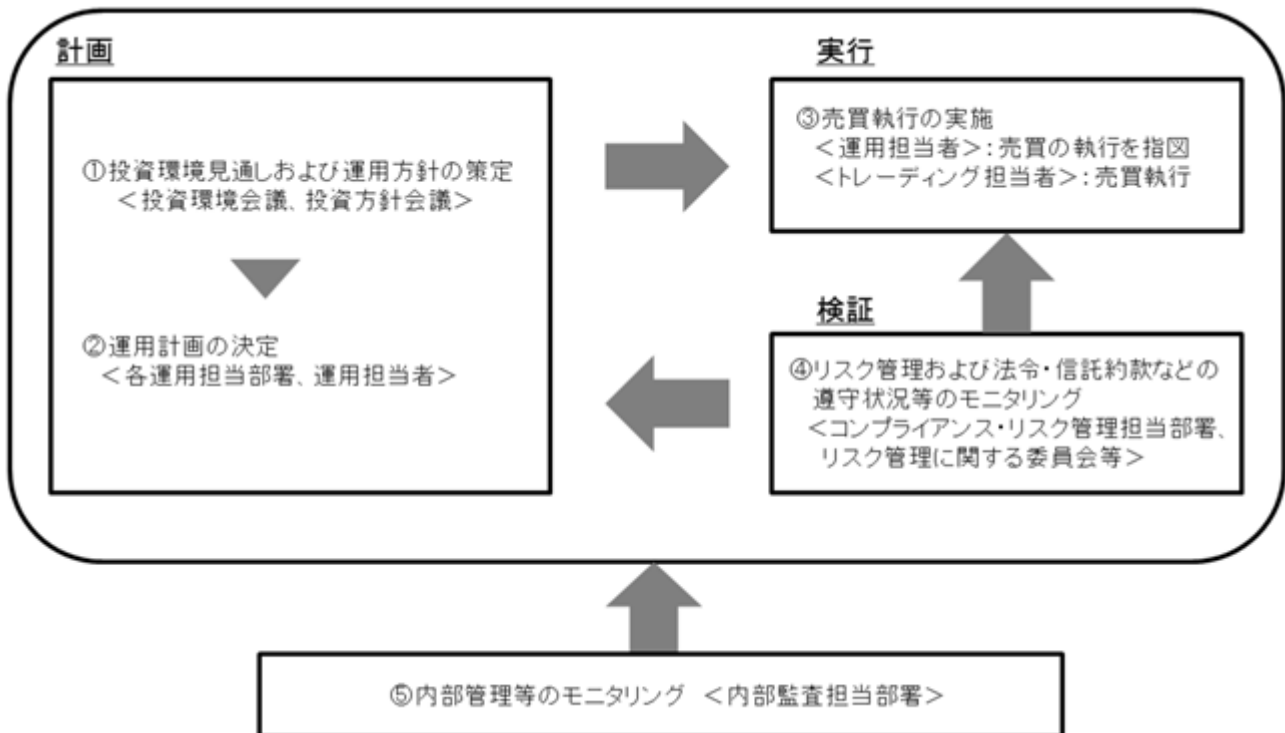


<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動によ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

資金動向、市況動向によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



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。

#### 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。

#### 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。

#### モニタリング

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

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

#### 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

当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2021年2月26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】

##### 収益分配方針

毎決算時（原則2月25日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

##### 1) 分配対象額の範囲

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

##### 2) 分配対象額についての分配方針

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

##### 3) 留保益の運用方針

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

## 収益の分配方式

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

1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

## 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、別に定める契約に基づき、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## （５）【投資制限】

「DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞1安定型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

「DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞2安定・成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

「DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞3成長型」

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。

共通

(3)投資信託証券への実質投資割合(約款 運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

各マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(4)新株引受権証券等への実質投資割合(約款 運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の15%以下とします。

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

(6)投資する株式等の範囲(約款第18条)

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

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

(7)同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資制限(約款第19条)

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

(8)同一銘柄の転換社債等への投資制限(約款第20条)

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

(9)信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

(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(上記5)に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

(10)先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

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

- 1) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)～(4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属する

とみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲(1)~(4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

(11)スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

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

- (b)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- (f)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供を要求され委託会社がその必要性を認めたときあるいは担保の受入れが必要と委託会社が認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (12)金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）
- (a)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間に係る金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）が、信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下(c)において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (d)上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純

資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

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

(h) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (13) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第24条の2)

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

#### (14) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)

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

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

2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(b) 上記(a) 1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

#### (15) 公社債の空売りの指図範囲(約款第26条)

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

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

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

#### (16) 公社債の借入れ(約款第27条)



- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d) 上記(a)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- (17) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第29条)
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- (18) 外国為替予約の指図(約款第30条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (c) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (d) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (19) 資金の借入れ(約款第37条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (b) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

(d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### (1) 株式投資リスク

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

##### 1) 価格変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

##### 2) 信用リスク

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

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

## (2)債券投資リスク

当ファンドは実質的に公社債に投資します。公社債では、一般的に次に掲げるリスクがあります。

### 1)金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

### 2)信用リスク

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

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

## (3)為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。従いまして、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替変動リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としており、円と投資対象国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に影響します。

## (4)資産配分リスク

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

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

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

## (5)カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の投資態度に従った運用ができない場合があります。

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

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。

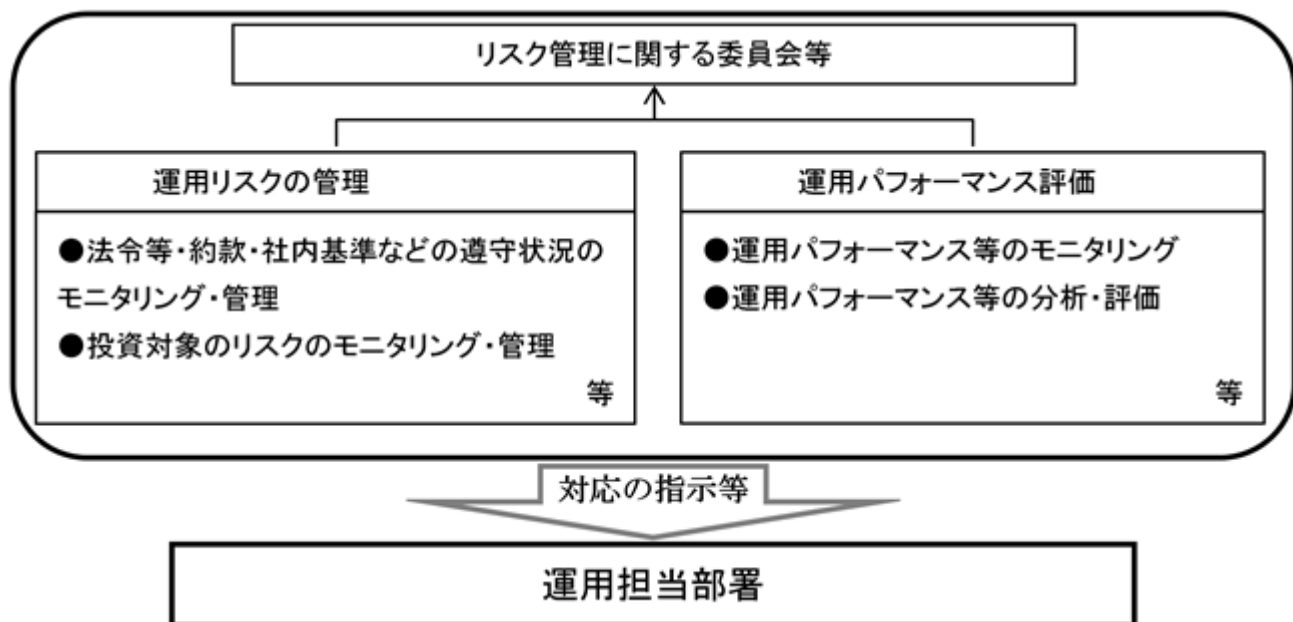
### 注意事項

- イ.当ファンドは、実質的に株式や公社債など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ.投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ.投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、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。
- ・リスク管理に関する委員会等：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、リスク管理に関する委員会等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。



リスク管理体制は2021年2月26日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

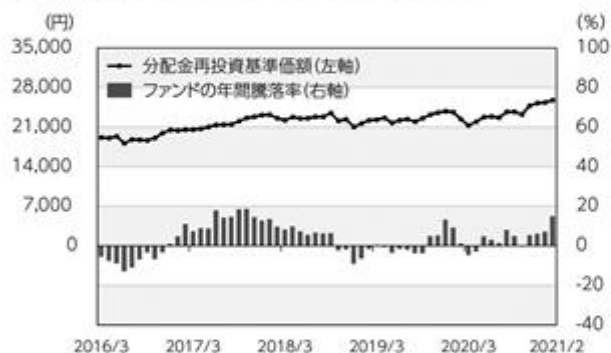
#### DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型



#### DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型



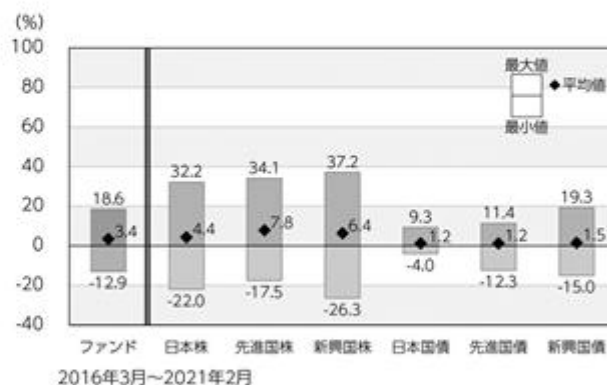
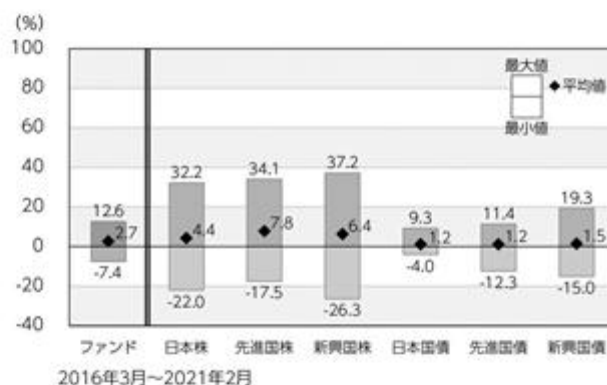
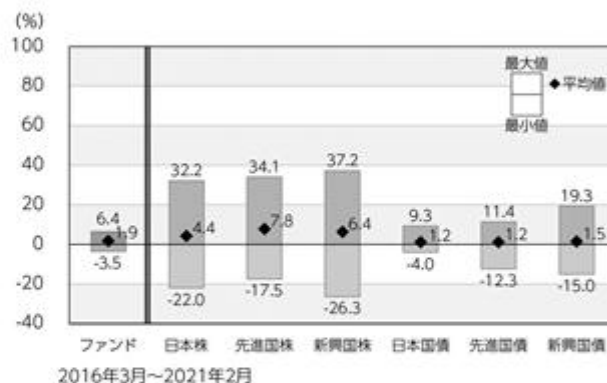
#### DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



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

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

### 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



\*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、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
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、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
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 税込（税抜）	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
D I A Mバランス・ファンド < D C年金 > 1 安定型 ----- 年率0.286%（税抜0.26%）	0.100%	0.130%	0.030%
D I A Mバランス・ファンド < D C年金 > 2 安定・成長型 ----- 年率0.319%（税抜0.29%）	0.115%	0.145%	0.030%
D I A Mバランス・ファンド < D C年金 > 3 成長型 ----- 年率0.352%（税抜0.32%）	0.130%	0.160%	0.030%
主な役務	信託財産の運用、目 論見書等各種書類の 作成、基準価額の算 出等の対価	購入後の情報提供、 交付運用報告書等各 種書類の送付、口座 内でのファンドの管 理等の対価	運用財産の保管・管 理、委託会社からの 運用指図の実行等の 対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年8月25日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

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。

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。



有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、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

###### 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。

###### 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。

###### 損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2021年2月末現在のものであります。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 >

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。

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。

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、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、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には、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型

2021年2月26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	15,488,145,222	96.98
内 日本	15,488,145,222	96.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	481,821,385	3.02
純資産総額	15,969,966,607	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バランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型

2021年2月26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	31,947,175,411	96.96
内 日本	31,947,175,411	96.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,002,856,889	3.04
純資産総額	32,950,032,300	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バランス・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型

2021年2月26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	25,004,669,736	96.95
内 日本	25,004,669,736	96.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	787,749,308	3.05
純資産総額	25,792,419,044	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

2021年2月26日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	302,237,554,300	98.99
内 日本	302,237,554,300	98.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,089,782,074	1.01
純資産総額	305,327,336,374	100.00

## その他資産の投資状況

2021年2月26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)	3,413,410,000	1.12
内 日本	3,413,410,000	1.12

(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

2021年2月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	449,680,106,614	95.49
内 アメリカ	307,450,099,388	65.29
内 イギリス	21,000,467,090	4.46
内 カナダ	16,271,949,890	3.46
内 フランス	15,596,799,693	3.31
内 スイス	15,394,149,534	3.27
内 ドイツ	14,096,526,414	2.99
内 オーストラリア	10,389,442,283	2.21
内 オランダ	8,893,985,560	1.89
内 アイルランド	8,349,454,550	1.77
内 スウェーデン	5,107,541,278	1.08
内 香港	4,000,909,376	0.85
内 デンマーク	3,722,118,838	0.79
内 スペイン	3,716,551,282	0.79
内 イタリア	2,864,546,393	0.61
内 フィンランド	1,903,027,541	0.40
内 ジャージー	1,745,332,209	0.37
内 バミューダ	1,463,750,135	0.31
内 シンガポール	1,386,887,894	0.29
内 ベルギー	1,289,771,446	0.27
内 ノルウェー	936,282,800	0.20
内 ケイマン諸島	921,033,999	0.20
内 イスラエル	899,948,255	0.19
内 ニュージーランド	494,205,581	0.10
内 ルクセンブルグ	401,421,088	0.09
内 オランダ領キュラソー	396,641,811	0.08
内 オーストリア	296,481,417	0.06
内 ポルトガル	231,497,084	0.05
内 リベリア	154,592,981	0.03
内 パナマ	127,583,209	0.03
内 マン島	105,720,477	0.02
内 パプアニューギニア	71,387,118	0.02
投資信託受益証券	880,582,882	0.19
内 オーストラリア	633,550,864	0.13
内 シンガポール	247,032,018	0.05
投資証券	9,179,714,376	1.95
内 アメリカ	8,427,518,490	1.79
内 イギリス	250,034,133	0.05
内 フランス	243,150,391	0.05
内 香港	203,648,445	0.04
内 カナダ	55,362,917	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,167,829,711	2.37
純資産総額	470,908,233,583	100.00

## その他資産の投資状況

2021年2月26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)		11,225,874,694	2.38
内 アメリカ		8,195,508,750	1.74
内 ドイツ		1,838,538,072	0.39
内 イギリス		541,228,160	0.11
内 カナダ		381,785,418	0.08
内 オーストラリア		268,814,294	0.06

(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

2021年2月26日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	227,293,412,300	83.31
内 日本	227,293,412,300	83.31
地方債証券	17,160,407,000	6.29
内 日本	17,160,407,000	6.29
特殊債券	16,371,522,102	6.00
内 日本	16,371,522,102	6.00
社債券	10,551,897,800	3.87
内 日本	10,147,729,800	3.72
内 フランス	404,168,000	0.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,453,944,180	0.53
純資産総額	272,831,183,382	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

2021年2月26日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	134,012,880,777	99.00
内 アメリカ	57,731,954,896	42.65
内 フランス	14,429,715,115	10.66
内 イタリア	12,993,608,110	9.60
内 ドイツ	10,293,037,179	7.60
内 イギリス	8,912,360,449	6.58
内 スペイン	8,304,025,698	6.13
内 オーストラリア	3,703,911,272	2.74
内 ベルギー	3,393,948,928	2.51
内 カナダ	2,652,645,678	1.96
内 オランダ	2,543,111,279	1.88
内 オーストリア	2,027,523,112	1.50
内 アイルランド	1,155,801,886	0.85
内 メキシコ	1,022,667,891	0.76
内 ポーランド	876,479,477	0.65
内 フィンランド	838,607,876	0.62
内 デンマーク	663,867,414	0.49
内 マレーシア	617,350,424	0.46
内 イスラエル	573,176,224	0.42
内 シンガポール	550,169,995	0.41

	内 スウェーデン	429,094,146	0.32
	内 ノルウェー	299,823,728	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,348,029,386	1.00
純資産総額		135,360,910,163	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】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型

2021年2月26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	8,010,802,658	1.2948 10,373,188,361	1.2936 10,362,774,318	- -	64.89
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	999,360,564	3.1247 3,122,801,890	3.0248 3,022,865,833	- -	18.93
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	632,089,833	1.9886 1,257,037,050	1.9776 1,250,020,853	- -	7.83
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	183,325,997	4.7362 868,286,919	4.6501 852,484,218	- -	5.34

(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

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.98
合計	96.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

2021年2月26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	10,639,165,798	1.2948 13,776,655,791	1.2936 13,762,824,876	- -	41.77
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,376,357,994	3.1247 10,550,443,459	3.0248 10,212,807,660	- -	30.99

3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	935,988,345	4.7362 4,433,121,598	4.6501 4,352,439,403	- -	13.21
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,830,048,277	1.9886 3,639,417,008	1.9776 3,619,103,472	- -	10.98

(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

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.96
合計	96.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### D I A M バランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

2021年2月26日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,442,508,998	3.1247 10,757,152,116	3.0248 10,412,901,217	- -	40.37
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	4,246,908,197	1.2948 5,499,321,423	1.2936 5,493,800,443	- -	21.30
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,108,633,939	4.7362 5,250,822,925	4.6501 5,155,258,679	- -	19.99
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,993,683,959	1.9886 3,964,839,289	1.9776 3,942,709,397	- -	15.29

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.95
合計	96.95

(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

2021年2月26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	1,197,800	8,037.00 9,626,718,600	7,873.00 9,430,279,400	- -	3.09
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	920,500	9,485.00 8,730,942,500	9,895.00 9,108,347,500	- -	2.98
3	ソニー 日本	株式 電気機器	740,600	12,095.00 8,957,557,000	11,120.00 8,235,472,000	- -	2.70
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	116,000	56,750.00 6,583,000,000	50,560.00 5,864,960,000	- -	1.92
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	7,977,200	519.60 4,144,953,120	558.00 4,451,277,600	- -	1.46
6	任天堂 日本	株式 その他製品	67,700	63,450.00 4,295,565,000	64,750.00 4,383,575,000	- -	1.44
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	809,300	4,980.00 4,030,314,000	5,281.00 4,273,913,300	- -	1.40
8	日本電産 日本	株式 電気機器	284,600	14,210.00 4,044,166,000	13,520.00 3,847,792,000	- -	1.26
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,357,100	2,786.50 3,781,559,150	2,758.00 3,742,881,800	- -	1.23
10	信越化学工業 日本	株式 化学	214,100	18,075.00 3,869,857,500	17,350.00 3,714,635,000	- -	1.22
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	983,700	3,644.00 3,584,602,800	3,582.00 3,523,613,400	- -	1.15
12	村田製作所 日本	株式 電気機器	347,300	9,468.00 3,288,236,400	9,081.00 3,153,831,300	- -	1.03
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	150,600	23,370.00 3,519,522,000	20,720.00 3,120,432,000	- -	1.02
14	KDDI 日本	株式 情報・通信業	930,400	3,337.00 3,104,744,800	3,290.00 3,061,016,000	- -	1.00
15	第一三共 日本	株式 医薬品	1,015,000	3,225.00 3,273,375,000	3,010.00 3,055,150,000	- -	1.00
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	807,100	3,570.00 2,881,347,000	3,742.00 3,020,168,200	- -	0.99
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	69,300	41,150.00 2,851,695,000	43,550.00 3,018,015,000	- -	0.99
18	HOYA 日本	株式 精密機器	234,600	13,065.00 3,065,049,000	12,100.00 2,838,660,000	- -	0.93
19	日立製作所 日本	株式 電気機器	568,400	4,997.00 2,840,294,800	4,876.00 2,771,518,400	- -	0.91

20	ファナック 日本	株式 電気機器	103,800	28,255.00 2,932,869,000	26,340.00 2,734,092,000	- -	0.90
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	930,900	3,013.00 2,804,801,700	2,911.50 2,710,315,350	- -	0.89
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	814,600	3,101.00 2,526,074,600	3,168.00 2,580,652,800	- -	0.85
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,584,600	1,529.50 2,423,645,700	1,559.00 2,470,391,400	- -	0.81
24	S M C 日本	株式 機械	34,600	64,860.00 2,244,156,000	62,900.00 2,176,340,000	- -	0.71
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	120,100	17,830.00 2,141,383,000	17,840.00 2,142,584,000	- -	0.70
26	三井物産 日本	株式 卸売業	945,500	2,010.00 1,900,455,000	2,263.50 2,140,139,250	- -	0.70
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	709,000	2,838.00 2,012,142,000	3,003.00 2,129,127,000	- -	0.70
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	386,600	5,525.00 2,135,965,000	5,253.00 2,030,809,800	- -	0.67
29	花王 日本	株式 化学	283,100	7,517.00 2,128,062,700	7,144.00 2,022,466,400	- -	0.66
30	資生堂 日本	株式 化学	235,000	7,788.00 1,830,180,000	7,913.00 1,859,555,000	- -	0.61

(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

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
株式	98.99
合計	98.99

(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

2021年2月26日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.48
情報・通信業		9.50
化学		7.23
輸送用機器		6.91
サービス業		5.69
機械		5.52
医薬品		5.39
銀行業		5.00
小売業		4.68
卸売業		4.66
陸運業		3.59
食料品		3.29
精密機器		2.52
その他製品		2.47

建設業	2.26
不動産業	1.98
保険業	1.87
電気・ガス業	1.27
その他金融業	1.08
証券、商品先物取引業	0.81
ガラス・土石製品	0.78
非鉄金属	0.78
鉄鋼	0.69
金属製品	0.62
ゴム製品	0.59
繊維製品	0.49
空運業	0.48
石油・石炭製品	0.44
パルプ・紙	0.25
海運業	0.20
鉱業	0.18
倉庫・運輸関連業	0.17
水産・農林業	0.09
合計	98.99

（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

2021年2月26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	1,528,624	14,383.06 21,986,294,531	12,855.18 19,650,748,137	- -	4.17
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	642,529	26,030.18 16,725,150,344	24,330.18 15,632,851,044	- -	3.32
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	38,064	348,256.68 13,256,042,553	324,823.25 12,364,072,188	- -	2.63
4	FACEBOOK INC 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	215,014	28,740.62 6,179,636,743	27,060.81 5,818,453,538	- -	1.24

5	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	26,796	223,561.68 5,990,558,978	215,832.00 5,783,434,272	- -	1.23
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	26,900	222,596.93 5,987,857,618	214,194.68 5,761,837,093	- -	1.22
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	66,704	86,712.75 5,784,087,276	72,485.87 4,835,097,806	- -	1.03
8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	272,545	15,007.81 4,090,304,257	16,062.87 4,377,856,266	- -	0.93
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	235,155	17,699.12 4,162,037,739	17,293.24 4,066,594,203	- -	0.86
10	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	150,580	22,308.25 3,359,176,285	22,710.93 3,419,812,968	- -	0.73
11	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	161,966	19,939.93 3,229,591,917	20,291.62 3,286,553,334	- -	0.70
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	125,078	25,761.37 3,222,181,262	25,892.06 3,238,527,393	- -	0.69
13	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	55,238	63,585.31 3,512,325,491	56,556.87 3,124,088,661	- -	0.66
14	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	79,824	36,231.25 2,892,123,300	37,673.06 3,007,214,541	- -	0.64
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	222,379	13,559.62 3,015,375,847	13,449.12 2,990,802,968	- -	0.64
16	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	84,987	34,875.49 2,963,964,118	34,942.43 2,969,652,935	- -	0.63
17	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	257,032	11,818.48 3,037,728,785	11,288.10 2,901,404,975	- -	0.62
18	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	100,053	31,701.81 3,171,861,446	26,981.12 2,699,542,499	- -	0.57

19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	697,637	3,545.56 2,473,515,585	3,817.56 2,663,272,849	- -	0.57
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	96,381	29,485.43 2,841,835,951	27,120.31 2,613,882,839	- -	0.56
21	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	380,257	6,567.31 2,497,266,549	6,417.49 2,440,299,297	- -	0.52
22	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	38,098	63,896.96 2,434,346,477	61,339.79 2,336,923,414	- -	0.50
23	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	39,498	59,130.24 2,335,526,614	58,086.87 2,294,315,388	- -	0.49
24	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	408,173	5,655.68 2,308,498,933	5,550.49 2,265,564,236	- -	0.48
25	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	378,944	5,367.75 2,034,076,656	5,924.50 2,245,053,728	- -	0.48
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	368,567	5,758.74 2,122,485,211	6,003.12 2,212,553,771	- -	0.47
27	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	62,885	36,750.88 2,311,079,591	34,855.84 2,191,909,938	- -	0.47
28	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	42,977	53,001.74 2,277,856,209	48,785.74 2,096,665,177	- -	0.45
29	ABBOTT LABORATORIES アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ 用品	158,592	13,624.43 2,160,726,792	12,917.87 2,048,671,632	- -	0.44
30	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	81,512	25,539.31 2,081,760,440	24,552.25 2,001,303,002	- -	0.42

(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

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.49
投資信託受益証券	0.19
投資証券	1.95
合計	97.63

(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

2021年2月26日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	6.98
銀行		6.14
情報技術サービス		4.68
医薬品		4.65
コンピュータ・周辺機器		4.46
半導体・半導体製造装置		4.44
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.25
インターネット販売・通信販売		3.44
石油・ガス・消耗燃料		3.24
保険		3.19
資本市場		3.10
ヘルスケア機器・用品		3.05
化学		2.12
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.80
機械		1.79
電力		1.78
バイオテクノロジー		1.77
自動車		1.71
金属・鉱業		1.69
娯楽		1.66
ホテル・レストラン・レジャー		1.61
飲料		1.57
食品		1.57
専門小売り		1.56
各種電気通信サービス		1.48
繊維・アパレル・贅沢品		1.46
航空宇宙・防衛		1.45
食品・生活必需品小売り		1.29
コングロマリット		1.20
メディア		1.15
家庭用品		1.15
陸運・鉄道		1.07
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.01
各種金融サービス		0.94
電気設備		0.86
総合公益事業		0.82
タバコ		0.67
専門サービス		0.66
通信機器		0.64
パーソナル用品		0.62
航空貨物・物流サービス		0.60
建設関連製品		0.55
電子装置・機器・部品		0.55
複合小売り		0.48
不動産管理・開発		0.45
消費者金融		0.43
商業サービス・用品		0.39
家庭用耐久財		0.36
商社・流通業		0.29

自動車部品	0.29
容器・包装	0.29
無線通信サービス	0.28
建設資材	0.27
建設・土木	0.27
ヘルスケア・テクノロジー	0.17
エネルギー設備・サービス	0.16
運送インフラ	0.15
ガス	0.15
紙製品・林産品	0.12
水道	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
販売	0.08
レジャー用品	0.07
旅客航空輸送業	0.06
海運業	0.06
合計	95.49

(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

2021年2月26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	3 2 3 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,200,000,000	101.37 3,244,000,000	101.32 3,242,400,000	0.9 2022/6/20	1.19
2	3 3 9 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,040,000,000	102.22 3,107,579,200	102.02 3,101,681,600	0.4 2025/6/20	1.14
3	3 4 5 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,010,000,000	101.05 3,041,785,600	100.66 3,030,106,800	0.1 2026/12/20	1.11
4	3 3 5 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,940,000,000	102.21 3,005,209,200	102.08 3,001,328,400	0.5 2024/9/20	1.10
5	3 4 4 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,780,000,000	101.00 2,808,009,200	100.69 2,799,321,000	0.1 2026/9/20	1.03
6	1 4 4 回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,750,000,000	100.91 2,775,162,500	100.73 2,770,157,500	0.1 2025/6/20	1.02
7	3 5 0 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,700,000,000	101.03 2,727,837,000	100.45 2,712,339,000	0.1 2028/3/20	0.99
8	3 4 2 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,580,000,000	100.99 2,605,696,800	100.73 2,598,937,200	0.1 2026/3/20	0.95
9	3 4 9 回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,560,000,000	101.05 2,586,929,400	100.54 2,573,900,800	0.1 2027/12/20	0.94

10	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,550,000,000	100.67 2,567,085,000	100.61 2,565,784,500	0.1 2023/12/20	0.94
11	132回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.30 2,507,700,000	100.28 2,507,175,000	0.1 2022/6/20	0.92
12	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,470,000,000	101.07 2,496,429,000	100.63 2,485,684,500	0.1 2027/3/20	0.91
13	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,490,000,000	100.19 2,494,955,700	99.52 2,478,247,200	0.1 2030/9/20	0.91
14	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,380,000,000	102.41 2,437,453,200	102.28 2,434,406,800	0.6 2024/6/20	0.89
15	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	102.06 2,408,781,200	101.99 2,407,152,800	0.6 2023/12/20	0.88
16	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,350,000,000	102.35 2,405,295,500	102.12 2,399,914,000	0.4 2025/9/20	0.88
17	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,330,000,000	102.06 2,378,199,200	101.90 2,374,479,700	0.4 2025/3/20	0.87
18	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,250,000,000	102.24 2,300,557,500	102.14 2,298,195,000	0.6 2024/3/20	0.84
19	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,280,000,000	101.01 2,303,233,200	100.71 2,296,347,600	0.1 2026/6/20	0.84
20	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,210,000,000	101.97 2,253,537,000	101.71 2,247,791,000	0.3 2025/12/20	0.82
21	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,220,000,000	100.95 2,241,090,000	100.30 2,226,660,000	0.1 2028/9/20	0.82
22	356回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,180,000,000	100.72 2,195,892,200	99.95 2,179,062,600	0.1 2029/9/20	0.80
23	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,160,000,000	100.61 2,173,327,200	99.86 2,157,170,400	0.1 2029/12/20	0.79
24	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,160,000,000	100.41 2,169,028,800	99.67 2,153,044,800	0.1 2030/6/20	0.79
25	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,100,000,000	100.96 2,120,331,000	100.75 2,115,834,000	0.1 2025/9/20	0.78
26	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,100,000,000	100.54 2,111,403,000	99.77 2,095,296,000	0.1 2030/3/20	0.77



27	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,010,000,000	101.08 2,031,748,200	100.59 2,022,019,800	0.1 2027/6/20	0.74
28	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	101.09 2,001,621,600	100.55 1,991,008,800	0.1 2027/9/20	0.73
29	133回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,980,000,000	100.36 1,987,246,800	100.34 1,986,771,600	0.1 2022/9/20	0.73
30	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,960,000,000	100.99 1,979,462,800	100.40 1,967,840,000	0.1 2028/6/20	0.72

(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

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	83.31
地方債証券	6.29
特殊債券	6.00
社債券	3.87
合計	99.47

(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

2021年2月26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 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	899,937,500	101.89 916,951,942	101.84 916,530,097	2 2022/2/15	0.68
2	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	742,687,500	101.84 756,380,800	101.77 755,887,603	1.75 2022/3/31	0.56
3	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証券	743,750,000	99.76 742,006,835	99.34 738,869,140	0.125 2024/1/15	0.55
4	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	700,187,500	103.34 723,600,019	103.22 722,779,483	2 2022/11/30	0.53
5	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	680,000,000	95.89 652,109,370	94.45 642,281,250	0.875 2030/11/15	0.47
6	US T N/B 0.25 11/15/23 アメリカ	国債証券	637,500,000	100.19 638,720,213	99.86 636,628,416	0.25 2023/11/15	0.47
7	DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 ドイツ	国債証券	587,632,500	106.78 627,510,709	106.62 626,570,792	2 2023/8/15	0.46
8	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	586,500,000	107.02 627,692,457	106.67 625,630,546	2.75 2023/11/15	0.46
9	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	597,125,000	102.61 612,729,553	102.52 612,216,396	1.625 2022/11/15	0.45

10	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	659,812,500	93.92 619,759,815	92.53 610,584,298	0.625 2030/8/15	0.45
11	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	586,500,000	103.73 608,402,109	103.59 607,577,343	2.125 2022/12/31	0.45
12	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	565,250,000	107.55 607,952,867	107.14 605,612,382	2.75 2024/2/15	0.45
13	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	563,125,000	106.45 599,464,159	105.66 595,020,748	2 2025/2/15	0.44
14	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	551,437,500	108.07 595,983,309	107.09 590,555,097	2.25 2025/11/15	0.44
15	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	573,750,000	102.04 585,493,945	102.00 585,247,409	1.75 2022/5/15	0.43
16	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	514,250,000	115.19 592,391,889	113.60 584,196,031	3.125 2028/11/15	0.43
17	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	550,375,000	106.80 587,826,295	105.92 582,967,519	2 2025/8/15	0.43
18	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	547,187,500	107.12 586,174,609	106.28 581,557,714	2.125 2025/5/15	0.43
19	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	557,812,500	102.64 572,542,236	102.55 572,062,862	1.75 2022/9/30	0.42
20	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証券	567,375,000	100.02 567,530,136	99.94 567,042,552	0.125 2022/11/30	0.42
21	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	529,125,000	103.17 545,949,518	103.03 545,205,436	1.75 2023/1/31	0.40
22	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	506,812,500	105.67 535,558,270	105.19 533,142,990	2 2024/5/31	0.39
23	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	498,312,500	107.10 533,700,470	106.44 530,430,295	2.25 2024/11/15	0.39
24	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	470,687,500	113.13 532,502,003	111.55 525,073,966	2.875 2028/5/15	0.39
25	US T N/B 1.875 06/30/26 アメリカ	国債証券	496,187,500	106.32 527,586,864	105.23 522,159,814	1.875 2026/6/30	0.39
26	FRANCE OAT 0.25 11/25/26 フランス	国債証券	497,227,500	103.90 516,633,294	103.41 514,222,238	0.25 2026/11/25	0.38
27	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	464,312,500	112.14 520,719,209	110.57 513,428,056	2.75 2028/2/15	0.38
28	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	281,547,000	179.23 504,643,153	177.25 499,061,765	4.5 2041/4/25	0.37
29	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	481,312,500	102.74 494,548,593	102.67 494,210,168	2.125 2022/6/30	0.37
30	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	460,062,500	105.81 486,803,632	105.55 485,617,531	2.5 2023/8/15	0.36

(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

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	99.00
合計	99.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### 【投資不動産物件】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型

該当事項はありません。

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年2月26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 0303月	買建	182	3,496,477,920	3,413,410,000	1.12

(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

2021年2月26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 Mar21	買建	403	8,409,656,953	8,195,508,750	1.74
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar21	買建	386	1,838,925,522	1,838,538,072	0.39
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar21	買建	55	533,811,584	541,228,160	0.11
	モントルオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar21	買建	21	385,850,328	381,785,418	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar21	買建	19	266,989,805	268,814,294	0.06

(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】

#### 【純資産の推移】

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型

直近日(2021年2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9計算期間末 (2012年2月27日)	4,993	4,993	1.1720	1.1720
第10計算期間末 (2013年2月25日)	5,846	5,846	1.2689	1.2689
第11計算期間末 (2014年2月25日)	6,797	6,797	1.3874	1.3874
第12計算期間末 (2015年2月25日)	8,185	8,185	1.5056	1.5056
第13計算期間末 (2016年2月25日)	8,608	8,608	1.4954	1.4954
第14計算期間末 (2017年2月27日)	9,711	9,711	1.5586	1.5586
第15計算期間末 (2018年2月26日)	10,879	10,879	1.6264	1.6264
第16計算期間末 (2019年2月25日)	12,140	12,140	1.6261	1.6261
第17計算期間末 (2020年2月25日)	14,046	14,046	1.6706	1.6706
第18計算期間末 (2021年2月25日)	16,105	16,105	1.7306	1.7306
2020年2月末日	13,896	-	1.6476	-
3月末日	13,457	-	1.6050	-

4月末日	13,669	-	1.6264	-
5月末日	14,137	-	1.6481	-
6月末日	14,271	-	1.6466	-
7月末日	14,397	-	1.6415	-
8月末日	14,729	-	1.6669	-
9月末日	14,932	-	1.6709	-
10月末日	14,930	-	1.6555	-
11月末日	15,408	-	1.7014	-
12月末日	15,687	-	1.7145	-
2021年1月末日	15,913	-	1.7138	-
2月末日	15,969	-	1.7163	-

## D I A Mバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型

直近日(2021年2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9計算期間末 (2012年2月27日)	11,905	11,905	1.1984	1.1984
第10計算期間末 (2013年2月25日)	14,251	14,251	1.3506	1.3506
第11計算期間末 (2014年2月25日)	16,454	16,454	1.5495	1.5495
第12計算期間末 (2015年2月25日)	19,545	19,545	1.7503	1.7503
第13計算期間末 (2016年2月25日)	18,932	18,932	1.6738	1.6738
第14計算期間末 (2017年2月27日)	21,334	21,334	1.8059	1.8059
第15計算期間末 (2018年2月26日)	23,907	23,907	1.9363	1.9363
第16計算期間末 (2019年2月25日)	25,795	25,795	1.9233	1.9233
第17計算期間末 (2020年2月25日)	28,999	28,999	1.9981	1.9981
第18計算期間末 (2021年2月25日)	33,402	33,402	2.1637	2.1637
2020年2月末日	28,290	-	1.9430	-
3月末日	26,922	-	1.8687	-
4月末日	27,635	-	1.9124	-
5月末日	28,762	-	1.9615	-
6月末日	28,975	-	1.9651	-
7月末日	29,051	-	1.9537	-
8月末日	30,097	-	2.0150	-
9月末日	30,393	-	2.0158	-
10月末日	30,182	-	1.9862	-
11月末日	31,578	-	2.0824	-
12月末日	32,220	-	2.1106	-
2021年1月末日	32,581	-	2.1147	-

2月末日	32,950	-	2.1344	-
------	--------	---	--------	---

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 3成長型

直近日(2021年2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9計算期間末 (2012年2月27日)	9,234	9,234	1.2166	1.2166
第10計算期間末 (2013年2月25日)	11,326	11,326	1.4236	1.4236
第11計算期間末 (2014年2月25日)	13,230	13,230	1.7075	1.7075
第12計算期間末 (2015年2月25日)	15,889	15,889	2.0030	2.0030
第13計算期間末 (2016年2月25日)	14,524	14,524	1.8463	1.8463
第14計算期間末 (2017年2月27日)	16,465	16,465	2.0530	2.0530
第15計算期間末 (2018年2月26日)	18,810	18,810	2.2555	2.2555
第16計算期間末 (2019年2月25日)	20,092	20,092	2.2234	2.2234
第17計算期間末 (2020年2月25日)	22,391	22,391	2.3353	2.3353
第18計算期間末 (2021年2月25日)	26,255	26,255	2.6198	2.6198
2020年2月末日	21,497	-	2.2399	-
3月末日	20,055	-	2.1243	-
4月末日	20,802	-	2.1943	-
5月末日	21,905	-	2.2747	-
6月末日	22,072	-	2.2845	-
7月末日	22,150	-	2.2672	-
8月末日	23,186	-	2.3698	-
9月末日	23,318	-	2.3665	-
10月末日	23,045	-	2.3201	-
11月末日	24,427	-	2.4766	-
12月末日	24,982	-	2.5229	-
2021年1月末日	25,329	-	2.5331	-
2月末日	25,792	-	2.5732	-

## 【分配の推移】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 1安定型

	1口当たりの分配金(円)
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
第18計算期間	0.0000

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 2 安定・成長型

	1口当たりの分配金(円)
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
第18計算期間	0.0000

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 3 成長型

	1口当たりの分配金(円)
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
第18計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 1 安定型

	収益率(%)
第9計算期間	0.6
第10計算期間	8.3
第11計算期間	9.3
第12計算期間	8.5
第13計算期間	0.7
第14計算期間	4.2
第15計算期間	4.4
第16計算期間	0.0
第17計算期間	2.7
第18計算期間	3.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C 年金 &gt; 2 安定・成長型

	収益率(%)
第9計算期間	0.7

第10計算期間	12.7
第11計算期間	14.7
第12計算期間	13.0
第13計算期間	4.4
第14計算期間	7.9
第15計算期間	7.2
第16計算期間	0.7
第17計算期間	3.9
第18計算期間	8.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

	収益率 (%)
第9計算期間	1.8
第10計算期間	17.0
第11計算期間	19.9
第12計算期間	17.3
第13計算期間	7.8
第14計算期間	11.2
第15計算期間	9.9
第16計算期間	1.4
第17計算期間	5.0
第18計算期間	12.2

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### ( 4 ) 【設定及び解約の実績】

##### D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

	設定口数	解約口数
第9計算期間	891,096,153	423,802,872
第10計算期間	792,020,789	445,175,024
第11計算期間	1,211,792,457	920,086,264
第12計算期間	1,286,101,728	748,268,806
第13計算期間	1,428,568,208	1,108,983,410
第14計算期間	1,177,511,256	702,902,178
第15計算期間	1,447,662,999	989,556,322
第16計算期間	1,628,738,236	851,823,010
第17計算期間	1,933,987,415	992,137,886
第18計算期間	2,435,613,354	1,537,362,088

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

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

	設定口数	解約口数
第9計算期間	1,799,986,538	838,294,174
第10計算期間	1,442,236,754	824,908,601
第11計算期間	1,713,460,271	1,646,999,165
第12計算期間	1,739,079,770	1,190,841,426
第13計算期間	1,697,863,637	1,553,640,036
第14計算期間	1,423,621,400	920,758,675
第15計算期間	1,657,767,778	1,125,122,159
第16計算期間	1,981,921,051	916,350,971



第17計算期間	2,437,684,904	1,336,440,297
第18計算期間	2,967,927,595	2,044,238,507

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型

	設定口数	解約口数
第9計算期間	1,241,120,741	648,446,247
第10計算期間	1,210,113,248	844,741,332
第11計算期間	1,548,578,623	1,756,263,299
第12計算期間	1,448,206,115	1,263,916,173
第13計算期間	1,425,335,822	1,490,982,099
第14計算期間	1,086,201,353	932,940,956
第15計算期間	1,357,837,135	1,038,315,671
第16計算期間	1,485,604,296	788,709,795
第17計算期間	1,754,564,428	1,202,899,164
第18計算期間	2,137,759,735	1,703,975,804

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

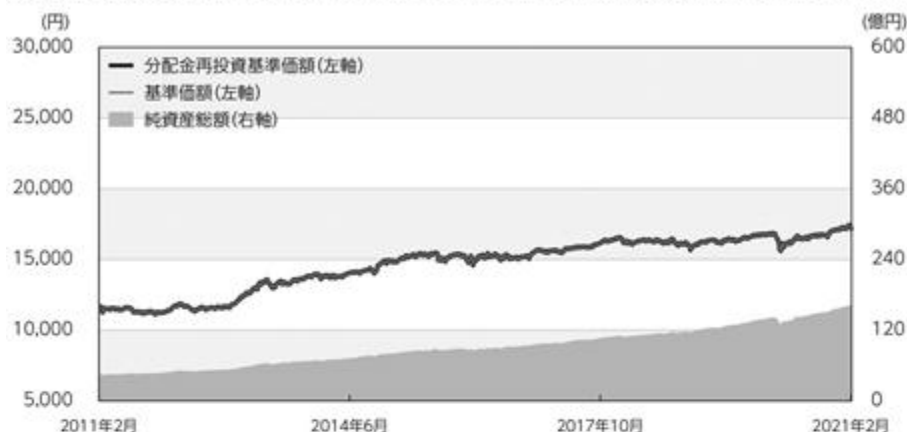
&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2021年2月26日

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型

## 基準価額・純資産の推移 (2011年2月28日~2021年2月26日)

## 分配の推移(税引前)



2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。

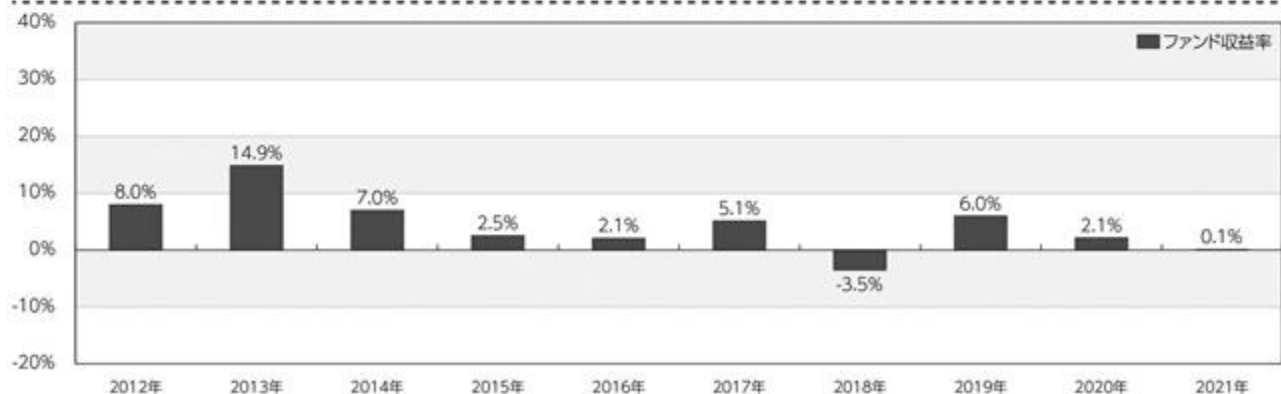
(設定日:2002年12月13日)

## 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	64.89
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	18.93
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.83
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.34

## 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。

※2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型

## 基準価額・純資産の推移 (2011年2月28日～2021年2月26日)

## 分配の推移(税引前)



2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。

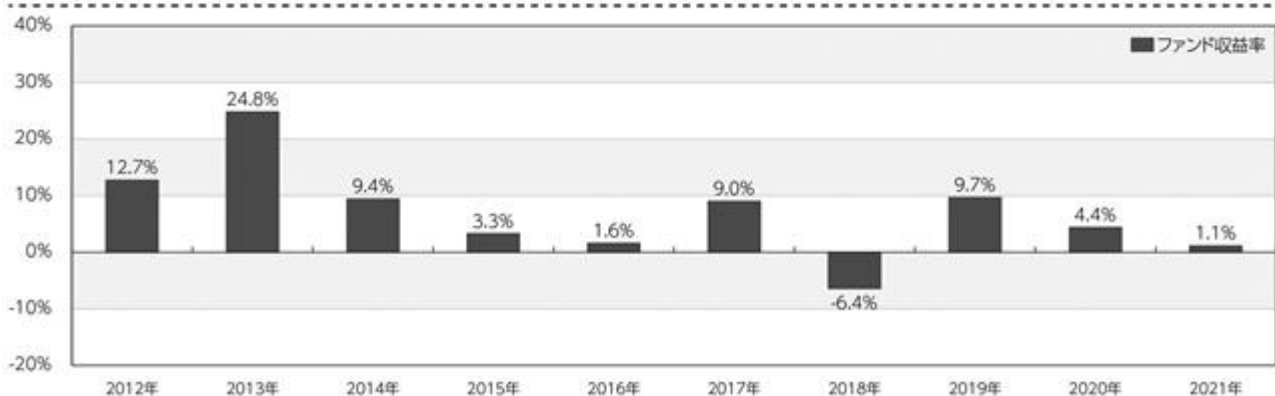
(設定日:2002年12月13日)

## 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	41.77
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30.99
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.21
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.98

## 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。

※2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型

## 基準価額・純資産の推移 (2011年2月28日～2021年2月26日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2002年12月13日)

## 分配の推移(税引前)

2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
設定来累計	0円

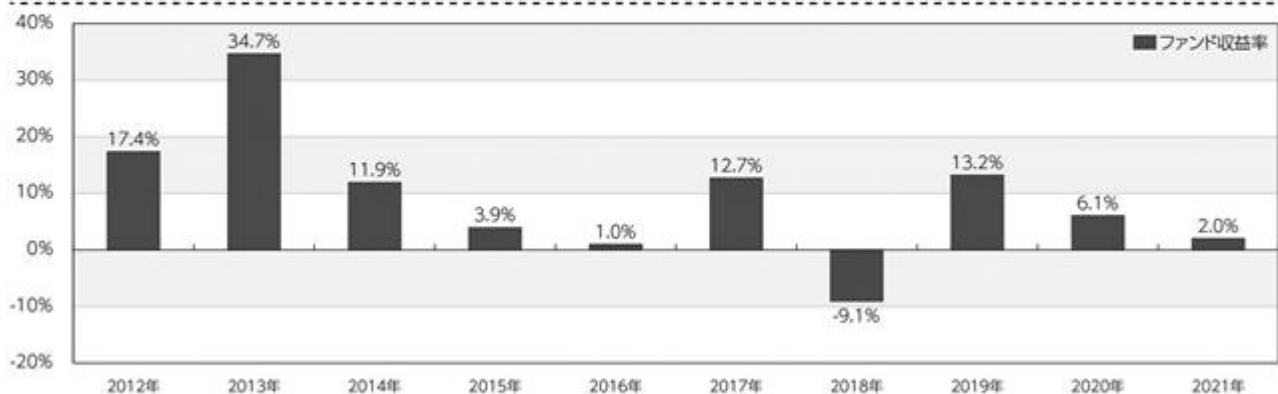
※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	40.37
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.30
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.99
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.29

## 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。

※2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 主要な資産の状況

### ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.09
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.98
3	ソニー	株式	日本	電気機器	2.70
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.92
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.46

### ■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	4.17
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.32
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.63
4	FACEBOOK 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	1.24
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.23

### ■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	323回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.9	2022/6/20	1.19
2	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	1.14
3	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	1.11
4	335回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2024/9/20	1.10
5	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/9/20	1.03

### ■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 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2	2022/2/15	0.68
2	US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	アメリカ	1.75	2022/3/31	0.56
3	US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	アメリカ	0.125	2024/1/15	0.55
4	US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	アメリカ	2	2022/11/30	0.53
5	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.47

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。ただし、ニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

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

#### ・お申込価額（発行価格）はお申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あ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 <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

収益分配金の再投資をする場合は、1口単位となります。

#### ・お申込手数料はありません。

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

## 2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求  
をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求  
を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の請求の受付は、原則として販売会  
社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完  
了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約  
請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。
- ・解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ・解約価額の照会方法等  
解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。  
当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。
  - ・販売会社へのお問い合わせ
  - ・委託会社への照会  
ホームページ URL <http://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）
- ・換金（解約）単位は1口単位とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社にて計算されます。



当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://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2002年12月13日から無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとします。

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

(5)【その他】

イ. 償還規定

- 委託会社は各ファンドについて受益権の口数が10億口を下回る事となった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 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。
- 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。
- 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

- f. 上記c. ~ e.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であつて、上記c.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる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.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### 八．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。

#### 二．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 <http://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 <http://www.am-one.co.jp/>）

### 4【受益者の権利等】

#### 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。

#### 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。

#### 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。

#### 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バランス・ファンド<DC年金>1安定型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

(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18期計算期間(2020年2月26日から2021年2月25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。

## 1【財務諸表】

## 【DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;1安定型】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	478,752,650	529,288,378
親投資信託受益証券	13,624,534,364	15,621,454,220
未収入金	6,509,000	10,090,000
流動資産合計	14,109,796,014	16,160,832,598
資産合計	14,109,796,014	16,160,832,598
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	43,798,428	32,854,307
未払受託者報酬	2,246,669	2,550,717
未払委託者報酬	17,224,869	19,555,728
その他未払費用	280,471	303,399
流動負債合計	63,550,437	55,264,151
負債合計	63,550,437	55,264,151
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,407,981,806	9,306,233,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,638,263,771	6,799,335,375
（分配準備積立金）	1,517,515,367	1,840,274,372
元本等合計	14,046,245,577	16,105,568,447
純資産合計	14,046,245,577	16,105,568,447
負債純資産合計	14,109,796,014	16,160,832,598

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期 自 2019年2月26日 至 2020年2月25日	第18期 自 2020年2月26日 至 2021年2月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	477
有価証券売買等損益	388,886,620	596,836,856
<b>営業収益合計</b>	<b>388,886,620</b>	<b>596,837,333</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	255,198	190,008
受託者報酬	4,268,355	4,835,684
委託者報酬	32,724,782	37,074,119
その他費用	536,447	578,273
<b>営業費用合計</b>	<b>37,784,782</b>	<b>42,678,084</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>351,101,838</b>	<b>554,159,249</b>
経常利益又は経常損失( )	351,101,838	554,159,249
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>351,101,838</b>	<b>554,159,249</b>
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( )	21,667,876	14,043,645
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>4,674,575,193</b>	<b>5,638,263,771</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>1,256,882,700</b>	<b>1,618,937,324</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,256,882,700	1,618,937,324
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>622,628,084</b>	<b>1,026,068,614</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	622,628,084	1,026,068,614
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>5,638,263,771</b>	<b>6,799,335,375</b>

## (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18期	
	自 2020年2月26日	至 2021年2月25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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期
	2020年2月25日現在	2021年2月25日現在
1. 期首元本額	7,466,132,277円	8,407,981,806円
期中追加設定元本額	1,933,987,415円	2,435,613,354円
期中一部解約元本額	992,137,886円	1,537,362,088円
2. 受益権の総数	8,407,981,806口	9,306,233,072口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第17期	第18期
	自 2019年2月26日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(329,422,612円)、信託約款に規定される収益調整金(4,120,987,428円)及び分配準備積立金(1,188,092,755円)より分配対象収益は5,638,502,795円(1万口当たり6,706.13円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(568,176,667円)、信託約款に規定される収益調整金(4,959,235,141円)及び分配準備積立金(1,272,097,705円)より分配対象収益は6,799,509,513円(1万口当たり7,306.40円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期	第18期
	自 2019年2月26日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月25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。	同左
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。リスク管理に関する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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25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	368,632,616	557,199,582
合計	368,632,616	557,199,582

（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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6706円 (16,706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

2021年2月25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	999,360,564	3,122,801,890	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	8,010,802,658	10,373,188,361	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	183,355,556	868,426,919	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	632,089,833	1,257,037,050	
親投資信託受益証券	合計	9,825,608,611	15,621,454,220	
合計			15,621,454,220	

（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。

## 【DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;2安定・成長型】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	960,490,669	1,081,369,703
親投資信託受益証券	28,119,696,799	32,399,235,856
未収入金	25,483,000	10,942,000
流動資産合計	29,105,670,468	33,491,547,559
資産合計	29,105,670,468	33,491,547,559
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	60,577,233	38,137,895
未払受託者報酬	4,678,351	5,227,048
未払委託者報酬	40,546,057	45,301,585
その他未払費用	498,074	508,328
流動負債合計	106,299,715	89,174,856
負債合計	106,299,715	89,174,856
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,513,700,083	15,437,389,171
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,485,670,670	17,964,983,532
(分配準備積立金)	5,617,215,905	7,432,506,962
元本等合計	28,999,370,753	33,402,372,703
純資産合計	28,999,370,753	33,402,372,703
負債純資産合計	29,105,670,468	33,491,547,559

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期		第18期	
	自	2019年2月26日 2020年2月25日	自	2020年2月26日 2021年2月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		971
有価証券売買等損益		1,134,079,329		2,613,017,057
営業収益合計		1,134,079,329		2,613,018,028
<b>営業費用</b>				
支払利息		529,215		382,573
受託者報酬		8,926,731		9,853,470
委託者報酬		77,365,810		85,397,438
その他費用		971,684		984,282
営業費用合計		87,793,440		96,617,763
営業利益又は営業損失( )		1,046,285,889		2,516,400,265
経常利益又は経常損失( )		1,046,285,889		2,516,400,265
当期純利益又は当期純損失( )		1,046,285,889		2,516,400,265
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( )		43,932,774		22,853,072
期首剰余金又は期首欠損金( )		12,383,354,583		14,485,670,670
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,335,337,167		2,972,832,616
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		2,335,337,167		2,972,832,616
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,235,374,195		2,032,773,091
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,235,374,195		2,032,773,091
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( )		14,485,670,670		17,964,983,532

## (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18期	
	自 2020年2月26日	至 2021年2月25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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期
	2020年2月25日現在	2021年2月25日現在
1. 期首元本額	13,412,455,476円	14,513,700,083円
期中追加設定元本額	2,437,684,904円	2,967,927,595円
期中一部解約元本額	1,336,440,297円	2,044,238,507円
2. 受益権の総数	14,513,700,083口	15,437,389,171口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第17期	第18期
	自 2019年2月26日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(866,116,896円)、信託約款に規定される収益調整金(8,868,958,228円)及び分配準備積立金(4,751,099,009円)より分配対象収益は14,486,174,133円(1万口当たり9,981.03円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(2,539,171,528円)、信託約款に規定される収益調整金(10,532,833,348円)及び分配準備積立金(4,893,335,434円)より分配対象収益は17,965,340,310円(1万口当たり11,637.55円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期	第18期
	自 2019年2月26日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月25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。	同左
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。リスク管理に関する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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,085,748,728	2,566,865,500
合計	1,085,748,728	2,566,865,500

（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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9981円 (19,981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

2021年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	3,376,357,994	10,550,443,459	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	10,638,855,349	13,776,253,791	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	935,988,345	4,433,121,598	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,830,048,277	3,639,417,008	
親投資信託受益証券	合計	16,781,249,965	32,399,235,856	
合計			32,399,235,856	

（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。

## 【DIAMバランス・ファンド&lt;DC年金&gt;3成長型】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	772,870,930	873,169,163
親投資信託受益証券	21,710,972,723	25,468,006,753
未収入金	35,742,000	4,045,000
流動資産合計	22,519,585,653	26,345,220,916
資産合計	22,519,585,653	26,345,220,916
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	89,311,232	45,635,166
未払受託者報酬	3,624,951	4,045,565
未払委託者報酬	35,041,474	39,107,526
その他未払費用	432,243	438,002
流動負債合計	128,409,900	89,226,259
負債合計	128,409,900	89,226,259
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,588,307,375	10,022,091,306
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	12,802,868,378	16,233,903,351
(分配準備積立金)	4,608,525,482	6,696,959,311
元本等合計	22,391,175,753	26,255,994,657
純資産合計	22,391,175,753	26,255,994,657
負債純資産合計	22,519,585,653	26,345,220,916



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期		第18期	
	自	2019年2月26日 2020年2月25日	自	2020年2月26日 2021年2月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		752
有価証券売買等損益		1,120,878,007		2,896,469,030
営業収益合計		1,120,878,007		2,896,469,782
<b>営業費用</b>				
支払利息		413,916		295,017
受託者報酬		6,920,791		7,549,258
委託者報酬		66,901,649		72,976,993
その他費用		845,495		845,241
営業費用合計		75,081,851		81,666,509
営業利益又は営業損失( )		1,045,796,156		2,814,803,273
経常利益又は経常損失( )		1,045,796,156		2,814,803,273
当期純利益又は当期純損失( )		1,045,796,156		2,814,803,273
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( )		63,926,267		16,386,624
期首剰余金又は期首欠損金( )		11,055,583,300		12,802,868,378
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,238,899,121		2,863,361,105
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		2,238,899,121		2,863,361,105
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,473,483,932		2,263,516,029
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,473,483,932		2,263,516,029
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( )		12,802,868,378		16,233,903,351

## (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18期	
	自 2020年2月26日	至 2021年2月25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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期
	2020年2月25日現在	2021年2月25日現在
1. 期首元本額	9,036,642,111円	9,588,307,375円
期中追加設定元本額	1,754,564,428円	2,137,759,735円
期中一部解約元本額	1,202,899,164円	1,703,975,804円
2. 受益権の総数	9,588,307,375口	10,022,091,306口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第17期	第18期
	自 2019年2月26日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(752,541,703円)、信託約款に規定される収益調整金(8,194,727,888円)及び分配準備積立金(3,855,983,779円)より分配対象収益は12,803,253,370円(1万口当たり13,352.98円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(2,831,137,279円)、信託約款に規定される収益調整金(9,537,214,367円)及び分配準備積立金(3,865,822,032円)より分配対象収益は16,234,173,678円(1万口当たり16,198.38円)であります。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17期	第18期
	自 2019年2月26日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月25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。	同左
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。リスク管理に関する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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,066,524,520	2,854,366,011
合計	1,066,524,520	2,854,366,011

（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17期 2020年2月25日現在	第18期 2021年2月25日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3353円 (23,353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

2021年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	3,442,508,998	10,757,152,116	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	4,243,719,533	5,495,192,423	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,108,633,939	5,250,822,925	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,993,683,959	3,964,839,289	
親投資信託受益証券	合計	10,788,546,429	25,468,006,753	
合計			25,468,006,753	

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

2021年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,401,231,433
株式	312,247,456,360
派生商品評価勘定	109,807,200
未収入金	150,198,765
未収配当金	488,265,044
差入委託証拠金	220,800,000
流動資産合計	318,617,758,802
資産合計	318,617,758,802
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	440,660
前受金	98,320,000
未払金	704,351,361
未払解約金	1,628,275,000
流動負債合計	2,431,387,021
負債合計	2,431,387,021
純資産の部	
元本等	
元本	101,185,876,143
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	215,000,495,638
元本等合計	316,186,371,781
純資産合計	316,186,371,781
負債純資産合計	318,617,758,802

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年2月26日 至 2021年2月25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	2021年2月25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	98,480,866,315円
同期中追加設定元本額	66,660,054,051円
同期中一部解約元本額	63,955,044,223円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	16,062,653,368円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,149,088,591円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,626,890円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,088,758円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,008,614円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,515,174円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,825,235円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,283,611円
たわらノーロード TOPIX	799,564,161円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	614,866,606円
たわらノーロード バランス(堅実型)	22,758,258円
たわらノーロード バランス(標準型)	140,720,417円
たわらノーロード バランス(積極型)	207,481,506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)	1,733,499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)	103,373,853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)	250,674,166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)	167,827,585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)	232,960,934円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	428,878円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,182,060円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,470,531円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,469,714円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,212,369円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,550,036,621円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	999,360,564円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,376,357,994円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,442,508,998円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	327,576,470円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,141,519,833円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,080,573,825円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	35,362,632円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,112,139,190円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	21,186,872円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	305,003,323円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	261,308,083円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	439,000,020円
投資のソムリエ	15,620,354,669円
クルーズコントロール	783,601,164円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,620円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	292,369,938円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	363,312,331円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	9,459,522円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	18,761,808円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,134,149円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,070,573円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,599,277円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	42,338,447円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	94,906,211円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,673,688,381円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	258,159,046円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,392,374円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,239,774円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,838,865円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	4,048,900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)	8,112,498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)	9,870,081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)	71,448,850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)	5,073,729円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	39,612,618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)	562,668,029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)	13,116,912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)	67,647,738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)	122,283,853円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,507,871円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,883,979円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,937,911円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,562,653円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,366,969円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	41,324,156円



D I A M バランスファンド 2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	647,884,647円
D I A M バランスファンド 3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	693,676,074円
D I A M バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,960,783,712円
D I A M グローバル・アセット・バランス V A ( 適格機関投資家限定 )	140,651,859円
D I A M グローバル・アセット・バランス V A 2 ( 適格機関投資家限定 )	35,408,446円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド 3 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	353,376,334円
D I A M 世界アセットバランスファンド V A ( 適格機関投資家向け )	94,190,116円
D I A M 世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,538,095円
D I A M 世界アセットバランスファンド 2 V A ( 適格機関投資家限定 )	442,882,456円
D I A M 世界アセットバランスファンド 4 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	22,997,422円
D I A M 世界アセットバランスファンド 2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	94,775,529円
D I A M 世界アセットバランスファンド 3 V A ( 適格機関投資家限定 )	225,438,875円
D I A M 世界アセットバランスファンド 4 V A ( 適格機関投資家限定 )	305,028,294円
D I A M 世界バランス 2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	43,467,520円
D I A M 国内バランス 3 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	19,291,987円
D I A M 世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 2 1 2 ) ( 適格機関投資家限定 )	338,845,996円
D I A M 世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 3 0 3 ) ( 適格機関投資家限定 )	1,035,811,275円
D I A M 世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 3 0 6 ) ( 適格機関投資家限定 )	1,371,850,373円
D I A M 世界アセットバランスファンド 7 V A ( 1 3 0 9 ) ( 適格機関投資家限定 )	55,151,536円
計	101,185,876,143円
2. 受益権の総数	101,185,876,143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 2020年2月26日 至 2021年2月25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。リスク管理に関する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	2021年2月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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	2021年2月25日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	372,720,599
合計	372,720,599

(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(2021年2月9日から2021年2月25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	2021年2月25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	3,019,610,000	-	3,129,030,000	109,420,000
合計	3,019,610,000	-	3,129,030,000	109,420,000

## (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

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)

	2021年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1248円 (31,248円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,400	3,035.00	16,389,000	
日本水産	148,600	515.00	76,529,000	
マルハニチロ	25,200	2,529.00	63,730,800	
ハウスイ	600	981.00	588,600	
雪国まいたけ	9,900	1,787.00	17,691,300	
カネコ種苗	4,600	1,590.00	7,314,000	
サカタのタネ	19,200	3,805.00	73,056,000	
ホクト	13,600	2,106.00	28,641,600	
ホクリヨウ	2,300	684.00	1,573,200	
ヒノキヤグループ	4,000	2,164.00	8,656,000	
ショーボンドホールディングス	22,900	4,735.00	108,431,500	
ミライト・ホールディングス	55,700	1,723.00	95,971,100	
タマホーム	9,700	1,854.00	17,983,800	
サンヨーホームズ	2,200	826.00	1,817,200	
日本アクア	6,400	614.00	3,929,600	
ファーストコーポレーション	4,900	690.00	3,381,000	
ベステラ	3,000	1,786.00	5,358,000	
TATERU	29,900	177.00	5,292,300	
キャンディル	2,800	543.00	1,520,400	
スペースバリューホールディングス	19,600	792.00	15,523,200	
住石ホールディングス	27,800	124.00	3,447,200	
日鉄鉱業	3,700	6,450.00	23,865,000	
三井松島ホールディングス	6,700	1,029.00	6,894,300	
国際石油開発帝石	590,100	790.00	466,179,000	
石油資源開発	21,000	2,274.00	47,754,000	
K&Oエナジーグループ	7,700	1,439.00	11,080,300	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	847.00	2,625,700	
第一カッター興業	4,000	1,321.00	5,284,000	
明豊ファシリティワークス	5,300	629.00	3,333,700	
安藤・間	102,900	812.00	83,554,800	
東急建設	47,000	551.00	25,897,000	
コムシスホールディングス	56,900	3,375.00	192,037,500	

ビーアールホールディングス	19,000	647.00	12,293,000	
高松コンストラクショングループ	10,100	2,129.00	21,502,900	
東建コーポレーション	4,900	8,480.00	41,552,000	
ソネック	1,700	829.00	1,409,300	
ヤマウラ	7,200	965.00	6,948,000	
大成建設	115,400	3,910.00	451,214,000	
大林組	370,800	957.00	354,855,600	
清水建設	347,300	845.00	293,468,500	
飛島建設	10,500	1,116.00	11,718,000	
長谷工コーポレーション	121,300	1,372.00	166,423,600	
松井建設	14,700	707.00	10,392,900	
銭高組	1,200	4,530.00	5,436,000	
鹿島建設	271,600	1,422.00	386,215,200	
不動テトラ	9,100	1,843.00	16,771,300	
大末建設	4,900	920.00	4,508,000	
鉄建建設	7,500	1,945.00	14,587,500	
西松建設	26,500	2,657.00	70,410,500	
三井住友建設	89,400	473.00	42,286,200	
大豊建設	8,100	3,745.00	30,334,500	
前田建設工業	92,900	977.00	90,763,300	
佐田建設	6,700	433.00	2,901,100	
ナカノフドー建設	9,700	374.00	3,627,800	
奥村組	20,400	2,765.00	56,406,000	
東鉄工業	16,000	2,643.00	42,288,000	
イチケン	2,700	2,188.00	5,907,600	
富士ピー・エス	5,000	602.00	3,010,000	
浅沼組	4,400	4,685.00	20,614,000	
戸田建設	154,100	749.00	115,420,900	
熊谷組	17,100	2,876.00	49,179,600	
北野建設	1,900	2,500.00	4,750,000	
植木組	1,600	2,891.00	4,625,600	
矢作建設工業	16,700	843.00	14,078,100	
ピーエス三菱	12,200	680.00	8,296,000	
日本ハウスホールディングス	25,600	336.00	8,601,600	
大東建託	40,500	12,280.00	497,340,000	
新日本建設	15,900	851.00	13,530,900	
N I P P O	30,800	2,829.00	87,133,200	
東亜道路工業	2,400	4,080.00	9,792,000	
前田道路	22,900	2,228.00	51,021,200	
日本道路	3,600	8,100.00	29,160,000	
東亜建設工業	9,900	2,305.00	22,819,500	
日本国土開発	36,300	559.00	20,291,700	
若築建設	6,700	1,284.00	8,602,800	
東洋建設	41,600	551.00	22,921,600	
五洋建設	157,500	820.00	129,150,000	
世紀東急工業	17,900	898.00	16,074,200	
福田組	4,300	5,030.00	21,629,000	
日本ドライケミカル	3,000	1,613.00	4,839,000	
住友林業	87,200	2,038.00	177,713,600	
日本基礎技術	11,700	498.00	5,826,600	

巴コーポレーション	16,800	386.00	6,484,800	
大和ハウス工業	342,400	3,142.00	1,075,820,800	
ライト工業	21,300	1,714.00	36,508,200	
積水ハウス	402,200	2,085.50	838,788,100	
日特建設	9,900	813.00	8,048,700	
北陸電気工事	6,600	1,187.00	7,834,200	
ユアテック	21,300	798.00	16,997,400	
日本リーテック	7,700	2,535.00	19,519,500	
四電工	1,700	2,845.00	4,836,500	
中電工	17,100	2,221.00	37,979,100	
関電工	60,400	897.00	54,178,800	
きんでん	80,200	1,780.00	142,756,000	
東京エネシス	12,300	934.00	11,488,200	
トーエネック	3,800	3,720.00	14,136,000	
住友電設	10,500	2,447.00	25,693,500	
日本電設工業	20,400	1,924.00	39,249,600	
協和エクシオ	56,200	2,817.00	158,315,400	
新日本空調	9,800	2,198.00	21,540,400	
日本工営	7,100	2,858.00	20,291,800	
九電工	26,100	3,475.00	90,697,500	
三機工業	26,300	1,326.00	34,873,800	
日揮ホールディングス	123,600	1,400.00	173,040,000	
中外炉工業	4,100	1,872.00	7,675,200	
ヤマト	11,900	661.00	7,865,900	
太平電業	8,200	2,693.00	22,082,600	
高砂熱学工業	33,500	1,623.00	54,370,500	
三晃金属工業	1,600	3,055.00	4,888,000	
NEC ネットエスアイ	38,300	1,836.00	70,318,800	
朝日工業社	2,100	2,997.00	6,293,700	
明星工業	24,100	804.00	19,376,400	
大気社	18,000	2,886.00	51,948,000	
ダイダン	8,200	2,741.00	22,476,200	
日比谷総合設備	12,200	1,864.00	22,740,800	
ニッポン	35,000	1,599.00	55,965,000	
日清製粉グループ本社	134,100	1,762.00	236,284,200	
日東富士製粉	600	6,810.00	4,086,000	
昭和産業	10,100	3,170.00	32,017,000	
鳥越製粉	10,800	848.00	9,158,400	
中部飼料	14,600	1,403.00	20,483,800	
フィード・ワン	16,200	903.00	14,628,600	
東洋精糖	1,700	1,216.00	2,067,200	
日本甜菜製糖	6,400	1,655.00	10,592,000	
三井製糖	9,500	1,913.00	18,173,500	
塩水港精糖	14,400	228.00	3,283,200	
日新製糖	4,500	1,865.00	8,392,500	
LIFULL	39,400	419.00	16,508,600	
ミクシィ	21,600	2,741.00	59,205,600	
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	1,649.00	12,367,500	
日本M&Aセンター	92,600	5,840.00	540,784,000	
メンバーズ	3,300	2,542.00	8,388,600	

中広	1,200	350.00	420,000
UTグループ	16,300	3,320.00	54,116,000
アイティメディア	3,700	1,804.00	6,674,800
タケエイ	12,500	1,241.00	15,512,500
E・Jホールディングス	4,400	1,001.00	4,404,400
ビーネックスグループ	14,100	1,458.00	20,557,800
コシダカホールディングス	26,800	578.00	15,490,400
アルトナー	2,800	863.00	2,416,400
パソナグループ	12,200	1,892.00	23,082,400
CDS	2,400	1,429.00	3,429,600
リンクアンドモチベーション	20,700	540.00	11,178,000
GCA	14,600	769.00	11,227,400
エス・エム・エス	38,400	3,535.00	135,744,000
サニーサイドアップグループ	4,000	757.00	3,028,000
パーソルホールディングス	113,000	2,188.00	247,244,000
リニカル	6,500	780.00	5,070,000
クックパッド	35,600	306.00	10,893,600
エスクリ	3,600	469.00	1,688,400
アイ・ケイ・ケイ	5,600	608.00	3,404,800
森永製菓	27,800	3,960.00	110,088,000
中村屋	2,500	3,950.00	9,875,000
江崎グリコ	32,700	4,460.00	145,842,000
名糖産業	5,600	1,517.00	8,495,200
井村屋グループ	6,800	2,572.00	17,489,600
不二家	7,600	2,276.00	17,297,600
山崎製パン	89,000	1,828.00	162,692,000
第一屋製パン	2,900	973.00	2,821,700
モロゾフ	1,700	5,610.00	9,537,000
亀田製菓	6,900	4,775.00	32,947,500
寿スピリッツ	11,400	7,240.00	82,536,000
カルビー	54,100	2,871.00	155,321,100
森永乳業	21,900	4,985.00	109,171,500
六甲バター	8,000	1,690.00	13,520,000
ヤクルト本社	81,600	5,420.00	442,272,000
明治ホールディングス	78,500	6,900.00	541,650,000
雪印メグミルク	28,600	2,198.00	62,862,800
プリマハム	16,800	3,235.00	54,348,000
日本ハム	45,400	4,605.00	209,067,000
林兼産業	3,600	624.00	2,246,400
丸大食品	11,800	1,699.00	20,048,200
S Foods	10,700	3,360.00	35,952,000
柿安本店	4,100	2,588.00	10,610,800
伊藤ハム米久ホールディングス	76,700	745.00	57,141,500
学情	3,900	1,451.00	5,658,900
スタジオアリス	5,700	2,053.00	11,702,100
クロスキャット	3,000	1,145.00	3,435,000
シミックホールディングス	5,600	1,657.00	9,279,200
エプコ	2,800	916.00	2,564,800
システナ	41,400	1,835.00	75,969,000
NJS	2,800	1,869.00	5,233,200

デジタルアーツ	6,800	10,100.00	68,680,000	
日鉄ソリューションズ	17,300	3,175.00	54,927,500	
総合警備保障	45,000	4,965.00	223,425,000	
キューブシステム	6,200	1,115.00	6,913,000	
いちご	129,600	364.00	47,174,400	
エイジア	1,800	1,675.00	3,015,000	
日本駐車場開発	115,500	141.00	16,285,500	
コア	4,900	1,485.00	7,276,500	
カカクコム	83,500	3,500.00	292,250,000	
アイロムグループ	4,000	1,948.00	7,792,000	
セントケア・ホールディング	8,300	901.00	7,478,300	
サイネックス	2,200	722.00	1,588,400	
ルネサンス	7,000	1,225.00	8,575,000	
ディップ	17,600	3,090.00	54,384,000	
SBSホールディングス	8,700	2,426.00	21,106,200	
デジタルホールディングス	7,800	1,801.00	14,047,800	
新日本科学	13,700	643.00	8,809,100	
ツクイホールディングス	26,700	924.00	24,670,800	
キャリアデザインセンター	2,500	988.00	2,470,000	
ベネフィット・ワン	41,200	2,788.00	114,865,600	
エムスリー	199,300	8,539.00	1,701,822,700	
ツカダ・グローバルホールディング	9,500	346.00	3,287,000	
プラス	1,500	550.00	825,000	
アウトソーシング	64,700	1,597.00	103,325,900	
ウェルネット	11,500	564.00	6,486,000	
ワールドホールディングス	3,900	2,538.00	9,898,200	
ディー・エヌ・エー	47,800	2,186.00	104,490,800	
博報堂DYホールディングス	157,200	1,835.00	288,462,000	
ぐるなび	19,600	671.00	13,151,600	
タカミヤ	14,100	517.00	7,289,700	
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	888.00	7,903,200	
ファンコミュニケーションズ	31,300	399.00	12,488,700	
ライク	3,000	1,910.00	5,730,000	
ビジネス・ブレークスルー	5,100	426.00	2,172,600	
エスプール	28,900	1,055.00	30,489,500	
WDBホールディングス	5,200	2,548.00	13,249,600	
手間いらず	1,100	5,720.00	6,292,000	
ティア	7,200	518.00	3,729,600	
CDG	1,300	1,563.00	2,031,900	
アドウェイズ	13,700	912.00	12,494,400	
バリューコマース	7,500	3,005.00	22,537,500	
インフォマート	114,300	965.00	110,299,500	
サッポロホールディングス	40,500	2,313.00	93,676,500	
アサヒグループホールディングス	259,300	4,796.00	1,243,602,800	
麒麟ホールディングス	503,300	2,134.50	1,074,293,850	
宝ホールディングス	87,900	1,526.00	134,135,400	
オエノンホールディングス	34,200	397.00	13,577,400	
養命酒製造	4,000	1,933.00	7,732,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	90,800	1,889.00	171,521,200	

サントリー食品インターナショナル	79,500	3,715.00	295,342,500
ダイドーグループホールディングス	6,700	5,320.00	35,644,000
伊藤園	36,100	6,060.00	218,766,000
キーコーヒー	11,800	2,160.00	25,488,000
ユニカフェ	3,900	1,000.00	3,900,000
ジャパンフーズ	1,500	1,247.00	1,870,500
日清オイリオグループ	15,300	3,180.00	48,654,000
不二製油グループ本社	29,000	3,025.00	87,725,000
かどや製油	1,000	4,090.00	4,090,000
J-オイルミルズ	5,600	3,845.00	21,532,000
ローソン	29,500	5,080.00	149,860,000
サンエー	8,800	4,200.00	36,960,000
カワチ薬品	8,100	2,892.00	23,425,200
エービーシー・マート	18,100	6,050.00	109,505,000
ハードオフコーポレーション	5,400	830.00	4,482,000
高千穂交易	4,700	1,217.00	5,719,900
アスクル	10,100	3,605.00	36,410,500
ゲオホールディングス	15,600	1,200.00	18,720,000
アダストリア	16,100	2,045.00	32,924,500
ジーフット	7,600	407.00	3,093,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	428.00	856,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,600	1,579.00	2,526,400
伊藤忠食品	2,400	5,220.00	12,528,000
くら寿司	6,900	7,360.00	50,784,000
キャンドゥ	5,600	1,860.00	10,416,000
エレマテック	9,400	967.00	9,089,800
アイケイ	2,500	830.00	2,075,000
パルグループホールディングス	10,200	1,653.00	16,860,600
JALUX	3,300	1,709.00	5,639,700
エディオン	49,300	1,091.00	53,786,300
あらた	9,300	4,555.00	42,361,500
サーラコーポレーション	23,900	587.00	14,029,300
ワッツ	5,200	850.00	4,420,000
トーメンデバイス	1,600	3,975.00	6,360,000
ハローズ	4,400	2,873.00	12,641,200
J Pホールディングス	32,600	286.00	9,323,600
フジオフードグループ本社	9,800	1,371.00	13,435,800
あみやき亭	2,500	2,942.00	7,355,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	3,760.00	14,288,000
ひらまつ	21,900	182.00	3,985,800
フィールズ	10,200	600.00	6,120,000
双日	641,600	290.00	186,064,000
アルフレッサ ホールディングス	120,700	2,150.00	259,505,000
大黒天物産	2,700	5,990.00	16,173,000
ハニーズホールディングス	9,100	1,035.00	9,418,500
ファーマライズホールディングス	3,300	780.00	2,574,000
キッコーマン	85,400	7,330.00	625,982,000
味の素	282,300	2,212.50	624,588,750
ブルドックソース	5,400	2,597.00	14,023,800
キューピー	66,000	2,343.00	154,638,000



ハウス食品グループ本社	44,400	3,650.00	162,060,000
カゴメ	48,500	3,285.00	159,322,500
焼津水産化学工業	4,800	991.00	4,756,800
アリアケジャパン	10,900	6,630.00	72,267,000
ピエトロ	1,200	1,780.00	2,136,000
エバラ食品工業	2,400	2,642.00	6,340,800
やまみ	1,100	2,124.00	2,336,400
ニチレイ	56,500	2,845.00	160,742,500
横浜冷凍	30,800	890.00	27,412,000
東洋水産	61,000	4,615.00	281,515,000
イトアンドホールディングス	4,200	1,825.00	7,665,000
大冷	1,500	1,977.00	2,965,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,700	914.00	6,123,800
日清食品ホールディングス	46,500	8,210.00	381,765,000
永谷園ホールディングス	6,000	2,331.00	13,986,000
一正蒲鉾	4,000	1,182.00	4,728,000
フジッコ	13,000	1,985.00	25,805,000
ロック・フィールド	12,800	1,541.00	19,724,800
日本たばこ産業	636,500	1,948.00	1,239,902,000
ケンコーマヨネーズ	7,300	1,979.00	14,446,700
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,629.00	12,706,200
なとり	6,900	2,008.00	13,855,200
イフジ産業	2,300	931.00	2,141,300
ピックルスコーポレーション	2,800	3,410.00	9,548,000
北の達人コーポレーション	41,400	619.00	25,626,600
ユーグレナ	51,200	924.00	47,308,800
スター・マイカ・ホールディングス	6,100	1,213.00	7,399,300
SREホールディングス	1,300	4,880.00	6,344,000
ADワークスグループ	22,500	160.00	3,600,000
片倉工業	15,600	1,431.00	22,323,600
グンゼ	8,500	3,715.00	31,577,500
ヒューリック	247,200	1,236.00	305,539,200
神栄	1,600	1,389.00	2,222,400
ラサ商事	6,500	911.00	5,921,500
アルペン	8,900	2,287.00	20,354,300
ハブ	3,600	697.00	2,509,200
ラクーンホールディングス	8,200	2,326.00	19,073,200
クオールホールディングス	15,700	1,433.00	22,498,100
アルコニックス	12,300	1,614.00	19,852,200
神戸物産	80,400	2,821.00	226,808,400
ソリトンシステムズ	5,800	1,708.00	9,906,400
ジンズホールディングス	6,200	7,450.00	46,190,000
ビックカメラ	69,000	1,187.00	81,903,000
DCMホールディングス	71,900	1,065.00	76,573,500
ペッパーフードサービス	13,200	298.00	3,933,600
ハイパー	2,000	523.00	1,046,000
MonotaRO	82,800	6,360.00	526,608,000
東京一番フーズ	2,600	593.00	1,541,800
DDホールディングス	5,200	676.00	3,515,200
あいホールディングス	16,700	2,044.00	34,134,800

ディービーエックス	4,000	1,046.00	4,184,000
きちりホールディングス	3,400	617.00	2,097,800
アークランドサービスホールディングス	9,700	2,147.00	20,825,900
J・フロントリテイリング	139,000	1,055.00	146,645,000
ドトール・日レスホールディングス	18,400	1,639.00	30,157,600
マツモトキヨシホールディングス	48,100	4,310.00	207,311,000
ブロンコビリー	6,100	2,312.00	14,103,200
ZOZO	68,700	3,475.00	238,732,500
トレジャー・ファクトリー	3,400	900.00	3,060,000
物語コーポレーション	6,200	6,200.00	38,440,000
ココカラファイン	10,400	7,420.00	77,168,000
三越伊勢丹ホールディングス	203,400	784.00	159,465,600
東洋紡	45,800	1,415.00	64,807,000
ユニチカ	33,800	441.00	14,905,800
富士紡ホールディングス	5,600	4,150.00	23,240,000
日清紡ホールディングス	72,000	831.00	59,832,000
倉敷紡績	10,700	1,896.00	20,287,200
ダイワボウホールディングス	10,600	8,150.00	86,390,000
シキボウ	6,600	1,013.00	6,685,800
日東紡績	17,500	4,115.00	72,012,500
トヨタ紡織	34,500	1,725.00	59,512,500
マクニカ・富士エレホールディングス	27,700	2,084.00	57,726,800
Hamee	2,900	1,628.00	4,721,200
ラクト・ジャパン	5,100	2,615.00	13,336,500
ウエルシアホールディングス	61,500	3,520.00	216,480,000
クリエイトSDホールディングス	17,100	3,325.00	56,857,500
グリムス	2,500	1,700.00	4,250,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,600	786.00	16,191,600
八洲電機	9,200	946.00	8,703,200
メディアスホールディングス	6,800	849.00	5,773,200
レスターホールディングス	12,200	2,058.00	25,107,600
ジュテックホールディングス	2,300	1,085.00	2,495,500
丸善CHIホールディングス	15,400	377.00	5,805,800
大光	4,900	670.00	3,283,000
OCHIホールディングス	3,500	1,351.00	4,728,500
TOKAIホールディングス	56,600	931.00	52,694,600
黒谷	3,300	811.00	2,676,300
ミサワ	2,400	668.00	1,603,200
ティーライフ	1,700	1,234.00	2,097,800
Cominix	1,700	768.00	1,305,600
エー・ピーホールディングス	1,900	490.00	931,000
三洋貿易	11,600	1,074.00	12,458,400
チムニー	3,500	1,440.00	5,040,000
シュッピン	7,900	1,002.00	7,915,800
ビューティガレージ	1,900	2,423.00	4,603,700
オイシックス・ラ・大地	11,500	2,839.00	32,648,500
ウイン・パートナーズ	8,500	1,193.00	10,140,500
ネクステージ	19,900	1,744.00	34,705,600

ジョイフル本田	34,200	1,396.00	47,743,200
鳥貴族ホールディングス	3,300	1,809.00	5,969,700
ホットランド	8,600	1,217.00	10,466,200
すかいらーくホールディングス	130,400	1,687.00	219,984,800
SFPホールディングス	5,700	1,435.00	8,179,500
綿半ホールディングス	8,800	1,239.00	10,903,200
日本毛織	38,100	940.00	35,814,000
ダイトウボウ	19,300	106.00	2,045,800
トーア紡コーポレーション	4,100	485.00	1,988,500
ダイドーリミテッド	16,600	189.00	3,137,400
ヨシックス	2,300	2,244.00	5,161,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,900	1,093.00	37,052,700
三栄建築設計	4,700	1,748.00	8,215,600
野村不動産ホールディングス	70,700	2,488.00	175,901,600
三重交通グループホールディングス	23,700	490.00	11,613,000
サムティ	16,500	1,775.00	29,287,500
ディア・ライフ	16,400	432.00	7,084,800
コーセーアールイー	3,500	584.00	2,044,000
日本商業開発	7,300	1,653.00	12,066,900
プレサンスコーポレーション	19,100	1,520.00	29,032,000
フィル・カンパニー	2,100	2,134.00	4,481,400
THEグローバル社	7,300	265.00	1,934,500
ハウスコム	1,200	1,298.00	1,557,600
日本管理センター	6,200	1,200.00	7,440,000
サンセイランディック	3,500	772.00	2,702,000
エストラスト	1,300	692.00	899,600
フージャースホールディングス	19,000	682.00	12,958,000
オープンハウス	36,700	4,185.00	153,589,500
東急不動産ホールディングス	316,700	699.00	221,373,300
飯田グループホールディングス	97,200	2,492.00	242,222,400
イーグランド	2,300	865.00	1,989,500
ムゲンエステート	7,300	487.00	3,555,100
帝国繊維	13,000	2,217.00	28,821,000
日本コークス工業	100,500	109.00	10,954,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,000	1,183.00	7,098,000
ミタチ産業	3,000	600.00	1,800,000
B E E N O S	5,400	2,355.00	12,717,000
あさひ	8,600	1,475.00	12,685,000
日本調剤	7,100	1,562.00	11,090,200
コスモス薬品	11,800	15,870.00	187,266,000
シップヘルスケアホールディングス	20,600	5,980.00	123,188,000
トーエル	5,700	827.00	4,713,900
ソフトクリエイイトホールディングス	4,500	2,381.00	10,714,500
オンリー	2,600	483.00	1,255,800
セブン&アイ・ホールディングス	455,600	4,168.00	1,898,940,800
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	62,500	842.00	52,625,000
明治電機工業	3,100	1,416.00	4,389,600
ツルハホールディングス	25,400	13,930.00	353,822,000

デリカフーズホールディングス	5,200	629.00	3,270,800	
スターティアホールディングス	2,300	1,069.00	2,458,700	
サンマルクホールディングス	9,100	1,679.00	15,278,900	
フェリシモ	2,600	1,355.00	3,523,000	
トリドールホールディングス	28,800	1,512.00	43,545,600	
帝人	109,000	1,890.00	206,010,000	
東レ	838,400	717.90	601,887,360	
クラレ	182,300	1,248.00	227,510,400	
旭化成	767,500	1,163.00	892,602,500	
サカイオーベックス	3,100	2,851.00	8,838,100	
T O K Y O B A S E	10,400	725.00	7,540,000	
稲葉製作所	6,700	1,397.00	9,359,900	
宮地エンジニアリンググループ	3,800	2,256.00	8,572,800	
トーカロ	30,200	1,357.00	40,981,400	
アルファ	4,500	1,083.00	4,873,500	
S U M C O	149,600	2,574.00	385,070,400	
川田テクノロジーズ	2,400	4,825.00	11,580,000	
R S T e c h n o l o g i e s	3,800	6,170.00	23,446,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,725.00	3,725,000	
信和	6,400	782.00	5,004,800	
ビーロット	5,400	655.00	3,537,000	
ファーストブラザーズ	2,200	971.00	2,136,200	
ハウズドゥ	5,600	1,127.00	6,311,200	
シーアールイー	3,000	1,241.00	3,723,000	
プロパティエージェント	1,900	1,870.00	3,553,000	
ケイアイスター不動産	3,600	3,650.00	13,140,000	
アグレ都市デザイン	2,100	776.00	1,629,600	
グッドコムアセット	5,500	1,528.00	8,404,000	
ジェイ・エス・ビー	2,200	3,385.00	7,447,000	
テンポイノベーション	3,300	966.00	3,187,800	
グローバル・リンク・マネジメント	2,000	861.00	1,722,000	
住江織物	2,100	2,023.00	4,248,300	
日本フェルト	5,500	450.00	2,475,000	
イチカワ	1,300	1,345.00	1,748,500	
エコナックホールディングス	20,700	100.00	2,070,000	
日東製網	1,300	1,575.00	2,047,500	
芦森工業	2,400	1,008.00	2,419,200	
アツギ	9,300	555.00	5,161,500	
ウイルプラスホールディングス	1,900	1,073.00	2,038,700	
J Mホールディングス	8,800	1,979.00	17,415,200	
コメダホールディングス	25,400	1,911.00	48,539,400	
サツドラホールディングス	1,500	2,047.00	3,070,500	
アレンザホールディングス	6,700	1,280.00	8,576,000	
串カツ田中ホールディングス	3,000	2,048.00	6,144,000	
バロックジャパンリミテッド	8,100	772.00	6,253,200	
クスリのアオキホールディングス	11,600	8,530.00	98,948,000	
ダイニック	3,600	810.00	2,916,000	
共和レザー	6,800	662.00	4,501,600	
ピーバンドットコム	1,500	845.00	1,267,500	
力の源ホールディングス	5,400	628.00	3,391,200	

スシローグローバルホールディングス	63,900	4,190.00	267,741,000	
アセンテック	2,900	1,692.00	4,906,800	
セーレン	28,500	1,888.00	53,808,000	
ソトー	4,000	815.00	3,260,000	
東海染工	1,300	1,129.00	1,467,700	
小松マテーレ	19,100	971.00	18,546,100	
ワコールホールディングス	28,900	2,316.00	66,932,400	
ホギメディカル	15,600	3,115.00	48,594,000	
クラウドディアホールディングス	2,400	297.00	712,800	
T S Iホールディングス	34,700	272.00	9,438,400	
マツオカコーポレーション	3,700	1,906.00	7,052,200	
ワールド	15,100	1,391.00	21,004,100	
T I S	116,000	2,239.00	259,724,000	
J N Sホールディングス	5,500	640.00	3,520,000	
電算システム	4,300	3,215.00	13,824,500	
グリー	71,100	579.00	41,166,900	
G M Oペパボ	800	6,650.00	5,320,000	
コーエーテックモホールディングス	23,700	6,190.00	146,703,000	
三菱総合研究所	5,000	4,010.00	20,050,000	
ボルテージ	2,800	549.00	1,537,200	
電算	1,000	2,590.00	2,590,000	
A G S	6,100	833.00	5,081,300	
ファインデックス	9,700	1,171.00	11,358,700	
ブレインパッド	2,900	5,240.00	15,196,000	
K L a b	21,200	878.00	18,613,600	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	15,400	1,135.00	17,479,000	
イーブックイニシアティブジャパン	1,900	2,297.00	4,364,300	
ネクソン	293,100	3,500.00	1,025,850,000	
アイスタイル	35,300	593.00	20,932,900	
エムアップホールディングス	3,000	2,658.00	7,974,000	
エイチーム	8,000	1,215.00	9,720,000	
エニグモ	10,900	1,207.00	13,156,300	
テクノスジャパン	8,900	670.00	5,963,000	
e n i s h	5,900	496.00	2,926,400	
コロブラ	38,000	900.00	34,200,000	
オルトプラス	6,800	433.00	2,944,400	
ブロードリーフ	57,400	505.00	28,987,000	
クロス・マーケティンググループ	5,400	422.00	2,278,800	
デジタルハーツホールディングス	5,300	1,434.00	7,600,200	
システム情報	8,500	1,028.00	8,738,000	
メディアドゥ	4,400	5,730.00	25,212,000	
じげん	28,200	438.00	12,351,600	
ブイキューブ	6,300	2,595.00	16,348,500	
エンカレッジ・テクノロジー	2,200	615.00	1,353,000	
サイバーリンクス	3,800	1,916.00	7,280,800	
ディー・エル・イー	9,200	318.00	2,925,600	
フィックスターズ	12,200	963.00	11,748,600	
C A R T A H O L D I N G S	4,700	1,528.00	7,181,600	
オブティム	8,100	2,943.00	23,838,300	

セレス	3,800	4,080.00	15,504,000
S H I F T	5,200	12,980.00	67,496,000
特種東海製紙	7,200	4,695.00	33,804,000
ティーガイア	12,300	1,870.00	23,001,000
セック	1,700	2,786.00	4,736,200
日本アジアグループ	11,200	1,230.00	13,776,000
テクマトリックス	17,900	1,685.00	30,161,500
プロシップ	3,400	1,334.00	4,535,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	27,900	2,228.00	62,161,200
GMOペイメントゲートウェイ	24,600	14,760.00	363,096,000
ザッパラス	4,600	463.00	2,129,800
システムリサーチ	3,400	1,812.00	6,160,800
インターネットイニシアティブ	30,900	2,260.00	69,834,000
さくらインターネット	12,200	659.00	8,039,800
ヴィンクス	3,200	1,101.00	3,523,200
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,500	7,790.00	19,475,000
S R Aホールディングス	6,200	2,589.00	16,051,800
システムインテグレータ	3,200	649.00	2,076,800
朝日ネット	9,400	807.00	7,585,800
e B A S E	13,800	882.00	12,171,600
アバント	12,400	1,400.00	17,360,000
アドソル日進	4,100	2,678.00	10,979,800
ODKソリューションズ	2,000	782.00	1,564,000
フリービット	6,900	983.00	6,782,700
コムチュア	10,700	2,792.00	29,874,400
サイバーコム	2,100	1,564.00	3,284,400
アステリア	8,300	868.00	7,204,400
アイル	6,500	1,602.00	10,413,000
王子ホールディングス	521,300	709.00	369,601,700
日本製紙	51,100	1,438.00	73,481,800
三菱製紙	17,100	361.00	6,173,100
北越コーポレーション	82,900	517.00	42,859,300
中越パルプ工業	4,700	1,224.00	5,752,800
巴川製紙所	3,700	794.00	2,937,800
大王製紙	56,000	2,113.00	118,328,000
阿波製紙	3,000	450.00	1,350,000
マークラインズ	4,800	2,318.00	11,126,400
メディカル・データ・ビジョン	13,200	2,082.00	27,482,400
g u m i	16,000	920.00	14,720,000
ショーケース	2,400	953.00	2,287,200
モバイルファクトリー	2,400	1,022.00	2,452,800
テラスカイ	3,700	3,695.00	13,671,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,100	1,730.00	8,823,000
P C Iホールディングス	4,400	1,277.00	5,618,800
パイプドHD	2,400	1,477.00	3,544,800
アイピーシー	1,900	1,016.00	1,930,400
ネオジャパン	2,200	1,747.00	3,843,400

PR TIMES	2,400	3,270.00	7,848,000	
ランドコンピュータ	1,500	1,120.00	1,680,000	
ダブルスタンダード	1,500	4,075.00	6,112,500	
オープンドア	6,900	2,512.00	17,332,800	
マイネット	3,800	749.00	2,846,200	
アカツキ	4,600	4,230.00	19,458,000	
ベネフィットジャパン	900	1,728.00	1,555,200	
Ubicomホールディングス	3,000	3,130.00	9,390,000	
カナミックネットワーク	10,600	767.00	8,130,200	
ノムラシステムコーポレーション	5,100	318.00	1,621,800	
レンゴー	119,400	875.00	104,475,000	
トーモク	7,200	1,820.00	13,104,000	
ザ・バック	8,700	2,661.00	23,150,700	
チェンジ	16,200	3,195.00	51,759,000	
シンクロ・フード	6,900	361.00	2,490,900	
オークネット	6,100	1,340.00	8,174,000	
キャピタル・アセット・プランニング	1,500	1,014.00	1,521,000	
セグエグループ	2,900	1,175.00	3,407,500	
エイトレッド	2,200	2,261.00	4,974,200	
AOI TYO HOLDINGS	12,000	524.00	6,288,000	
マクロミル	23,600	902.00	21,287,200	
ピーグリー	2,300	1,426.00	3,279,800	
オロ	3,600	3,560.00	12,816,000	
ユーザーローカル	1,800	4,520.00	8,136,000	
テモナ	2,500	875.00	2,187,500	
ニーズウェル	2,200	664.00	1,460,800	
サインポスト	2,600	997.00	2,592,200	
昭和電工	87,900	2,632.00	231,352,800	
住友化学	911,200	538.00	490,225,600	
住友精化	5,700	3,975.00	22,657,500	
日産化学	63,900	6,280.00	401,292,000	
ラサ工業	3,800	2,169.00	8,242,200	
クレハ	9,900	7,080.00	70,092,000	
多木化学	4,500	6,210.00	27,945,000	
テイカ	8,400	1,418.00	11,911,200	
石原産業	20,600	841.00	17,324,600	
片倉コープアグリ	2,400	1,300.00	3,120,000	
日本曹達	16,200	3,455.00	55,971,000	
東ソー	178,900	2,048.00	366,387,200	
トクヤマ	34,300	2,765.00	94,839,500	
セントラル硝子	22,000	2,278.00	50,116,000	
東亜合成	70,700	1,226.00	86,678,200	
大阪ソーダ	11,900	2,575.00	30,642,500	
関東電化工業	27,300	884.00	24,133,200	
デンカ	42,200	4,115.00	173,653,000	
イビデン	56,800	4,555.00	258,724,000	
信越化学工業	214,100	18,125.00	3,880,562,500	
日本カーバイド工業	4,200	1,333.00	5,598,600	
堺化学工業	8,100	1,968.00	15,940,800	
第一稀元素化学工業	11,700	1,019.00	11,922,300	

エア・ウォーター	118,100	1,796.00	212,107,600
日本酸素ホールディングス	95,300	2,080.00	198,224,000
日本化学工業	3,200	3,275.00	10,480,000
東邦アセチレン	1,900	1,350.00	2,565,000
日本パーカライズン	58,400	1,095.00	63,948,000
高圧ガス工業	18,500	733.00	13,560,500
チタン工業	1,500	2,166.00	3,249,000
四国化成工業	15,500	1,230.00	19,065,000
戸田工業	2,400	2,196.00	5,270,400
ステラ ケミファ	6,300	3,280.00	20,664,000
保土谷化学工業	3,400	4,810.00	16,354,000
日本触媒	21,000	5,810.00	122,010,000
大日精化工業	9,600	2,384.00	22,886,400
カネカ	30,000	4,325.00	129,750,000
協和キリン	119,000	3,035.00	361,165,000
三菱瓦斯化学	116,000	2,565.00	297,540,000
三井化学	100,000	3,440.00	344,000,000
J S R	116,200	3,260.00	378,812,000
東京応化工業	19,900	6,470.00	128,753,000
大阪有機化学工業	10,700	3,510.00	37,557,000
三菱ケミカルホールディングス	774,100	773.10	598,456,710
K Hネオケム	19,100	2,476.00	47,291,600
ダイセル	155,500	795.00	123,622,500
住友ベークライト	18,200	4,410.00	80,262,000
積水化学工業	244,900	1,982.00	485,391,800
日本ゼオン	104,500	1,616.00	168,872,000
アイカ工業	32,200	3,810.00	122,682,000
宇部興産	58,400	2,190.00	127,896,000
積水樹脂	19,100	2,011.00	38,410,100
タキロンシーアイ	25,200	682.00	17,186,400
旭有機材	6,600	1,479.00	9,761,400
ニチバン	6,200	1,834.00	11,370,800
リケンテクノス	28,200	486.00	13,705,200
大倉工業	5,500	1,925.00	10,587,500
積水化成成品工業	15,600	564.00	8,798,400
群栄化学工業	2,200	2,537.00	5,581,400
タイガースポリマー	6,700	468.00	3,135,600
ミライアル	3,700	1,230.00	4,551,000
ダイキアクシス	4,300	984.00	4,231,200
ダイキョーニシカワ	24,500	762.00	18,669,000
竹本容器	4,200	840.00	3,528,000
森六ホールディングス	6,300	2,035.00	12,820,500
恵和	1,700	1,944.00	3,304,800
日本化薬	71,600	1,067.00	76,397,200
カーリットホールディングス	11,500	719.00	8,268,500
E P Sホールディングス	15,300	1,163.00	17,793,900
ソルクシーズ	4,400	1,016.00	4,470,400
レグス	2,700	1,653.00	4,463,100
プレステージ・インターナショナル	42,200	771.00	32,536,200
フェイス	3,600	783.00	2,818,800



プロトコーポレーション	10,400	1,166.00	12,126,400
アミューズ	6,200	2,672.00	16,566,400
野村総合研究所	211,800	3,430.00	726,474,000
ドリームインキュベータ	3,500	1,200.00	4,200,000
サイバネットシステム	8,200	824.00	6,756,800
クイック	7,000	1,182.00	8,274,000
T A C	6,300	281.00	1,770,300
C Eホールディングス	6,200	532.00	3,298,400
ケネディクス	32,300	747.00	24,128,100
日本システム技術	2,100	1,513.00	3,177,300
電通グループ	127,000	3,905.00	495,935,000
インテージホールディングス	14,400	1,145.00	16,488,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,200	884.00	4,596,800
東邦システムサイエンス	3,000	925.00	2,775,000
ぴあ	3,200	3,390.00	10,848,000
イオンファンタジー	4,300	2,538.00	10,913,400
ソースネクスト	54,700	363.00	19,856,100
シーティーエス	12,600	855.00	10,773,000
ネクシィーズグループ	3,500	1,089.00	3,811,500
インフォコム	10,600	2,715.00	28,779,000
メディカルシステムネットワーク	10,200	720.00	7,344,000
日本精化	8,400	1,423.00	11,953,200
扶桑化学工業	9,100	3,950.00	35,945,000
トリケミカル研究所	9,800	3,905.00	38,269,000
HEROZ	3,200	3,275.00	10,480,000
ラクスル	9,400	3,730.00	35,062,000
I P S	2,100	3,020.00	6,342,000
F I G	12,600	263.00	3,313,800
システムサポート	3,400	1,420.00	4,828,000
A D E K A	53,300	1,846.00	98,391,800
日油	43,600	5,680.00	247,648,000
ミヨシ油脂	4,400	1,204.00	5,297,600
新日本理化	19,000	272.00	5,168,000
ハリマ化成グループ	8,700	933.00	8,117,100
イーソル	6,200	1,388.00	8,605,600
アルテリア・ネットワークス	12,800	1,568.00	20,070,400
E D U L A B	1,100	7,160.00	7,876,000
東海ソフト	1,400	1,146.00	1,604,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,000	2,050.00	4,100,000
東名	600	1,134.00	680,400
ヴィッツ	400	2,260.00	904,000
トピラシステムズ	1,100	1,612.00	1,773,200
S a n s a n	7,700	9,780.00	75,306,000
L i n k - U	700	1,433.00	1,003,100
ギフティ	5,200	4,430.00	23,036,000
花王	283,100	7,137.00	2,020,484,700
第一工業製薬	3,900	3,700.00	14,430,000
石原ケミカル	3,000	2,195.00	6,585,000
日華化学	4,300	887.00	3,814,100

ニイタカ	2,400	2,578.00	6,187,200	
三洋化成工業	6,900	5,130.00	35,397,000	
ベース	1,000	5,600.00	5,600,000	
武田薬品工業	983,700	3,610.00	3,551,157,000	
アステラス製薬	1,025,100	1,772.50	1,816,989,750	
大日本住友製薬	87,600	1,763.00	154,438,800	
塩野義製薬	148,700	5,722.00	850,861,400	
わかもと製薬	14,300	243.00	3,474,900	
あすか製薬	13,400	1,349.00	18,076,600	
日本新薬	33,500	7,560.00	253,260,000	
ピオフェルミン製薬	2,200	2,557.00	5,625,400	
中外製薬	369,800	4,994.00	1,846,781,200	
科研製薬	20,200	4,210.00	85,042,000	
エーザイ	130,600	7,597.00	992,168,200	
理研ビタミン	11,200	1,357.00	15,198,400	
ロート製薬	56,300	2,904.00	163,495,200	
小野薬品工業	271,500	2,977.50	808,391,250	
久光製薬	34,400	6,780.00	233,232,000	
有機合成薬品工業	9,200	293.00	2,695,600	
持田製薬	16,400	4,070.00	66,748,000	
参天製薬	205,700	1,521.00	312,869,700	
扶桑薬品工業	3,800	2,551.00	9,693,800	
日本ケミファ	1,200	2,253.00	2,703,600	
ツムラ	39,500	3,395.00	134,102,500	
日医工	33,400	1,030.00	34,402,000	
テルモ	362,500	4,115.00	1,491,687,500	
H.U.グループホールディングス	31,700	3,300.00	104,610,000	
キッセイ薬品工業	20,900	2,214.00	46,272,600	
生化学工業	20,900	1,030.00	21,527,000	
栄研化学	20,800	2,101.00	43,700,800	
日水製薬	4,600	980.00	4,508,000	
鳥居薬品	7,400	3,095.00	22,903,000	
JCRファーマ	33,300	3,520.00	117,216,000	
東和薬品	17,100	2,145.00	36,679,500	
富士製薬工業	8,100	1,240.00	10,044,000	
沢井製薬	25,900	4,895.00	126,780,500	
ゼリア新薬工業	21,500	2,022.00	43,473,000	
第一三共	1,015,000	3,179.00	3,226,685,000	
キョーリン製薬ホールディングス	26,100	1,912.00	49,903,200	
大幸薬品	14,500	1,319.00	19,125,500	
ダイト	7,500	3,485.00	26,137,500	
大塚ホールディングス	245,800	4,385.00	1,077,833,000	
大正製薬ホールディングス	28,100	6,740.00	189,394,000	
ペプチドリーム	60,100	5,210.00	313,121,000	
大日本塗料	13,200	911.00	12,025,200	
日本ペイントホールディングス	95,500	8,180.00	781,190,000	
関西ペイント	130,100	2,856.00	371,565,600	
神東塗料	9,300	199.00	1,850,700	
中国塗料	27,900	927.00	25,863,300	
日本特殊塗料	8,700	1,110.00	9,657,000	

藤倉化成	16,000	536.00	8,576,000
太陽ホールディングス	8,500	5,710.00	48,535,000
D I C	48,900	2,731.00	133,545,900
サカタインクス	25,300	1,093.00	27,652,900
東洋インキSCホールディングス	24,500	1,976.00	48,412,000
T & K T O K A	9,400	814.00	7,651,600
アルプス技研	10,000	2,017.00	20,170,000
サニックス	17,700	291.00	5,150,700
ダイオーズ	2,200	962.00	2,116,400
日本空調サービス	12,200	728.00	8,881,600
オリエンタルランド	120,100	18,285.00	2,196,028,500
フォーカスシステムズ	7,700	933.00	7,184,100
ダスキン	26,200	2,768.00	72,521,600
パーク24	62,500	2,277.00	142,312,500
明光ネットワークジャパン	14,200	560.00	7,952,000
ファルコホールディングス	5,400	1,588.00	8,575,200
クレスコ	7,900	1,462.00	11,549,800
フジ・メディア・ホールディングス	120,100	1,348.00	161,894,800
秀英予備校	2,800	429.00	1,201,200
田谷	1,700	567.00	963,900
ラウンドワン	38,500	1,180.00	45,430,000
リゾートトラスト	51,700	1,811.00	93,628,700
オービック	36,600	18,510.00	677,466,000
ジャストシステム	16,500	6,490.00	107,085,000
T D C ソフト	10,200	923.00	9,414,600
Zホールディングス	1,593,800	662.40	1,055,733,120
ビー・エム・エル	14,600	3,570.00	52,122,000
ワタベウェディング	1,700	380.00	646,000
トレンドマイクロ	61,900	5,290.00	327,451,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,387.00	23,717,700
I Dホールディングス	4,500	1,242.00	5,589,000
リソー教育	57,300	325.00	18,622,500
日本オラクル	23,500	11,280.00	265,080,000
早稲田アカデミー	4,400	995.00	4,378,000
アルファシステムズ	3,100	3,600.00	11,160,000
フューチャー	14,000	1,818.00	25,452,000
C A C H o l d i n g s	7,500	1,407.00	10,552,500
S Bテクノロジー	4,200	2,991.00	12,562,200
トーセ	3,300	822.00	2,712,600
ユー・エス・エス	126,400	2,089.00	264,049,600
オービックビジネスコンサルタント	11,900	6,170.00	73,423,000
伊藤忠テクノソリューションズ	52,900	3,300.00	174,570,000
アイティフォー	15,100	845.00	12,759,500
東京個別指導学院	9,900	643.00	6,365,700
東計電算	1,800	4,155.00	7,479,000
サイバーエージェント	69,600	6,750.00	469,800,000
楽天	526,600	1,210.00	637,186,000
エクスネット	2,200	996.00	2,191,200
クリーク・アンド・リバー社	5,800	1,284.00	7,447,200
モーニングスター	12,400	483.00	5,989,200

テー・オー・ダブリュー	19,800	309.00	6,118,200
大塚商会	62,800	4,975.00	312,430,000
サイボウズ	13,500	2,386.00	32,211,000
山田コンサルティンググループ	6,600	1,001.00	6,606,600
セントラルスポーツ	4,200	2,486.00	10,441,200
パラカ	3,100	1,616.00	5,009,600
電通国際情報サービス	14,400	3,780.00	54,432,000
A C C E S S	10,800	846.00	9,136,800
デジタルガレージ	19,100	4,200.00	80,220,000
イーエムシステムズ	19,200	850.00	16,320,000
ウェザーニューズ	3,400	5,150.00	17,510,000
C I J	7,900	852.00	6,730,800
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,355.00	4,026,000
日本エンタープライズ	11,600	264.00	3,062,400
WOWOW	5,700	2,822.00	16,085,400
スカラ	10,300	727.00	7,488,100
インテリジェント ウェイブ	6,900	671.00	4,629,900
フルキャストホールディングス	9,800	1,943.00	19,041,400
エン・ジャパン	20,100	3,275.00	65,827,500
富士フイルムホールディングス	207,800	6,320.00	1,313,296,000
コニカミノルタ	239,400	567.00	135,739,800
資生堂	235,000	8,148.00	1,914,780,000
ライオン	153,700	2,078.00	319,388,600
高砂香料工業	7,400	2,622.00	19,402,800
マンダム	24,700	1,889.00	46,658,300
ミルボン	15,800	6,160.00	97,328,000
ファンケル	43,000	3,915.00	168,345,000
コーセー	22,200	17,990.00	399,378,000
コタ	7,000	1,756.00	12,292,000
シーボン	1,300	1,995.00	2,593,500
ポーラ・オルビスホールディングス	50,500	2,504.00	126,452,000
ノエビアホールディングス	10,000	4,860.00	48,600,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	1,128.00	3,384,000
新日本製薬	2,400	2,343.00	5,623,200
エステー	7,700	1,896.00	14,599,200
アグロ カネショウ	4,500	1,581.00	7,114,500
コニシ	19,500	1,664.00	32,448,000
長谷川香料	20,500	1,923.00	39,421,500
星光P M C	6,900	766.00	5,285,400
小林製薬	33,100	10,360.00	342,916,000
荒川化学工業	9,900	1,263.00	12,503,700
メック	8,100	2,127.00	17,228,700
日本高純度化学	3,300	2,752.00	9,081,600
タカラバイオ	31,000	2,969.00	92,039,000
J C U	13,300	3,460.00	46,018,000
新田ゼラチン	7,700	681.00	5,243,700
O A T アグリオ	2,300	1,359.00	3,125,700
デクセリアルズ	33,000	1,542.00	50,886,000
アース製薬	8,900	5,990.00	53,311,000
北興化学工業	10,900	1,019.00	11,107,100

大成ラミック	3,700	2,869.00	10,615,300
クミアイ化学工業	48,800	861.00	42,016,800
日本農薬	21,200	530.00	11,236,000
富士興産	3,500	1,261.00	4,413,500
ニチレキ	14,000	1,527.00	21,378,000
ユシロ化学工業	6,800	1,080.00	7,344,000
ピーピー・カストロール	4,300	1,234.00	5,306,200
富士石油	28,800	212.00	6,105,600
MORESCO	4,500	1,168.00	5,256,000
出光興産	131,200	2,775.00	364,080,000
ENEOSホールディングス	1,778,300	472.80	840,780,240
コスモエネルギーホールディングス	37,300	2,602.00	97,054,600
横浜ゴム	68,400	1,910.00	130,644,000
TOYO TIRE	62,200	1,902.00	118,304,400
ブリヂストン	314,400	4,314.00	1,356,321,600
住友ゴム工業	106,000	1,210.00	128,260,000
藤倉コンポジット	10,800	455.00	4,914,000
オカモト	7,300	4,060.00	29,638,000
アキレス	8,200	1,465.00	12,013,000
フコク	4,400	692.00	3,044,800
ニッタ	12,200	2,383.00	29,072,600
クリエートメディック	4,200	980.00	4,116,000
住友理工	22,800	638.00	14,546,400
三ツ星ベルト	14,400	1,693.00	24,379,200
バンドー化学	20,900	737.00	15,403,300
AGC	108,600	4,105.00	445,803,000
日本板硝子	59,800	559.00	33,428,200
石塚硝子	2,100	1,940.00	4,074,000
有沢製作所	16,500	1,006.00	16,599,000
日本山村硝子	5,300	929.00	4,923,700
日本電気硝子	43,800	2,482.00	108,711,600
オハラ	4,700	2,066.00	9,710,200
住友大阪セメント	21,300	3,655.00	77,851,500
太平洋セメント	70,000	2,820.00	197,400,000
リソルホールディングス	900	4,185.00	3,766,500
日本ヒューム	11,000	771.00	8,481,000
日本コンクリート工業	25,400	437.00	11,099,800
三谷セキサン	5,500	4,665.00	25,657,500
アジアパイルホールディングス	18,500	535.00	9,897,500
東海カーボン	115,500	1,513.00	174,751,500
日本カーボン	6,500	3,990.00	25,935,000
東洋炭素	7,000	1,946.00	13,622,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,600	3,680.00	24,288,000
TOTO	84,500	6,690.00	565,305,000
日本碍子	130,000	1,943.00	252,590,000
日本特殊陶業	90,000	1,867.00	168,030,000
ダントーホールディングス	8,600	370.00	3,182,000
MARUWA	4,100	10,480.00	42,968,000
品川リフラクトリーズ	2,800	2,703.00	7,568,400
黒崎播磨	2,000	4,805.00	9,610,000

ヨータイ	8,600	1,040.00	8,944,000	
イソライト工業	5,300	652.00	3,455,600	
東京窯業	15,700	318.00	4,992,600	
ニッカトー	5,400	695.00	3,753,000	
フジインコーポレーテッド	9,500	4,050.00	38,475,000	
クニミネ工業	3,800	1,214.00	4,613,200	
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,066.00	2,558,400	
ニチアス	29,900	2,504.00	74,869,600	
日本製鉄	558,100	1,606.00	896,308,600	
神戸製鋼所	213,700	671.00	143,392,700	
中山製鋼所	17,100	395.00	6,754,500	
合同製鐵	6,300	2,069.00	13,034,700	
ジェイ エフ イー ホールディングス	338,200	1,152.00	389,606,400	
東京製鐵	45,600	716.00	32,649,600	
共英製鋼	13,100	1,466.00	19,204,600	
大和工業	24,900	2,761.00	68,748,900	
東京鐵鋼	4,500	1,947.00	8,761,500	
大阪製鐵	6,300	1,274.00	8,026,200	
淀川製鋼所	15,900	2,230.00	35,457,000	
丸一鋼管	37,900	2,483.00	94,105,700	
モリ工業	3,500	2,285.00	7,997,500	
大同特殊鋼	19,100	4,540.00	86,714,000	
日本高周波鋼業	4,000	360.00	1,440,000	
日本冶金工業	9,100	2,135.00	19,428,500	
山陽特殊製鋼	14,000	1,787.00	25,018,000	
愛知製鋼	6,600	3,220.00	21,252,000	
日立金属	110,300	1,714.00	189,054,200	
日本金属	2,900	1,083.00	3,140,700	
大平洋金属	7,800	2,523.00	19,679,400	
新日本電工	75,300	291.00	21,912,300	
栗本鐵工所	5,400	1,740.00	9,396,000	
虹 技	1,300	1,170.00	1,521,000	
日本鑄鉄管	1,400	1,367.00	1,913,800	
日本製鋼所	35,500	2,812.00	99,826,000	
三菱製鋼	8,800	807.00	7,101,600	
日亜鋼業	17,800	291.00	5,179,800	
日本精線	1,700	3,665.00	6,230,500	
エンビプロ・ホールディングス	5,100	744.00	3,794,400	
大紀アルミニウム工業所	17,700	799.00	14,142,300	
日本軽金属ホールディングス	31,900	2,169.00	69,191,100	
三井金属鉱業	31,600	3,795.00	119,922,000	
東邦亜鉛	6,500	2,379.00	15,463,500	
三菱マテリアル	77,200	2,599.00	200,642,800	
住友金属鉱山	149,400	5,455.00	814,977,000	
DOWAホールディングス	29,600	4,320.00	127,872,000	
古河機械金属	19,300	1,355.00	26,151,500	
エス・サイエンス	54,700	46.00	2,516,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,000	827.00	9,924,000	
東邦チタニウム	20,900	957.00	20,001,300	

UACJ	17,700	2,514.00	44,497,800
CKサンエツ	2,100	3,930.00	8,253,000
古河電気工業	36,400	2,830.00	103,012,000
住友電気工業	407,900	1,558.00	635,508,200
フジクラ	141,100	529.00	74,641,900
昭和電線ホールディングス	11,300	1,702.00	19,232,600
東京特殊電線	1,500	2,610.00	3,915,000
タツタ電線	20,600	638.00	13,142,800
カナレ電気	2,200	1,733.00	3,812,600
平河ヒューテック	6,500	1,174.00	7,631,000
リョービ	14,200	1,306.00	18,545,200
アーレスティ	14,600	402.00	5,869,200
アサヒホールディングス	21,900	4,330.00	94,827,000
東洋製罐グループホールディングス	74,500	1,386.00	103,257,000
ホッカフホールディングス	6,000	1,438.00	8,628,000
コロナ	6,800	946.00	6,432,800
横河ブリッジホールディングス	20,100	1,949.00	39,174,900
OSJBホールディングス	54,100	276.00	14,931,600
駒井ハルテック	2,400	2,066.00	4,958,400
高田機工	800	2,622.00	2,097,600
三和ホールディングス	110,200	1,349.00	148,659,800
文化シャッター	34,600	1,000.00	34,600,000
三協立山	15,000	831.00	12,465,000
アルインコ	7,800	973.00	7,589,400
東洋シャッター	2,400	717.00	1,720,800
LIXIL	161,000	3,020.00	486,220,000
日本フィルコン	8,500	496.00	4,216,000
ノーリツ	24,300	1,632.00	39,657,600
長府製作所	12,000	2,059.00	24,708,000
リンナイ	22,700	10,940.00	248,338,000
ユニプレス	19,300	958.00	18,489,400
ダイニチ工業	5,700	824.00	4,696,800
日東精工	15,100	664.00	10,026,400
三洋工業	1,300	1,848.00	2,402,400
岡部	24,100	779.00	18,773,900
ジーテクト	14,600	1,446.00	21,111,600
東プレ	21,900	1,572.00	34,426,800
高周波熱錬	22,300	534.00	11,908,200
東京製綱	8,200	1,418.00	11,627,600
サンコール	10,300	477.00	4,913,100
モリテックスチール	9,000	412.00	3,708,000
パイオラックス	17,300	1,566.00	27,091,800
エイチワン	11,600	762.00	8,839,200
日本発条	116,400	818.00	95,215,200
中央発條	1,000	2,845.00	2,845,000
アドバネクス	1,600	1,656.00	2,649,600
三浦工業	50,600	5,740.00	290,444,000
タクマ	39,600	2,118.00	83,872,800
テクノプロ・ホールディングス	22,500	8,000.00	180,000,000
アトラ	2,500	392.00	980,000

インターワークス	3,500	385.00	1,347,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,600	13,250.00	60,950,000	
Keeper 技研	7,300	1,948.00	14,220,400	
ファーストロジック	2,200	767.00	1,687,400	
三機サービス	2,300	1,008.00	2,318,400	
Gunosy	6,800	779.00	5,297,200	
デザインワン・ジャパン	3,500	226.00	791,000	
イー・ガーディアン	4,900	3,045.00	14,920,500	
リブセンス	6,200	234.00	1,450,800	
ジャパンマテリアル	34,800	1,407.00	48,963,600	
ベクトル	14,000	1,186.00	16,604,000	
ウチヤマホールディングス	5,800	365.00	2,117,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	8,400	1,400.00	11,760,000	
キャリアリンク	3,600	2,620.00	9,432,000	
I B J	9,100	1,109.00	10,091,900	
アサンテ	4,100	1,770.00	7,257,000	
N・フィールド	7,600	1,197.00	9,097,200	
バリューHR	4,500	1,948.00	8,766,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	9,300	4,765.00	44,314,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,300	1,685.00	7,245,500	
E R Iホールディングス	2,800	614.00	1,719,200	
アピスト	1,800	2,940.00	5,292,000	
シグマクシス	6,200	1,679.00	10,409,800	
ウィルグループ	8,200	970.00	7,954,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,600	313.00	5,195,800	
メドピア	5,300	6,120.00	32,436,000	
レアジョブ	1,600	1,998.00	3,196,800	
リクルートホールディングス	809,300	5,515.00	4,463,289,500	
エラン	15,600	1,356.00	21,153,600	
ツガミ	24,200	1,577.00	38,163,400	
オークマ	13,600	6,010.00	81,736,000	
芝浦機械	12,200	2,868.00	34,989,600	
アマダ	171,200	1,335.00	228,552,000	
アイダエンジニアリング	30,700	939.00	28,827,300	
滝澤鉄工所	3,900	1,065.00	4,153,500	
F U J I	46,600	2,580.00	120,228,000	
牧野フライス製作所	13,700	4,075.00	55,827,500	
オーエスジー	57,600	1,958.00	112,780,800	
ダイジェット工業	1,000	1,394.00	1,394,000	
旭ダイヤモンド工業	31,000	511.00	15,841,000	
D M G 森精機	73,900	1,634.00	120,752,600	
ソディック	25,600	992.00	25,395,200	
ディスコ	15,900	34,850.00	554,115,000	
日東工器	5,700	1,777.00	10,128,900	
日進工具	4,600	2,692.00	12,383,200	
パンチ工業	9,900	550.00	5,445,000	
富士ダイス	6,400	655.00	4,192,000	
土木管理総合試験所	5,700	351.00	2,000,700	



ネットマーケティング	5,400	609.00	3,288,600	
日本郵政	855,300	919.90	786,790,470	
ベルシステム24ホールディングス	18,900	1,805.00	34,114,500	
鎌倉新書	11,400	910.00	10,374,000	
S MN	2,400	753.00	1,807,200	
一蔵	1,700	408.00	693,600	
L I T A L I C O	4,600	4,075.00	18,745,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,100	874.00	1,835,400	
エアトリ	6,100	2,250.00	13,725,000	
アトラエ	3,400	3,215.00	10,931,000	
ストライク	4,200	4,525.00	19,005,000	
ソラスト	27,700	1,449.00	40,137,300	
セラク	3,500	1,718.00	6,013,000	
インソース	9,400	2,110.00	19,834,000	
豊田自動織機	95,700	9,460.00	905,322,000	
豊和工業	6,500	833.00	5,414,500	
O K K	4,800	474.00	2,275,200	
石川製作所	3,000	1,674.00	5,022,000	
東洋機械金属	8,400	444.00	3,729,600	
津田駒工業	2,400	892.00	2,140,800	
エンシュウ	2,400	903.00	2,167,200	
島精機製作所	17,100	2,361.00	40,373,100	
オプトラン	14,600	2,562.00	37,405,200	
N Cホールディングス	3,100	660.00	2,046,000	
イワキ	7,600	822.00	6,247,200	
フリー	11,500	1,120.00	12,880,000	
ヤマシンフィルタ	23,500	860.00	20,210,000	
日阪製作所	14,800	852.00	12,609,600	
やまびこ	22,600	1,160.00	26,216,000	
平田機工	5,500	6,700.00	36,850,000	
ペガサスミシン製造	12,200	491.00	5,990,200	
マルマエ	4,300	1,265.00	5,439,500	
タツモ	4,900	1,504.00	7,369,600	
ナブテスコ	68,900	4,620.00	318,318,000	
三井海洋開発	12,400	1,790.00	22,196,000	
レオン自動機	11,400	1,121.00	12,779,400	
S M C	34,600	65,880.00	2,279,448,000	
ホソカワミクロン	4,100	6,390.00	26,199,000	
ユニオンツール	4,400	3,455.00	15,202,000	
オイレス工業	16,500	1,671.00	27,571,500	
日精エー・エス・ビー機械	3,400	5,500.00	18,700,000	
サトーホールディングス	15,400	2,574.00	39,639,600	
技研製作所	10,300	5,200.00	53,560,000	
日本エアテック	3,800	1,215.00	4,617,000	
カワタ	3,200	896.00	2,867,200	
日精樹脂工業	9,200	916.00	8,427,200	
オカダアイオン	3,800	1,250.00	4,750,000	
ワイエイシーホールディングス	4,600	961.00	4,420,600	
小松製作所	535,700	3,309.00	1,772,631,300	
住友重機械工業	67,600	2,976.00	201,177,600	

日立建機	55,300	3,445.00	190,508,500
日工	17,600	722.00	12,707,200
巴工業	4,800	2,042.00	9,801,600
井関農機	11,800	1,577.00	18,608,600
TOWA	11,000	2,074.00	22,814,000
丸山製作所	2,400	1,675.00	4,020,000
北川鉄工所	5,500	1,506.00	8,283,000
シンニッタン	14,500	223.00	3,233,500
ローツェ	5,200	7,570.00	39,364,000
タカキタ	4,300	660.00	2,838,000
クボタ	621,200	2,521.00	1,566,045,200
荏原実業	2,900	4,525.00	13,122,500
東洋エンジニアリング	15,400	563.00	8,670,200
三菱化工機	3,700	2,906.00	10,752,200
月島機械	21,800	1,284.00	27,991,200
帝国電機製作所	8,300	1,198.00	9,943,400
東京機械製作所	4,300	308.00	1,324,400
新東工業	28,200	751.00	21,178,200
澁谷工業	10,400	3,350.00	34,840,000
アイチコーポレーション	20,500	877.00	17,978,500
小森コーポレーション	30,100	742.00	22,334,200
鶴見製作所	9,200	1,749.00	16,090,800
住友精密工業	1,900	2,063.00	3,919,700
日本ギア工業	6,000	306.00	1,836,000
酒井重工業	1,900	2,092.00	3,974,800
荏原製作所	49,000	4,195.00	205,555,000
石井鐵工所	1,200	2,922.00	3,506,400
西島製作所	12,200	835.00	10,187,000
北越工業	12,400	1,111.00	13,776,400
ダイキン工業	150,600	21,730.00	3,272,538,000
オルガノ	3,800	6,120.00	23,256,000
トーヨーカネツ	4,400	2,700.00	11,880,000
栗田工業	64,000	4,370.00	279,680,000
椿本チエイン	16,900	3,040.00	51,376,000
大同工業	4,600	777.00	3,574,200
日機装	38,200	1,113.00	42,516,600
木村化工機	9,800	664.00	6,507,200
レイズネクスト	20,000	1,177.00	23,540,000
アネスト岩田	20,000	1,050.00	21,000,000
ダイフク	65,100	10,330.00	672,483,000
サムコ	2,900	3,465.00	10,048,500
加藤製作所	6,400	1,033.00	6,611,200
油研工業	1,700	1,659.00	2,820,300
タダノ	57,000	1,032.00	58,824,000
フジテック	40,800	2,595.00	105,876,000
CKD	27,400	2,391.00	65,513,400
キトー	10,000	1,457.00	14,570,000
平和	32,900	1,625.00	53,462,500
理想科学工業	9,200	1,327.00	12,208,400
SANKYO	28,000	3,005.00	84,140,000

日本金銭機械	13,200	553.00	7,299,600	
マースグループホールディングス	7,600	1,578.00	11,992,800	
フクシマガリレイ	8,100	4,050.00	32,805,000	
オーイズミ	5,100	409.00	2,085,900	
ダイコク電機	5,600	961.00	5,381,600	
竹内製作所	19,700	2,830.00	55,751,000	
アマノ	31,000	2,426.00	75,206,000	
JUKI	16,500	876.00	14,454,000	
サンデンホールディングス	16,500	470.00	7,755,000	
蛇の目マシン工業	10,600	784.00	8,310,400	
ブラザー工業	144,300	2,158.00	311,399,400	
マックス	16,300	1,609.00	26,226,700	
モリタホールディングス	19,000	1,796.00	34,124,000	
グローリー	30,400	2,374.00	72,169,600	
新晃工業	11,000	1,900.00	20,900,000	
大和冷機工業	19,000	1,068.00	20,292,000	
セガサミーホールディングス	107,500	1,826.00	196,295,000	
日本ピストンリング	4,500	1,081.00	4,864,500	
リケン	5,500	2,328.00	12,804,000	
T P R	16,000	1,531.00	24,496,000	
ツバキ・ナカシマ	22,500	1,365.00	30,712,500	
ホシザキ	37,200	9,450.00	351,540,000	
大豊工業	9,800	769.00	7,536,200	
日本精工	242,600	1,090.00	264,434,000	
NTN	272,600	324.00	88,322,400	
ジェイテクト	113,300	1,182.00	133,920,600	
不二越	11,000	4,685.00	51,535,000	
ミネベアミツミ	203,700	2,695.00	548,971,500	
日本トムソン	32,200	553.00	17,806,600	
T H K	73,700	3,595.00	264,951,500	
ユーシン精機	7,900	936.00	7,394,400	
前澤給装工業	4,200	2,260.00	9,492,000	
イーグル工業	14,700	1,131.00	16,625,700	
前澤工業	7,300	564.00	4,117,200	
日本ピラー工業	12,100	1,709.00	20,678,900	
キッツ	36,600	585.00	21,411,000	
日立製作所	568,400	5,151.00	2,927,828,400	
東芝	175,400	3,480.00	610,392,000	
三菱電機	1,182,400	1,622.00	1,917,852,800	
富士電機	71,200	4,575.00	325,740,000	
東洋電機製造	4,700	1,213.00	5,701,100	
安川電機	127,300	5,440.00	692,512,000	
シンフォニアテクノロジー	15,400	1,339.00	20,620,600	
明電舎	20,000	2,305.00	46,100,000	
オリジン	2,600	1,364.00	3,546,400	
山洋電気	5,700	5,880.00	33,516,000	
デンヨー	10,100	2,080.00	21,008,000	
ペイカレント・コンサルティング	7,400	22,000.00	162,800,000	
Orchestra Holdings	2,500	3,180.00	7,950,000	

アイモバイル	4,000	1,378.00	5,512,000
キャリアインデックス	4,600	589.00	2,709,400
MS - J a p a n	4,500	1,129.00	5,080,500
船場	1,600	848.00	1,356,800
グレイステクノロジー	5,700	5,330.00	30,381,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	32,500	2,110.00	68,575,000
フルテック	1,800	1,400.00	2,520,000
グリーンズ	4,200	644.00	2,704,800
ツナググループ・ホールディングス	1,700	356.00	605,200
GAMEWITH	3,500	610.00	2,135,000
ソウルドアウト	2,700	1,661.00	4,484,700
MS&Consulting	1,900	591.00	1,122,900
エル・ティー・エス	800	3,490.00	2,792,000
ミダック	2,400	4,120.00	9,888,000
日総工産	8,700	826.00	7,186,200
キュービーネットホールディングス	5,200	1,766.00	9,183,200
RPAホールディングス	12,800	625.00	8,000,000
三櫻工業	16,300	996.00	16,234,800
マキタ	154,200	4,615.00	711,633,000
東芝テック	12,700	3,960.00	50,292,000
芝浦メカトロニクス	2,100	5,000.00	10,500,000
マブチモーター	32,700	4,765.00	155,815,500
日本電産	284,600	14,110.00	4,015,706,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,000	884.00	6,188,000
トレックス・セミコンダクター	6,400	1,630.00	10,432,000
東光高岳	6,000	1,509.00	9,054,000
ダブル・スコープ	23,200	783.00	18,165,600
宮越ホールディングス	4,400	1,070.00	4,708,000
ダイヘン	12,900	4,570.00	58,953,000
ヤーマン	19,300	1,737.00	33,524,100
JVCケンウッド	101,900	189.00	19,259,100
ミマキエンジニアリング	11,000	547.00	6,017,000
I - P E X	5,500	1,993.00	10,961,500
日新電機	27,700	1,277.00	35,372,900
大崎電気工業	23,400	601.00	14,063,400
オムロン	98,400	9,040.00	889,536,000
日東工業	17,300	2,026.00	35,049,800
I D E C	15,900	1,857.00	29,526,300
正興電機製作所	2,700	2,113.00	5,705,100
不二電機工業	2,300	1,266.00	2,911,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,400	3,295.00	139,708,000
サクサホールディングス	2,800	1,490.00	4,172,000
メルコホールディングス	4,100	3,840.00	15,744,000
テクノメディカ	2,800	1,606.00	4,496,800
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,400	3,570.00	12,138,000
日本電気	150,200	5,980.00	898,196,000
富士通	106,400	15,535.00	1,652,924,000
沖電気工業	47,900	1,054.00	50,486,600

岩崎通信機	4,400	868.00	3,819,200	
電気興業	5,700	2,926.00	16,678,200	
サンケン電気	13,800	5,460.00	75,348,000	
ナカヨ	1,900	1,423.00	2,703,700	
アイホン	6,800	1,785.00	12,138,000	
ルネサスエレクトロニクス	508,700	1,226.00	623,666,200	
セイコーエプソン	146,600	1,828.00	267,984,800	
ワコム	85,500	788.00	67,374,000	
アルバック	21,800	4,925.00	107,365,000	
アクセル	4,900	785.00	3,846,500	
E I Z O	10,000	3,815.00	38,150,000	
ジャパンディスプレイ	404,000	48.00	19,392,000	
日本信号	27,600	940.00	25,944,000	
京三製作所	25,400	426.00	10,820,400	
能美防災	15,700	2,210.00	34,697,000	
ホーチキ	8,600	1,271.00	10,930,600	
星和電機	5,900	602.00	3,551,800	
エレコム	13,500	4,855.00	65,542,500	
パナソニック	1,260,900	1,443.00	1,819,478,700	
シャープ	136,800	2,040.00	279,072,000	
アンリツ	71,000	2,321.00	164,791,000	
富士通ゼネラル	36,200	2,909.00	105,305,800	
ソニー	740,600	11,570.00	8,568,742,000	
T D K	57,100	16,050.00	916,455,000	
帝国通信工業	5,600	1,146.00	6,417,600	
タムラ製作所	42,300	551.00	23,307,300	
アルプスアルパイン	96,500	1,457.00	140,600,500	
池上通信機	4,000	832.00	3,328,000	
日本電波工業	11,500	781.00	8,981,500	
鈴木	5,300	1,051.00	5,570,300	
日本トリム	2,500	4,285.00	10,712,500	
ローランド ディー . ジー .	7,000	1,843.00	12,901,000	
フォスター電機	12,400	1,275.00	15,810,000	
S M K	3,100	2,988.00	9,262,800	
ヨコオ	8,700	2,936.00	25,543,200	
ティアック	7,300	129.00	941,700	
ホシデン	32,200	1,067.00	34,357,400	
ヒロセ電機	18,200	16,240.00	295,568,000	
日本航空電子工業	27,000	1,728.00	46,656,000	
T O A	14,000	918.00	12,852,000	
マクセルホールディングス	23,400	1,464.00	34,257,600	
古野電気	15,100	1,106.00	16,700,600	
ユニデンホールディングス	3,000	2,545.00	7,635,000	
スミダコーポレーション	10,000	1,001.00	10,010,000	
アイコム	4,900	2,713.00	13,293,700	
リオン	5,000	2,851.00	14,255,000	
本多通信工業	9,400	515.00	4,841,000	
船井電機	13,400	473.00	6,338,200	
横河電機	118,300	2,109.00	249,494,700	
新電元工業	4,500	3,200.00	14,400,000	

アズビル	80,000	4,730.00	378,400,000
東亜ディーケーケー	6,100	818.00	4,989,800
日本光電工業	48,900	2,961.00	144,792,900
チノー	3,800	1,372.00	5,213,600
共和電業	13,000	382.00	4,966,000
日本電子材料	4,300	1,803.00	7,752,900
堀場製作所	23,400	6,570.00	153,738,000
アドバンテスト	87,900	9,460.00	831,534,000
小野測器	4,300	537.00	2,309,100
エスペック	10,500	1,847.00	19,393,500
キーエンス	116,000	53,590.00	6,216,440,000
日置電機	5,700	3,740.00	21,318,000
シスメックス	92,200	11,360.00	1,047,392,000
日本マイクロニクス	20,600	1,769.00	36,441,400
メガチップス	11,900	3,345.00	39,805,500
OBARA GROUP	7,000	3,830.00	26,810,000
IMAGICA GROUP	10,000	506.00	5,060,000
澤藤電機	1,300	2,380.00	3,094,000
デンソー	260,400	6,670.00	1,736,868,000
原田工業	5,000	933.00	4,665,000
コーセル	14,400	1,119.00	16,113,600
イリソ電子工業	9,900	5,030.00	49,797,000
オブテックスグループ	19,400	1,648.00	31,971,200
千代田インテグレ	5,100	1,770.00	9,027,000
アイ・オー・データ機器	4,400	989.00	4,351,600
レーザーテック	51,900	13,700.00	711,030,000
スタンレー電気	82,900	3,325.00	275,642,500
岩崎電気	4,300	1,503.00	6,462,900
ウシオ電機	60,600	1,382.00	83,749,200
岡谷電機産業	8,900	367.00	3,266,300
ヘリオス テクノ ホールディング	11,200	339.00	3,796,800
エノモト	3,300	1,921.00	6,339,300
日本セラミック	12,000	2,717.00	32,604,000
遠藤照明	6,700	617.00	4,133,900
古河電池	8,400	1,609.00	13,515,600
双信電機	5,800	444.00	2,575,200
山一電機	7,600	1,422.00	10,807,200
図研	7,700	2,715.00	20,905,500
日本電子	21,600	4,105.00	88,668,000
カシオ計算機	95,100	2,119.00	201,516,900
ファナック	103,800	27,785.00	2,884,083,000
日本シイエムケイ	25,500	430.00	10,965,000
エンプラス	5,300	4,465.00	23,664,500
大真空	4,000	2,665.00	10,660,000
ローム	49,200	10,890.00	535,788,000
浜松ホトニクス	84,800	6,610.00	560,528,000
三井ハイテック	11,600	4,490.00	52,084,000
新光電気工業	39,700	2,942.00	116,797,400
京セラ	180,200	7,149.00	1,288,249,800
協栄産業	1,500	1,383.00	2,074,500

太陽誘電	52,500	5,590.00	293,475,000
村田製作所	347,300	9,579.00	3,326,786,700
双葉電子工業	20,300	971.00	19,711,300
日東電工	75,700	9,300.00	704,010,000
北陸電気工業	4,600	909.00	4,181,400
東海理化電機製作所	31,200	1,793.00	55,941,600
ニチコン	37,100	1,113.00	41,292,300
日本ケミコン	11,900	1,820.00	21,658,000
K O A	16,300	1,470.00	23,961,000
三井E & Sホールディングス	45,700	482.00	22,027,400
日立造船	93,700	699.00	65,496,300
三菱重工業	185,700	3,146.00	584,212,200
川崎重工業	91,900	2,390.00	219,641,000
I H I	79,500	2,027.00	161,146,500
名村造船所	35,700	193.00	6,890,100
サノヤスホールディングス	15,500	152.00	2,356,000
スプリックス	3,200	890.00	2,848,000
マネジメントソリューションズ	5,500	1,854.00	10,197,000
プロレド・パートナーズ	1,600	3,495.00	5,592,000
and factory	1,000	825.00	825,000
テノ.ホールディングス	900	1,090.00	981,000
フロンティア・マネジメント	2,000	1,823.00	3,646,000
ピアラ	600	1,780.00	1,068,000
コプロ・ホールディングス	600	2,767.00	1,660,200
ギークス	1,500	1,554.00	2,331,000
カーブスホールディングス	31,000	1,006.00	31,186,000
フォーラムエンジニアリング	5,800	1,132.00	6,565,600
日本車輛製造	4,300	2,504.00	10,767,200
三菱ロジスネクスト	15,700	1,158.00	18,180,600
近畿車輛	1,600	1,266.00	2,025,600
F P G	35,800	643.00	23,019,400
島根銀行	4,300	680.00	2,924,000
じもとホールディングス	8,000	788.00	6,304,000
全国保証	30,300	5,100.00	154,530,000
めぶきフィナンシャルグループ	604,600	233.00	140,871,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,900	1,347.00	7,947,300
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,600	1,269.00	18,527,400
九州フィナンシャルグループ	238,000	452.00	107,576,000
かんぼ生命保険	144,500	2,245.00	324,402,500
ゆうちょ銀行	330,800	1,031.00	341,054,800
富山第一銀行	28,600	295.00	8,437,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	709,700	432.00	306,590,400
ジェイリース	3,800	814.00	3,093,200
西日本フィナンシャルホールディングス	77,600	714.00	55,406,400
マーキュリアインベストメント	4,800	722.00	3,465,600
イントラスト	3,300	709.00	2,339,700
日本モーゲージサービス	5,900	1,131.00	6,672,900

C A S A	3,200	1,009.00	3,228,800	
アルヒ	17,100	1,641.00	28,061,100	
プレミアグループ	5,400	2,433.00	13,138,200	
日産自動車	1,394,400	586.00	817,118,400	
いすゞ自動車	342,600	1,135.00	388,851,000	
トヨタ自動車	1,197,800	8,018.00	9,603,960,400	
日野自動車	147,700	1,029.00	151,983,300	
三菱自動車工業	437,100	305.00	133,315,500	
エフテック	8,400	666.00	5,594,400	
レシップホールディングス	4,600	605.00	2,783,000	
G M B	2,200	906.00	1,993,200	
ファルテック	2,300	798.00	1,835,400	
武蔵精密工業	26,400	1,811.00	47,810,400	
日産車体	17,300	798.00	13,805,400	
新明和工業	33,300	973.00	32,400,900	
極東開発工業	20,400	1,573.00	32,089,200	
トビー工業	9,800	1,439.00	14,102,200	
ティラド	3,700	1,850.00	6,845,000	
曙ブレーキ工業	64,100	166.00	10,640,600	
タチエス	18,100	1,088.00	19,692,800	
N O K	57,200	1,514.00	86,600,800	
フタバ産業	29,600	534.00	15,806,400	
K Y B	13,200	3,055.00	40,326,000	
市光工業	17,600	754.00	13,270,400	
大同メタル工業	24,600	561.00	13,800,600	
プレス工業	58,500	327.00	19,129,500	
ミクニ	16,100	282.00	4,540,200	
太平洋工業	24,800	1,194.00	29,611,200	
河西工業	16,200	408.00	6,609,600	
アイシン精機	86,500	3,745.00	323,942,500	
マツダ	370,800	862.00	319,629,600	
今仙電機製作所	10,400	751.00	7,810,400	
本田技研工業	930,900	3,026.00	2,816,903,400	
スズキ	234,400	4,805.00	1,126,292,000	
S U B A R U	338,800	2,035.00	689,458,000	
安永	5,700	1,164.00	6,634,800	
ヤマハ発動機	167,100	2,440.00	407,724,000	
小糸製作所	70,800	7,490.00	530,292,000	
T B K	11,800	438.00	5,168,400	
エクセディ	16,000	1,696.00	27,136,000	
ミツバ	21,700	617.00	13,388,900	
豊田合成	38,200	2,838.00	108,411,600	
愛三工業	18,500	582.00	10,767,000	
盟和産業	1,600	881.00	1,409,600	
日本プラスト	10,300	595.00	6,128,500	
ヨロズ	10,200	1,280.00	13,056,000	
エフ・シー・シー	19,300	1,787.00	34,489,100	
新家工業	3,100	1,500.00	4,650,000	
シマノ	44,300	24,405.00	1,081,141,500	
テイ・エス テック	27,400	3,130.00	85,762,000	



関西みらいフィナンシャルグループ	54,800	619.00	33,921,200	
三十三フィナンシャルグループ	10,200	1,395.00	14,229,000	
第四北越フィナンシャルグループ	19,000	2,398.00	45,562,000	
ひろぎんホールディングス	172,200	645.00	111,069,000	
ダイレクトマーケティングミックス	4,400	3,260.00	14,344,000	
ポピンズホールディングス	2,300	3,350.00	7,705,000	
ジャムコ	7,000	958.00	6,706,000	
小野建	10,700	1,316.00	14,081,200	
はるやまホールディングス	6,100	702.00	4,282,200	
南陽	2,100	1,614.00	3,389,400	
ノジマ	20,700	2,856.00	59,119,200	
佐鳥電機	7,400	772.00	5,712,800	
カップ・クリエイト	16,400	1,521.00	24,944,400	
エコートレーディング	2,600	642.00	1,669,200	
伯東	7,100	1,273.00	9,038,300	
コンドーテック	9,200	1,054.00	9,696,800	
中山福	7,100	515.00	3,656,500	
ライトオン	8,800	631.00	5,552,800	
ナガイレーベン	15,500	2,678.00	41,509,000	
ジーンズメイト	3,600	293.00	1,054,800	
三菱食品	12,900	2,865.00	36,958,500	
良品計画	154,500	2,431.00	375,589,500	
三城ホールディングス	14,900	295.00	4,395,500	
松田産業	8,500	1,922.00	16,337,000	
第一興商	17,300	4,270.00	73,871,000	
メディバルホールディングス	116,700	2,213.00	258,257,100	
アドヴァン	12,000	1,087.00	13,044,000	
S P K	5,200	1,281.00	6,661,200	
萩原電気ホールディングス	4,400	2,558.00	11,255,200	
アルビス	3,700	2,414.00	8,931,800	
アズワン	8,300	13,900.00	115,370,000	
スズデン	3,500	1,259.00	4,406,500	
尾家産業	3,000	1,386.00	4,158,000	
シモジマ	6,500	1,380.00	8,970,000	
ドウシシャ	11,000	1,808.00	19,888,000	
小津産業	2,300	1,917.00	4,409,100	
コナカ	14,100	360.00	5,076,000	
高速	6,300	1,520.00	9,576,000	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,706.00	2,047,200	
G - 7ホールディングス	6,900	2,358.00	16,270,200	
たけびし	3,500	1,543.00	5,400,500	
イオン北海道	15,600	1,187.00	18,517,200	
コジマ	19,900	629.00	12,517,100	
ヒマラヤ	4,300	940.00	4,042,000	
コーナン商事	16,600	2,889.00	47,957,400	
ネットワンシステムズ	47,300	3,340.00	157,982,000	
エコス	4,300	1,883.00	8,096,900	
ワタミ	15,300	1,044.00	15,973,200	
マルシェ	3,000	528.00	1,584,000	
リックス	2,200	1,551.00	3,412,200	

システムソフト	25,500	136.00	3,468,000	
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	232,800	2,494.00	580,603,200	
丸文	10,600	524.00	5,554,400	
西松屋チェーン	25,500	1,422.00	36,261,000	
ゼンショーホールディングス	62,500	2,878.00	179,875,000	
ハピネット	9,700	1,504.00	14,588,800	
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,790.00	13,067,000	
ハークスレイ	2,000	907.00	1,814,000	
橋本総業ホールディングス	2,000	2,529.00	5,058,000	
日本ライフライン	37,600	1,325.00	49,820,000	
サイゼリヤ	17,200	2,222.00	38,218,400	
タカショー	7,400	771.00	5,705,400	
V Tホールディングス	43,900	425.00	18,657,500	
マルカ	3,800	2,002.00	7,607,600	
アルゴグラフィックス	9,000	3,045.00	27,405,000	
魚力	3,500	1,866.00	6,531,000	
I D O M	39,300	640.00	25,152,000	
日本エム・ディ・エム	6,800	1,966.00	13,368,800	
ポブラ	3,300	336.00	1,108,800	
フジ・コーポレーション	3,100	2,232.00	6,919,200	
ユナイテッドアローズ	13,200	2,088.00	27,561,600	
進和	7,000	2,088.00	14,616,000	
エスケイジヤパン	2,700	455.00	1,228,500	
ダイترون	5,000	1,488.00	7,440,000	
ハイデイ日高	16,800	1,725.00	28,980,000	
シークス	14,800	1,841.00	27,246,800	
京都きもの友禅	6,400	254.00	1,625,600	
コロワイド	38,600	2,047.00	79,014,200	
ピーシーデポコーポレーション	13,600	517.00	7,031,200	
田中商事	3,100	700.00	2,170,000	
オーハシテクニカ	6,200	1,489.00	9,231,800	
壱番屋	8,200	4,870.00	39,934,000	
白銅	3,600	1,415.00	5,094,000	
トップカルチャー	4,800	351.00	1,684,800	
P L A N T	3,100	763.00	2,365,300	
スギホールディングス	23,200	7,560.00	175,392,000	
ダイコー通産	1,100	1,510.00	1,661,000	
薬王堂ホールディングス	5,100	2,705.00	13,795,500	
島津製作所	152,200	4,045.00	615,649,000	
J M S	10,000	960.00	9,600,000	
クボテック	3,100	373.00	1,156,300	
長野計器	8,500	991.00	8,423,500	
ブイ・テクノロジー	5,500	5,580.00	30,690,000	
スター精密	18,200	1,590.00	28,938,000	
東京計器	7,500	927.00	6,952,500	
愛知時計電機	1,200	4,400.00	5,280,000	
インターアクション	5,900	2,612.00	15,410,800	
オーバル	10,700	289.00	3,092,300	
東京精密	19,900	4,850.00	96,515,000	

マニー	47,000	2,569.00	120,743,000
ニコン	180,400	973.00	175,529,200
トプコン	59,500	1,344.00	79,968,000
オリンパス	654,200	2,280.00	1,491,576,000
理研計器	10,500	2,706.00	28,413,000
S C R E E Nホールディングス	20,500	8,880.00	182,040,000
キヤノン電子	10,900	1,663.00	18,126,700
タムロン	9,500	1,987.00	18,876,500
H O Y A	234,600	12,680.00	2,974,728,000
シード	5,200	660.00	3,432,000
ノーリツ鋼機	10,600	2,348.00	24,888,800
エー・アンド・デイ	9,900	1,191.00	11,790,900
朝日インテック	124,400	3,150.00	391,860,000
キヤノン	587,500	2,379.50	1,397,956,250
リコー	300,700	979.00	294,385,300
シチズン時計	149,200	393.00	58,635,600
リズム	3,100	773.00	2,396,300
大研医器	9,500	574.00	5,453,000
メニコン	18,100	6,480.00	117,288,000
シンシア	1,200	740.00	888,000
中本パックス	3,100	1,659.00	5,142,900
スノーピーク	7,000	3,055.00	21,385,000
パラマウントベッドホールディングス	11,400	4,315.00	49,191,000
トランザクション	6,400	1,125.00	7,200,000
粧美堂	3,000	406.00	1,218,000
ニホンフラッシュ	10,100	1,196.00	12,079,600
前田工織	13,000	2,948.00	38,324,000
永大産業	16,800	302.00	5,073,600
アートネイチャー	11,600	662.00	7,679,200
バンダイナムコホールディングス	97,800	8,537.00	834,918,600
アイフィスジャパン	3,200	721.00	2,307,200
共立印刷	21,900	127.00	2,781,300
S H O E I	10,400	4,195.00	43,628,000
フランスベッドホールディングス	15,400	954.00	14,691,600
マーベラス	18,200	895.00	16,289,000
パイロットコーポレーション	20,900	3,270.00	68,343,000
萩原工業	6,700	1,453.00	9,735,100
エイベックス	19,900	1,506.00	29,969,400
トッパン・フォームズ	21,200	1,028.00	21,793,600
フジシールインターナショナル	24,300	2,190.00	53,217,000
タカラトミー	52,900	1,004.00	53,111,600
廣濟堂	8,100	940.00	7,614,000
エステールホールディングス	4,000	665.00	2,660,000
レック	14,000	1,320.00	18,480,000
タカノ	4,500	605.00	2,722,500
三光合成	12,400	431.00	5,344,400
プロネクサス	10,300	1,214.00	12,504,200
ホクシン	8,500	116.00	986,000
ウッドワン	3,400	1,069.00	3,634,600
大建工業	8,000	2,044.00	16,352,000

きもと	18,900	193.00	3,647,700	
凸版印刷	179,600	1,718.00	308,552,800	
大日本印刷	142,800	1,958.00	279,602,400	
共同印刷	3,700	3,150.00	11,655,000	
N I S S H A	24,300	1,368.00	33,242,400	
光村印刷	800	1,775.00	1,420,000	
藤森工業	10,600	4,445.00	47,117,000	
T A K A R A & C O M P A N Y	5,800	1,728.00	10,022,400	
前澤化成工業	7,800	962.00	7,503,600	
未来工業	4,300	1,628.00	7,000,400	
アシックス	104,600	1,845.00	192,987,000	
ツツミ	3,000	2,101.00	6,303,000	
ウェーブロックホールディングス	4,000	731.00	2,924,000	
J S P	7,000	1,826.00	12,782,000	
ニチハ	16,500	3,035.00	50,077,500	
ローランド	6,900	3,630.00	25,047,000	
エフピコ	21,800	4,265.00	92,977,000	
小松ウオール工業	3,700	1,960.00	7,252,000	
ヤマハ	70,300	6,120.00	430,236,000	
河合楽器製作所	3,300	3,655.00	12,061,500	
クリナップ	11,400	509.00	5,802,600	
ピジョン	75,900	4,015.00	304,738,500	
天馬	8,900	2,162.00	19,241,800	
オリバー	2,400	2,668.00	6,403,200	
兼松サステック	600	1,781.00	1,068,600	
キングジム	10,200	905.00	9,231,000	
象印マホービン	31,900	1,786.00	56,973,400	
リンテック	25,400	2,396.00	60,858,400	
信越ポリマー	18,200	997.00	18,145,400	
東リ	31,100	243.00	7,557,300	
イトーキ	23,300	367.00	8,551,100	
任天堂	67,700	68,360.00	4,627,972,000	
三菱鉛筆	19,500	1,410.00	27,495,000	
松風	5,500	1,773.00	9,751,500	
タカラスタンダード	24,500	1,547.00	37,901,500	
コクヨ	56,600	1,529.00	86,541,400	
ナカバヤシ	12,100	619.00	7,489,900	
ニフコ	43,400	3,645.00	158,193,000	
立川ブラインド工業	5,300	1,271.00	6,736,300	
グローブライト	5,700	4,110.00	23,427,000	
オカムラ	40,600	1,111.00	45,106,600	
バルカー	9,700	2,093.00	20,302,100	
M U T O Hホールディングス	1,200	1,613.00	1,935,600	
伊藤忠商事	814,600	3,230.00	2,631,158,000	
丸紅	1,148,100	824.00	946,034,400	
スクロール	16,600	1,172.00	19,455,200	
高島	1,600	1,689.00	2,702,400	
ヨンドシーホールディングス	10,800	1,912.00	20,649,600	
三陽商会	6,000	750.00	4,500,000	
長瀬産業	65,500	1,735.00	113,642,500	

ナイガイ	3,800	326.00	1,238,800
蝶理	7,500	1,555.00	11,662,500
豊田通商	116,900	4,700.00	549,430,000
オンワードホールディングス	69,300	264.00	18,295,200
三共生興	18,000	500.00	9,000,000
兼松	46,500	1,385.00	64,402,500
美津濃	11,700	2,234.00	26,137,800
ツカモトコーポレーション	1,700	1,490.00	2,533,000
ルックホールディングス	4,000	1,180.00	4,720,000
三井物産	945,500	2,324.00	2,197,342,000
日本紙パルプ商事	6,100	3,645.00	22,234,500
東京エレクトロン	69,300	45,700.00	3,167,010,000
カメイ	15,200	1,185.00	18,012,000
東都水産	1,400	3,945.00	5,523,000
OUGホールディングス	1,800	2,824.00	5,083,200
スターゼン	4,300	4,320.00	18,576,000
セイコーホールディングス	16,600	1,732.00	28,751,200
山善	45,500	989.00	44,999,500
椿本興業	1,700	3,795.00	6,451,500
住友商事	734,900	1,594.00	1,171,430,600
日本ユニシス	40,300	3,105.00	125,131,500
内田洋行	4,600	4,665.00	21,459,000
三菱商事	709,000	3,042.00	2,156,778,000
第一実業	5,300	4,070.00	21,571,000
キャノンマーケティングジャパン	28,900	2,399.00	69,331,100
西華産業	6,200	1,379.00	8,549,800
佐藤商事	10,000	994.00	9,940,000
菱洋エレクトロ	8,800	2,748.00	24,182,400
東京産業	11,000	662.00	7,282,000
ユアサ商事	12,000	3,035.00	36,420,000
神鋼商事	2,700	1,889.00	5,100,300
トルク	5,800	255.00	1,479,000
阪和興業	23,200	2,843.00	65,957,600
正栄食品工業	7,500	3,850.00	28,875,000
カナデン	9,600	1,238.00	11,884,800
菱電商事	8,400	1,594.00	13,389,600
ニプロ	88,100	1,339.00	117,965,900
フルサト工業	6,300	1,303.00	8,208,900
岩谷産業	27,900	6,230.00	173,817,000
ナイス	4,700	1,884.00	8,854,800
昭光通商	3,400	752.00	2,556,800
ニチモウ	1,600	1,917.00	3,067,200
極東貿易	3,000	1,422.00	4,266,000
イワキ	15,200	613.00	9,317,600
兼松エレクトロニクス	6,400	3,545.00	22,688,000
三愛石油	28,700	1,098.00	31,512,600
稲畑産業	27,900	1,505.00	41,989,500
G S Iクレオス	2,800	2,608.00	7,302,400
明和産業	10,800	477.00	5,151,600
クワザワホールディングス	4,400	687.00	3,022,800

キムラタン	68,300	27.00	1,844,100
ヤマエ久野	8,500	1,043.00	8,865,500
ゴールドウイン	19,100	7,300.00	139,430,000
ユニ・チャーム	250,800	4,369.00	1,095,745,200
デサント	19,800	1,758.00	34,808,400
キング	4,600	570.00	2,622,000
ワキタ	22,900	971.00	22,235,900
ヤマトインターナショナル	10,600	331.00	3,508,600
東邦ホールディングス	37,300	1,914.00	71,392,200
サンゲツ	31,500	1,593.00	50,179,500
ミツウロコグループホールディングス	17,100	1,245.00	21,289,500
シナネンホールディングス	4,300	3,120.00	13,416,000
伊藤忠エネクス	26,000	1,015.00	26,390,000
サンリオ	32,600	1,771.00	57,734,600
サンワテクノス	7,600	1,021.00	7,759,600
リョーサン	12,800	2,220.00	28,416,000
新光商事	15,900	770.00	12,243,000
トーヨー	5,400	1,805.00	9,747,000
三信電気	6,400	1,950.00	12,480,000
東陽テクニカ	12,200	1,103.00	13,456,600
モスフードサービス	16,500	3,120.00	51,480,000
加賀電子	10,500	2,342.00	24,591,000
三益半導体工業	9,100	2,525.00	22,977,500
都築電気	4,300	1,531.00	6,583,300
ソーダニッカ	11,300	539.00	6,090,700
立花エレテック	8,700	1,575.00	13,702,500
木曽路	15,300	2,462.00	37,668,600
SRSホールディングス	14,600	884.00	12,906,400
千趣会	20,900	386.00	8,067,400
タカキュー	9,900	142.00	1,405,800
リテールパートナーズ	14,100	1,419.00	20,007,900
ケーヨー	21,600	734.00	15,854,400
上新電機	13,700	3,070.00	42,059,000
日本瓦斯	19,200	5,030.00	96,576,000
ロイヤルホールディングス	20,300	1,970.00	39,991,000
東天紅	600	953.00	571,800
いなげや	13,000	1,666.00	21,658,000
チヨダ	12,200	984.00	12,004,800
ライフコーポレーション	8,800	3,245.00	28,556,000
リンガーハット	14,400	2,345.00	33,768,000
MrMaxHD	15,900	721.00	11,463,900
テンアライド	11,700	353.00	4,130,100
AOKIホールディングス	23,100	695.00	16,054,500
オークワ	18,200	1,157.00	21,057,400
コメリ	18,000	2,902.00	52,236,000
青山商事	25,700	834.00	21,433,800
しまむら	13,500	10,860.00	146,610,000
はせがわ	5,200	291.00	1,513,200
高島屋	84,700	1,112.00	94,186,400
松屋	25,400	989.00	25,120,600

エイチ・ツー・オー リテイリング	55,000	876.00	48,180,000
近鉄百貨店	4,500	3,350.00	15,075,000
丸井グループ	98,500	2,111.00	207,933,500
クレディセゾン	68,000	1,370.00	93,160,000
アクシアル リテイリング	9,700	4,605.00	44,668,500
井筒屋	6,300	264.00	1,663,200
イオン	448,100	3,354.00	1,502,927,400
イズミ	23,600	3,955.00	93,338,000
フォーバル	4,300	822.00	3,534,600
平和堂	21,500	2,009.00	43,193,500
フジ	14,100	1,865.00	26,296,500
ヤオコー	13,200	6,570.00	86,724,000
ゼビオホールディングス	14,000	923.00	12,922,000
ケーズホールディングス	103,700	1,479.00	153,372,300
PALTA C	18,700	5,790.00	108,273,000
三谷産業	15,600	417.00	6,505,200
Olympicグループ	6,000	919.00	5,514,000
日産東京販売ホールディングス	14,300	254.00	3,632,200
新生銀行	95,100	1,558.00	148,165,800
あおぞら銀行	69,400	2,306.00	160,036,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,977,200	568.10	4,531,847,320
りそなホールディングス	1,267,600	444.20	563,067,920
三井住友トラスト・ホールディングス	220,500	3,614.00	796,887,000
三井住友フィナンシャルグループ	807,100	3,811.00	3,075,858,100
千葉銀行	388,800	707.00	274,881,600
群馬銀行	239,800	354.00	84,889,200
武蔵野銀行	17,300	1,654.00	28,614,200
千葉興業銀行	29,800	267.00	7,956,600
筑波銀行	48,400	189.00	9,147,600
七十七銀行	36,600	1,450.00	53,070,000
青森銀行	9,000	2,477.00	22,293,000
秋田銀行	7,100	1,450.00	10,295,000
山形銀行	13,000	1,126.00	14,638,000
岩手銀行	7,600	2,165.00	16,454,000
東邦銀行	104,100	218.00	22,693,800
東北銀行	5,900	1,095.00	6,460,500
みちのく銀行	7,500	1,069.00	8,017,500
ふくおかフィナンシャルグループ	105,100	1,972.00	207,257,200
静岡銀行	283,900	810.00	229,959,000
十六銀行	14,600	2,011.00	29,360,600
スルガ銀行	101,600	368.00	37,388,800
八十二銀行	262,300	365.00	95,739,500
山梨中央銀行	13,600	909.00	12,362,400
大垣共立銀行	23,000	2,087.00	48,001,000
福井銀行	10,000	1,924.00	19,240,000
北國銀行	10,900	2,757.00	30,051,300
清水銀行	4,900	1,669.00	8,178,100
富山銀行	1,900	2,940.00	5,586,000
滋賀銀行	23,300	2,200.00	51,260,000
南都銀行	17,000	1,857.00	31,569,000

百五銀行	105,200	311.00	32,717,200	
京都銀行	41,700	6,640.00	276,888,000	
紀陽銀行	41,300	1,470.00	60,711,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	77,500	1,001.00	77,577,500	
山陰合同銀行	73,600	504.00	37,094,400	
中国銀行	100,400	877.00	88,050,800	
鳥取銀行	4,000	1,117.00	4,468,000	
伊予銀行	154,600	642.00	99,253,200	
百十四銀行	12,200	1,597.00	19,483,400	
四国銀行	16,700	760.00	12,692,000	
阿波銀行	17,800	2,318.00	41,260,400	
大分銀行	6,800	2,190.00	14,892,000	
宮崎銀行	7,300	2,334.00	17,038,200	
佐賀銀行	6,700	1,434.00	9,607,800	
沖縄銀行	10,700	2,860.00	30,602,000	
琉球銀行	25,400	791.00	20,091,400	
セブン銀行	389,000	242.00	94,138,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,584,600	1,593.00	2,524,267,800	
高知銀行	4,200	826.00	3,469,200	
山口フィナンシャルグループ	145,400	675.00	98,145,000	
芙蓉総合リース	12,200	7,340.00	89,548,000	
みずほリース	18,000	3,385.00	60,930,000	
東京センチュリー	27,100	7,170.00	194,307,000	
SBIホールディングス	143,000	3,070.00	439,010,000	
日本証券金融	49,400	613.00	30,282,200	
アイフル	195,200	289.00	56,412,800	
日本アジア投資	10,100	251.00	2,535,100	
長野銀行	3,900	1,315.00	5,128,500	
名古屋銀行	9,400	2,904.00	27,297,600	
北洋銀行	176,000	246.00	43,296,000	
愛知銀行	3,900	2,971.00	11,586,900	
中京銀行	4,300	1,778.00	7,645,400	
大光銀行	3,500	1,399.00	4,896,500	
愛媛銀行	16,500	985.00	16,252,500	
トマト銀行	4,500	1,072.00	4,824,000	
京葉銀行	49,700	439.00	21,818,300	
栃木銀行	56,100	178.00	9,985,800	
北日本銀行	3,700	1,944.00	7,192,800	
東和銀行	20,500	696.00	14,268,000	
福島銀行	13,200	269.00	3,550,800	
大東銀行	5,900	653.00	3,852,700	
リコーリース	9,200	3,325.00	30,590,000	
イオンフィナンシャルサービス	71,300	1,410.00	100,533,000	
アコム	234,500	484.00	113,498,000	
ジャックス	12,800	2,082.00	26,649,600	
オリエントコーポレーション	315,100	151.00	47,580,100	
日立キャピタル	27,500	2,962.00	81,455,000	
オリックス	707,800	1,845.00	1,305,891,000	
三菱UFJリース	262,400	586.00	153,766,400	
ジャフコグループ	17,900	6,730.00	120,467,000	



九州リースサービス	6,500	645.00	4,192,500
トモニホールディングス	90,100	310.00	27,931,000
大和証券グループ本社	873,300	538.70	470,446,710
野村ホールディングス	1,780,300	631.70	1,124,615,510
岡三証券グループ	99,200	413.00	40,969,600
丸三証券	34,600	599.00	20,725,400
東洋証券	38,200	184.00	7,028,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,800	376.00	46,548,800
光世証券	3,000	707.00	2,121,000
水戸証券	31,200	302.00	9,422,400
いちよし証券	23,200	608.00	14,105,600
松井証券	57,100	936.00	53,445,600
SOMPOホールディングス	205,600	4,181.00	859,613,600
日本取引所グループ	315,000	2,384.00	750,960,000
マネックスグループ	104,400	912.00	95,212,800
極東証券	15,700	810.00	12,717,000
岩井コスモホールディングス	11,900	1,606.00	19,111,400
藍澤證券	21,100	863.00	18,209,300
フィデアホールディングス	114,000	125.00	14,250,000
池田泉州ホールディングス	133,500	164.00	21,894,000
アニコムホールディングス	32,800	1,047.00	34,341,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	283,300	3,105.00	879,646,500
マネーパートナーズグループ	12,800	300.00	3,840,000
スパークス・グループ	53,800	328.00	17,646,400
小林洋行	3,000	284.00	852,000
第一生命ホールディングス	616,000	1,889.50	1,163,932,000
東京海上ホールディングス	386,600	5,370.00	2,076,042,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,700	765.00	4,360,500
イー・ギャランティ	13,300	2,117.00	28,156,100
アサックス	6,500	737.00	4,790,500
NECキャピタルソリューション	4,800	2,001.00	9,604,800
T&Dホールディングス	348,400	1,471.00	512,496,400
アドバンスクリエイト	2,400	1,793.00	4,303,200
三井不動産	531,400	2,493.00	1,324,780,200
三菱地所	766,000	1,917.00	1,468,422,000
平和不動産	20,000	3,530.00	70,600,000
東京建物	114,900	1,589.00	182,576,100
ダイビル	30,100	1,352.00	40,695,200
京阪神ビルディング	20,100	1,540.00	30,954,000
住友不動産	262,100	3,854.00	1,010,133,400
太平洋興発	5,100	686.00	3,498,600
テーオーシー	22,900	804.00	18,411,600
東京楽天地	2,000	4,320.00	8,640,000
レオパレス21	96,500	134.00	12,931,000
スターツコーポレーション	13,800	2,875.00	39,675,000
フジ住宅	13,600	649.00	8,826,400
空港施設	12,100	533.00	6,449,300
明和地所	5,500	659.00	3,624,500

ゴールドクレスト	10,500	1,692.00	17,766,000
リログループ	61,700	2,598.00	160,296,600
エスリード	4,600	1,603.00	7,373,800
日神グループホールディングス	17,600	455.00	8,008,000
日本エスコン	21,100	769.00	16,225,900
タカラレーベン	48,600	351.00	17,058,600
A V A N T I A	6,600	864.00	5,702,400
イオンモール	58,400	1,852.00	108,156,800
毎日コムネット	3,500	697.00	2,439,500
ファースト住建	5,000	1,111.00	5,555,000
ランド	624,600	15.00	9,369,000
カチタス	28,900	2,998.00	86,642,200
東祥	7,100	2,100.00	14,910,000
トーセイ	16,100	1,030.00	16,583,000
穴吹興産	2,700	1,719.00	4,641,300
サンフロンティア不動産	14,100	980.00	13,818,000
エフ・ジェー・ネクスト	11,600	1,123.00	13,026,800
インテリックス	2,700	565.00	1,525,500
ランドビジネス	4,400	359.00	1,579,600
サンネクスタグループ	3,800	968.00	3,678,400
グランディハウス	8,100	470.00	3,807,000
東武鉄道	123,200	3,120.00	384,384,000
相鉄ホールディングス	40,500	2,512.00	101,736,000
東急	298,100	1,497.00	446,255,700
京浜急行電鉄	151,800	1,754.00	266,257,200
小田急電鉄	189,400	3,220.00	609,868,000
京王電鉄	66,000	8,350.00	551,100,000
京成電鉄	88,600	3,965.00	351,299,000
富士急行	16,100	5,750.00	92,575,000
新京成電鉄	3,000	2,223.00	6,669,000
東日本旅客鉄道	208,100	7,900.00	1,643,990,000
西日本旅客鉄道	105,300	6,667.00	702,035,100
東海旅客鉄道	98,300	17,790.00	1,748,757,000
西武ホールディングス	142,400	1,350.00	192,240,000
鴻池運輸	19,000	1,075.00	20,425,000
西日本鉄道	32,800	3,060.00	100,368,000
ハマキョウレックス	9,100	3,270.00	29,757,000
サカイ引越センター	5,500	4,945.00	27,197,500
近鉄グループホールディングス	111,900	4,580.00	512,502,000
阪急阪神ホールディングス	149,300	3,615.00	539,719,500
南海電気鉄道	53,100	2,597.00	137,900,700
京阪ホールディングス	49,900	4,845.00	241,765,500
神戸電鉄	2,800	3,685.00	10,318,000
名古屋鉄道	92,100	2,784.00	256,406,400
山陽電気鉄道	8,100	2,002.00	16,216,200
アルプス物流	7,800	1,025.00	7,995,000
トランコム	3,400	8,210.00	27,914,000
日本通運	38,800	8,080.00	313,504,000
ヤマトホールディングス	157,000	2,861.00	449,177,000
山九	28,700	4,500.00	129,150,000

日新	9,000	1,375.00	12,375,000	
丸運	7,600	255.00	1,938,000	
丸全昭和運輸	9,100	3,080.00	28,028,000	
センコーグループホールディングス	61,900	1,032.00	63,880,800	
トナミホールディングス	2,300	5,100.00	11,730,000	
ニッコンホールディングス	37,600	2,130.00	80,088,000	
日本石油輸送	900	2,707.00	2,436,300	
福山通運	14,400	4,220.00	60,768,000	
セイノーホールディングス	83,900	1,523.00	127,779,700	
エスライン	3,000	882.00	2,646,000	
神奈川中央交通	2,500	3,830.00	9,575,000	
日立物流	24,700	3,440.00	84,968,000	
丸和運輸機関	23,600	2,025.00	47,790,000	
C & F ロジホールディングス	11,400	1,801.00	20,531,400	
日本郵船	93,600	3,125.00	292,500,000	
商船三井	66,400	3,435.00	228,084,000	
川崎汽船	34,500	2,065.00	71,242,500	
NSユナイテッド海運	5,400	1,594.00	8,607,600	
明治海運	12,300	381.00	4,686,300	
飯野海運	52,400	460.00	24,104,000	
共栄タンカー	2,200	996.00	2,191,200	
九州旅客鉄道	86,400	2,807.00	242,524,800	
SGホールディングス	211,700	2,529.00	535,389,300	
日本航空	272,700	2,531.00	690,203,700	
ANAホールディングス	302,100	2,603.00	786,366,300	
パスコ	2,200	1,326.00	2,917,200	
西本Wismettacホールディングス	2,600	2,839.00	7,381,400	
シルバーライフ	1,600	2,110.00	3,376,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,555.00	1,710,500	
一家ダイニングプロジェクト	1,100	617.00	678,700	
Genky DrugStores	5,100	3,460.00	17,646,000	
コア商事ホールディングス	3,300	1,219.00	4,022,700	
国際紙バルブ商事	25,500	242.00	6,171,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,300	1,113.00	2,559,900	
ブックオフグループホールディングス	6,800	897.00	6,099,600	
ギフト	1,100	2,081.00	2,289,100	
三菱倉庫	38,700	3,470.00	134,289,000	
三井倉庫ホールディングス	11,900	2,240.00	26,656,000	
住友倉庫	40,300	1,509.00	60,812,700	
澁澤倉庫	6,300	2,256.00	14,212,800	
ヤマタネ	5,300	1,419.00	7,520,700	
東陽倉庫	16,800	327.00	5,493,600	
乾汽船	5,900	930.00	5,487,000	
日本トランスシティ	25,100	539.00	13,528,900	
ケイヒン	1,700	1,365.00	2,320,500	
中央倉庫	6,400	1,187.00	7,596,800	
川西倉庫	2,100	1,195.00	2,509,500	
安田倉庫	9,600	949.00	9,110,400	
ファイズホールディングス	2,000	931.00	1,862,000	

東洋埠頭	3,000	1,443.00	4,329,000
宇徳	8,500	469.00	3,986,500
上組	62,400	2,050.00	127,920,000
サンリツ	2,300	698.00	1,605,400
キムラユニティー	3,500	1,139.00	3,986,500
キューソー流通システム	2,900	1,583.00	4,590,700
近鉄エクスプレス	21,200	2,825.00	59,890,000
東海運	7,900	321.00	2,535,900
エーアイテイー	7,200	1,000.00	7,200,000
内外トランスライン	4,100	1,344.00	5,510,400
ショーエイコーポレーション	2,600	1,012.00	2,631,200
日本コンセプト	3,700	1,670.00	6,179,000
TBSホールディングス	76,900	2,027.00	155,876,300
日本テレビホールディングス	96,600	1,464.00	141,422,400
朝日放送グループホールディングス	12,100	718.00	8,687,800
テレビ朝日ホールディングス	35,800	2,127.00	76,146,600
スカパーJSATホールディングス	76,300	460.00	35,098,000
テレビ東京ホールディングス	8,500	2,444.00	20,774,000
日本BS放送	4,100	1,122.00	4,600,200
ビジョン	14,200	1,131.00	16,060,200
スマートバリュー	3,100	927.00	2,873,700
USEN-NEXT HOLDINGS	4,400	1,838.00	8,087,200
ワイヤレスゲート	4,800	507.00	2,433,600
コネクシオ	6,700	1,378.00	9,232,600
日本通信	102,000	270.00	27,540,000
クロップス	2,300	778.00	1,789,400
日本電信電話	1,357,100	2,786.00	3,780,880,600
KDDI	930,400	3,383.00	3,147,543,200
ソフトバンク	1,054,500	1,439.50	1,517,952,750
光通信	13,700	21,620.00	296,194,000
エムティーアイ	11,400	838.00	9,553,200
GMOインターネット	41,500	3,345.00	138,817,500
ファイバーゲート	3,700	1,942.00	7,185,400
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	482.00	1,397,800
KADOKAWA	31,300	4,070.00	127,391,000
学研ホールディングス	15,600	1,577.00	24,601,200
ゼンリン	21,000	1,376.00	28,896,000
昭文社ホールディングス	4,400	473.00	2,081,200
インプレスホールディングス	10,000	195.00	1,950,000
東京電力ホールディングス	1,002,300	349.00	349,802,700
中部電力	361,800	1,326.00	479,746,800
関西電力	448,000	1,075.00	481,600,000
中国電力	170,700	1,297.00	221,397,900
北陸電力	108,100	671.00	72,535,100
東北電力	276,800	947.00	262,129,600
四国電力	98,200	750.00	73,650,000
九州電力	261,000	927.00	241,947,000
北海道電力	110,300	461.00	50,848,300

沖縄電力	23,000	1,464.00	33,672,000
電源開発	94,000	1,749.00	164,406,000
エフオン	7,200	1,030.00	7,416,000
イーレックス	17,300	1,735.00	30,015,500
レノバ	19,900	3,255.00	64,774,500
東京瓦斯	227,300	2,256.00	512,788,800
大阪瓦斯	214,100	1,948.00	417,066,800
東邦瓦斯	58,100	6,250.00	363,125,000
北海道瓦斯	6,600	1,594.00	10,520,400
広島ガス	25,400	376.00	9,550,400
西部瓦斯	13,300	2,898.00	38,543,400
静岡ガス	33,500	941.00	31,523,500
メタウォーター	13,400	2,110.00	28,274,000
アイネット	6,000	1,462.00	8,772,000
松竹	7,600	15,730.00	119,548,000
東宝	68,500	4,190.00	287,015,000
エイチ・アイ・エス	16,400	2,500.00	41,000,000
東映	3,800	21,260.00	80,788,000
ラックランド	3,200	2,395.00	7,664,000
エヌ・ティ・ティ・データ	309,000	1,644.00	507,996,000
共立メンテナンス	18,700	3,920.00	73,304,000
イチネンホールディングス	11,800	1,345.00	15,871,000
建設技術研究所	7,300	2,369.00	17,293,700
スペース	7,700	870.00	6,699,000
長 大	4,500	1,572.00	7,074,000
アインホールディングス	16,900	6,970.00	117,793,000
燦ホールディングス	4,700	1,132.00	5,320,400
ピー・シー・エー	1,700	4,125.00	7,012,500
スバル興業	700	7,850.00	5,495,000
東京テアトル	4,600	1,309.00	6,021,400
タナベ経営	2,200	1,400.00	3,080,000
ビジネスブレイン太田昭和	4,000	1,754.00	7,016,000
ナガワ	3,600	9,590.00	34,524,000
東京都競馬	7,300	5,070.00	37,011,000
常磐興産	4,700	1,420.00	6,674,000
カナモト	19,900	2,443.00	48,615,700
D T S	24,000	2,345.00	56,280,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,500	6,310.00	312,345,000
シーイーシー	12,200	1,424.00	17,372,800
カブコン	49,700	6,600.00	328,020,000
西尾レントオール	10,400	2,665.00	27,716,000
アイ・エス・ビー	5,300	1,216.00	6,444,800
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	71,200	28.00	1,993,600
日本空港ビルデング	37,200	5,540.00	206,088,000
トランス・コスモス	10,800	2,760.00	29,808,000
乃村工藝社	48,300	837.00	40,427,100
ジャステック	7,300	1,219.00	8,898,700
S C S K	26,800	6,520.00	174,736,000

藤田観光	4,400	1,913.00	8,417,200
KNT-CTホールディングス	6,000	1,202.00	7,212,000
日本管財	12,200	2,124.00	25,912,800
トーカイ	11,000	2,214.00	24,354,000
白洋舎	1,000	2,374.00	2,374,000
セコム	111,300	9,540.00	1,061,802,000
日本システムウエア	3,800	2,010.00	7,638,000
セントラル警備保障	5,400	3,435.00	18,549,000
アイネス	11,300	1,345.00	15,198,500
丹青社	21,100	853.00	17,998,300
メイテック	13,800	5,610.00	77,418,000
TKC	9,800	6,530.00	63,994,000
富士ソフト	12,300	5,480.00	67,404,000
応用地質	13,200	1,263.00	16,671,600
船井総研ホールディングス	23,100	2,239.00	51,720,900
NSD	37,300	1,880.00	70,124,000
進学会ホールディングス	4,900	481.00	2,356,900
丸紅建材リース	900	1,867.00	1,680,300
オオバ	7,900	747.00	5,901,300
コナミホールディングス	42,100	7,220.00	303,962,000
いであ	2,700	1,694.00	4,573,800
学究社	3,400	1,320.00	4,488,000
ベネッセホールディングス	41,400	2,159.00	89,382,600
イオンディライト	13,900	3,205.00	44,549,500
ナック	5,600	975.00	5,460,000
福井コンピュータホールディングス	5,300	3,460.00	18,338,000
ダイセキ	18,900	3,400.00	64,260,000
ステップ	4,300	1,515.00	6,514,500
日鉄物産	8,300	3,900.00	32,370,000
泉州電業	3,300	3,480.00	11,484,000
元気寿司	3,200	2,619.00	8,380,800
トラスコ中山	26,700	2,625.00	70,087,500
ヤマダホールディングス	390,200	525.00	204,855,000
オートバックスセブン	43,200	1,444.00	62,380,800
モリト	9,000	610.00	5,490,000
アークランドサカモト	18,200	1,601.00	29,138,200
ニトリホールディングス	46,300	20,510.00	949,613,000
グルメ杵屋	8,400	992.00	8,332,800
愛眼	7,600	225.00	1,710,000
ケーユーホールディングス	6,000	895.00	5,370,000
吉野家ホールディングス	38,200	2,138.00	81,671,600
加藤産業	16,900	3,620.00	61,178,000
北恵	3,200	921.00	2,947,200
イノテック	6,600	1,247.00	8,230,200
イエローハット	21,900	1,705.00	37,339,500
松屋フーズホールディングス	5,600	3,665.00	20,524,000
JBCホールディングス	7,800	1,461.00	11,395,800
JKホールディングス	10,700	818.00	8,752,600
サガミホールディングス	15,700	1,167.00	18,321,900
日伝	9,700	2,176.00	21,107,200

関西スーパーマーケット	8,800	1,110.00	9,768,000	
ミロク情報サービス	11,500	2,103.00	24,184,500	
北沢産業	7,300	263.00	1,919,900	
杉本商事	5,900	2,407.00	14,201,300	
因幡電機産業	31,100	2,597.00	80,766,700	
王将フードサービス	7,700	5,840.00	44,968,000	
プレナス	13,200	1,912.00	25,238,400	
ミニストップ	8,700	1,395.00	12,136,500	
アークス	22,100	2,274.00	50,255,400	
バローホールディングス	23,800	2,318.00	55,168,400	
東テク	3,900	2,803.00	10,931,700	
ミスミグループ本社	146,000	3,285.00	479,610,000	
藤久	2,700	712.00	1,922,400	
アルテック	8,800	302.00	2,657,600	
ベルク	5,800	5,550.00	32,190,000	
大 庄	6,300	1,020.00	6,426,000	
タキヒヨー	4,000	1,833.00	7,332,000	
ファーストリテイリング	15,600	109,550.00	1,708,980,000	
ソフトバンクグループ	920,500	10,365.00	9,540,982,500	
葦王産業	1,900	1,382.00	2,625,800	
スズケン	49,300	4,160.00	205,088,000	
サンドラッグ	43,800	4,015.00	175,857,000	
サクスパー ホールディングス	10,000	636.00	6,360,000	
ジェコス	8,200	942.00	7,724,400	
ヤマザワ	2,600	1,722.00	4,477,200	
やまや	2,500	2,229.00	5,572,500	
グローセル	12,900	503.00	6,488,700	
ベルーナ	25,000	1,058.00	26,450,000	
合計	124,234,600		312,247,456,360	

## (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)

2021年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,039,038,638
コール・ローン	936,607,722
株式	458,185,016,827
投資信託受益証券	883,411,784
投資証券	9,283,528,932
派生商品評価勘定	228,698,400
未収入金	1,616,550
未収配当金	542,123,207
差入委託証拠金	3,627,337,513
流動資産合計	480,727,379,573
資産合計	
480,727,379,573	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,408,734
未払解約金	766,856,000
流動負債合計	770,264,734
負債合計	
770,264,734	
純資産の部	
元本等	
元本	101,336,457,716
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	378,620,657,123
元本等合計	479,957,114,839
純資産合計	479,957,114,839
負債純資産合計	480,727,379,573



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年2月25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	88,613,273,386円
同期中追加設定元本額	45,460,337,472円
同期中一部解約元本額	32,737,153,142円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,568,976,213円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,310,337円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	6,547,566円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	6,637,684円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,440,223円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,770,809円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	10,189,467円
たわらノーロード 先進国株式	19,709,883,762円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	222,665,098円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,373,431,097円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	410,571,761円
たわらノーロード バランス(堅実型)	46,019,112円
たわらノーロード バランス(標準型)	354,659,393円
たわらノーロード バランス(積極型)	418,574,940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)	1,077,196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)	132,195,005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)	346,923,677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)	230,210,932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)	346,870,879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)	615,653円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,555,437円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,735,642円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,610,251円
たわらノーロード 全世界株式	86,392,957円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	46,763,773,957円
One DC 先進国株式インデックスファンド	657,554,943円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	183,355,556円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	935,988,345円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,108,633,939円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	112,383,572円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	336,515,401円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	294,453,629円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	26,441,684円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	815,556,610円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	166,641,904円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	203,115,203円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	175,357,524円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	291,398,144円
投資のソムリエ	4,677,116,550円
クルーズコントロール	260,972,802円
投資のソムリエ<DC年金>	287,425,394円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	195,182,908円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	114,819,293円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,099,172円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,162,455円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	109,409,614円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,213,146,637円
ワールドアセットバランス(基本コース)	336,245,295円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,079,892,553円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	12,186,690円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,775,603円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,075,918円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	20,856,320円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	31,875,510円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	690,403,712円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	172,355,461円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	6,274,943円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	3,347,358円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	3,121,904円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,351,478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)	7,183,531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)	8,625,369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)	6,645,402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)	4,481,219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)	256,558,702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)	62,999,746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)	1,444,932,089円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,155,629,355円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	862,705,726円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	11,658,494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)	11,509,799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)	45,642,943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)	82,185,566円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,086,255円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,100,176円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,713,760円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,141,063円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,597,746円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	41,588,722円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	294,890,607円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	409,068,134円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,316,199,459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)	473,643,112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)	72,465,423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)	472,918,712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)	21,255,262円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,736,583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)	201,070,591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)	15,503,133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)	64,425,768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)	102,537,815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)	206,622,935円
計	101,336,457,716円
2. 受益権の総数	101,336,457,716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 2020年2月26日 至 2021年2月25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。リスク管理に関する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	2021年2月25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	2021年2月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,711,116,190

投資信託受益証券	14,818,242
投資証券	62,497,415
合計	2,663,437,017

（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（2021年2月16日から2021年2月25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	2021年2月25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				
アメリカ・ドル	324,232,790	-	324,230,020	2,770
イギリス・ポンド	234,476,550	-	234,476,550	-
オーストラリア・ドル	13,653,640	-	13,653,640	-
カナダ・ドル	18,918,816	-	18,919,040	224
ユーロ	13,725,612	-	13,724,640	972
ユーロ	43,458,172	-	43,456,150	2,022
買建	57,851,525	-	58,242,830	391,305
アメリカ・ドル	37,947,600	-	38,178,000	230,400
イギリス・ポンド	5,956,960	-	6,001,600	44,640
オーストラリア・ドル	1,920,155	-	1,942,580	22,425
カナダ・ドル	2,931,355	-	2,965,200	33,845
ユーロ	9,095,455	-	9,155,450	59,995
合計	382,084,315	-	382,472,850	394,075

（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。

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。

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	2021年2月25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				
合計	10,992,907,757	-	11,217,803,348	224,895,591
合計	10,992,907,757	-	11,217,803,348	224,895,591

## (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)

	2021年2月25日現在
1口当たり純資産額	4.7363円
(1万口当たり純資産額)	(47,363円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2021年2月25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	38,064	3,159.530	120,264,349.920	
	ABBOTT LABORATORIES	158,592	122.380	19,408,488.960	
	AES CORP	56,735	28.000	1,588,580.000	
	ABIOMED INC	3,987	323.780	1,290,910.860	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	79,802	123.210	9,832,404.420	
	ADVANCED MICRO DEVICES	105,311	86.940	9,155,738.340	
	ADOBE INC	42,977	476.620	20,483,697.740	
	CHUBB LTD	40,640	170.660	6,935,622.400	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,854	263.260	5,226,764.040	
	ALLEGHANY CORP	1,263	652.000	823,476.000	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	84.290	510,123.080	
	ALLSTATE CORP	28,381	108.360	3,075,365.160	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	62,786	211.030	13,249,729.580	
	AMGEN INC	52,453	229.990	12,063,665.470	
	HESS CORP	24,776	68.800	1,704,588.800	
	AMERICAN EXPRESS CO	61,615	139.890	8,619,322.350	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	45,017	77.100	3,470,810.700	
	AFLAC INC	58,283	49.850	2,905,407.550	
	AMERICAN INTL GROUP	75,450	45.430	3,427,693.500	
	AMERCO	929	560.610	520,806.690	
ANALOG DEVICES	33,579	161.760	5,431,739.040		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,219	154.490	2,969,143.310		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	65,314	56.100	3,664,115.400		

VALERO ENERGY CORP	37,400	78.160	2,923,184.000	
ANSYS INC	7,970	385.370	3,071,398.900	
APPLE INC	1,528,624	125.350	191,613,018.400	
APPLIED MATERIALS INC	81,851	122.810	10,052,121.310	
ALBEMARLE CORP	9,536	160.900	1,534,342.400	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	51,745	58.480	3,026,047.600	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	73.060	677,850.680	
AMEREN CORP	22,273	71.400	1,590,292.200	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	102.880	684,254.880	
AUTOLIV INC	7,570	90.600	685,842.000	
AUTODESK INC	19,842	298.910	5,930,972.220	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	38,631	176.620	6,823,007.220	
AUTOZONE INC	2,160	1,189.860	2,570,097.600	
AVERY DENNISON CORP	7,627	180.520	1,376,826.040	
BALL CORP	28,847	86.260	2,488,342.220	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	125,078	248.450	31,075,629.100	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	70,298	44.260	3,111,389.480	
BAXTER INTERNATIONAL INC	44,326	78.510	3,480,034.260	
BECTON DICKINSON & CO	26,087	246.710	6,435,923.770	
AMETEK INC	20,008	123.010	2,461,184.080	
VERIZON COMM INC	368,567	57.120	21,052,547.040	
WR BERKLEY CORP	12,511	71.260	891,533.860	
BEST BUY CO INC	21,560	113.460	2,446,197.600	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,859	594.740	1,105,621.660	
YUM! BRANDS INC	27,393	104.680	2,867,499.240	
FIRSTENERGY CORP	47,800	34.250	1,637,150.000	
BOEING CO	48,142	229.340	11,040,886.280	
ROBERT HALF INTL INC	11,111	82.150	912,768.650	
BORGWARNER INC	21,938	46.000	1,009,148.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	129,098	39.530	5,103,243.940	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	90.030	1,055,061.570	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,687	186.990	1,998,362.130	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,208	1,127.600	2,489,740.800	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	201,855	62.590	12,634,104.450	
ONEOK INC	39,284	46.710	1,834,955.640	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,093	112.530	910,705.290	
UNITED RENTALS INC	6,181	312.520	1,931,686.120	
SEMPRA ENERGY	26,113	122.570	3,200,670.410	
FEDEX CORP	22,418	260.060	5,830,025.080	

VERISIGN INC	8,762	195.510	1,713,058.620	
AMPHENOL CORP	26,207	129.550	3,395,116.850	
BROWN-FORMAN CORP	26,085	75.040	1,957,418.400	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	5.990	581,844.640	
CSX CORP	68,659	93.370	6,410,690.830	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	19.200	603,187.200	
CAMPBELL SOUP CO	16,623	46.240	768,647.520	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	74.340	1,460,111.940	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,675	223.930	3,286,172.750	
CARDINAL HEALTH INC	24,718	52.550	1,298,930.900	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	47,145	27.010	1,273,386.450	
CATERPILLAR INC	48,612	222.470	10,814,711.640	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	113.050	1,115,238.250	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	137.000	1,360,821.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	80,424	12.450	1,001,278.800	
CERNER CORP	27,258	70.290	1,915,964.820	
JPMORGAN CHASE & CO	272,545	153.260	41,770,246.700	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,287	79.550	1,693,380.850	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	100.890	1,298,656.080	
CINTAS CORP	8,099	338.310	2,739,972.690	
CISCO SYSTEMS INC	376,958	45.740	17,242,058.920	
CLOROX COMPANY	11,785	183.290	2,160,072.650	
COCA-COLA CO/THE	364,471	50.710	18,482,324.410	
COPART INC	18,628	110.560	2,059,511.680	
COGNEX CORP	14,677	83.720	1,228,758.440	
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,297	76.640	5,464,202.080	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	25,686	157.500	4,045,545.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	226.020	1,175,982.060	
NRG ENERGY, INC.	21,039	38.420	808,318.380	
COMCAST CORP-CL A	408,173	53.400	21,796,438.200	
CONAGRA BRANDS INC	46,145	35.240	1,626,149.800	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,844	66.650	1,989,102.600	
CMS ENERGY CORP	25,936	54.570	1,415,327.520	
COOPER COS INC	5,031	392.570	1,975,019.670	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	47.010	776,276.130	
CORNING INC	71,011	38.630	2,743,154.930	
SEALED AIR CORP	13,870	43.210	599,322.700	
HEICO CORP-CL A	6,236	120.250	749,879.000	
CUMMINS INC	13,718	259.120	3,554,608.160	
DR HORTON INC	32,207	80.050	2,578,170.350	
DANAHER CORP	57,281	223.000	12,773,663.000	
MOODY'S CORP	15,199	278.550	4,233,681.450	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,043	74.930	3,524,931.990	
TARGET CORP	44,986	187.080	8,415,980.880	



DEERE & CO	26,797	345.660	9,262,651.020	
MORGAN STANLEY	121,665	79.880	9,718,600.200	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	89.590	1,714,394.240	
COSTAR GROUP INC	3,438	836.230	2,874,958.740	
THE WALT DISNEY CO	161,966	197.510	31,989,904.660	
DOLLAR TREE INC	21,916	101.130	2,216,365.080	
DOVER CORP	12,652	125.500	1,587,826.000	
OMNICOM GROUP	19,663	70.880	1,393,713.440	
DTE ENERGY CO	17,793	123.900	2,204,552.700	
DUKE ENERGY CORP	64,205	87.340	5,607,664.700	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,902	138.780	1,512,979.560	
EBAY INC	61,491	59.380	3,651,335.580	
BANK OF AMERICA CORP	697,637	36.380	25,380,034.060	
CITIGROUP INC	186,717	68.600	12,808,786.200	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,229	113.370	1,386,401.730	
EATON CORP PLC	36,497	132.680	4,842,421.960	
CADENCE DESIGN SYS INC	24,639	139.420	3,435,169.380	
DISH NETWORK CORP	21,420	31.400	672,588.000	
ECOLAB INC	23,050	216.190	4,983,179.500	
PERKINELMER INC	9,755	128.780	1,256,248.900	
ELECTRONIC ARTS INC	25,142	137.680	3,461,550.560	
SALESFORCE.COM INC	81,512	240.470	19,601,190.640	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	244.120	547,561.160	
EMERSON ELECTRIC CO	52,299	88.970	4,653,042.030	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	88.670	1,019,971.010	
ENTERGY CORP	17,195	89.970	1,547,034.150	
EOG RESOURCES INC	54,041	72.370	3,910,947.170	
EQUIFAX INC	10,322	170.700	1,761,965.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	20,215	294.340	5,950,083.100	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	13,942	92.060	1,283,500.520	
EXXON MOBIL CORP	378,944	56.700	21,486,124.800	
FMC CORP	11,416	104.970	1,198,337.520	
NEXTERA ENERGY INC	175,242	73.760	12,925,849.920	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	300.940	976,851.240	
FAIR ISAAC CORP	2,482	465.060	1,154,278.920	
ASSURANT INC	5,523	128.130	707,661.990	
FASTENAL CO	50,482	46.900	2,367,605.800	
FIFTH THIRD BANCORP	63,646	36.250	2,307,167.500	
M&T BANK CORP	11,432	162.130	1,853,470.160	
FISERV INC	51,404	119.070	6,120,674.280	
FORD MOTOR CO	342,319	12.270	4,200,254.130	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	27.930	662,304.090	
FREEMPORT-MCMORAN INC	126,973	37.890	4,811,006.970	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	123.790	2,218,564.380	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	54.000	992,844.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,599	168.060	3,629,927.940	
GENERAL MILLS INC	53,866	56.200	3,027,269.200	
GENUINE PARTS CO	13,393	106.310	1,423,809.830	

GILEAD SCIENCES INC	113,010	63.710	7,199,867.100	
GARTNER INC	7,522	183.160	1,377,729.520	
MCKESSON CORP	14,289	181.290	2,590,452.810	
NVIDIA CORP	55,238	579.960	32,035,830.480	
GENERAL ELECTRIC CO	785,777	13.120	10,309,394.240	
VW GRAINGER INC	4,234	385.570	1,632,503.380	
HALLIBURTON CO	77,483	22.270	1,725,546.410	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,568	88.240	3,050,280.320	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,378	330.640	9,713,541.920	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,969	191.380	3,630,287.220	
HASBRO INC	11,383	90.910	1,034,828.530	
HENRY SCHEIN INC	11,516	65.010	748,655.160	
HEICO CORP	3,623	133.040	482,003.920	
HERSHEY FOODS CORP	13,622	147.570	2,010,198.540	
HP INC	125,184	27.970	3,501,396.480	
F5 NETWORKS INC	5,529	189.500	1,047,745.500	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,024	99.090	1,191,458.160	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	23.750	663,551.250	
HOLOGIC INC	24,009	75.150	1,804,276.350	
HOME DEPOT INC	96,381	259.970	25,056,168.570	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	83.320	1,357,116.160	
HORMEL FOODS CORP	26,254	46.880	1,230,787.520	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	20.810	1,021,042.650	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	290.520	846,284.760	
HUMANA INC	11,937	381.400	4,552,771.800	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	146.660	1,106,403.040	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,857	16.220	1,522,360.540	
BIOGEN INC	14,418	282.740	4,076,545.320	
IDEX CORP	7,294	197.930	1,443,701.420	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,580	203.450	5,611,151.000	
INTUIT INC	23,397	413.180	9,667,172.460	
IDEXX LABORATORIES INC	7,782	532.880	4,146,872.160	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	56.210	616,061.600	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,891	155.350	3,400,766.850	
INTEL CORP	380,257	63.190	24,028,439.830	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,906	138.150	2,750,013.900	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,983	50.800	1,624,736.400	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	27.000	953,559.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,033	119.750	1,321,201.750	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	151.640	1,042,373.360	

INCYTE CORP	15,942	80.610	1,285,084.620	
JOHNSON & JOHNSON	235,155	162.590	38,233,851.450	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	33,476	53.150	1,779,249.400	
KLA CORPORATION	14,130	328.430	4,640,715.900	
DEVON ENERGY CORP	56,014	22.270	1,247,431.780	
KELLOGG CO	21,954	58.610	1,286,723.940	
KEYCORP	87,597	21.540	1,886,839.380	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,861	130.810	4,036,927.410	
BLACKROCK INC/NEW YORK	13,668	712.100	9,732,982.800	
KROGER CO	71,262	32.750	2,333,830.500	
LAM RESEARCH CORP	13,086	596.900	7,811,033.400	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	390.820	1,290,487.640	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	133.430	1,125,882.340	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	97.540	1,380,483.620	
LENNAR CORP	25,881	86.250	2,232,236.250	
ELI LILLY & CO	77,111	204.520	15,770,741.720	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	59.400	1,074,546.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	63,318	160.070	10,135,312.260	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,452	125.020	3,557,069.040	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,505	346.530	7,798,657.650	
LOEWS CORP	21,759	50.380	1,096,218.420	
LOWE'S COS INC	67,992	162.310	11,035,781.520	
DOMINION ENERGY INC	73,373	71.170	5,221,956.410	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	45,850	38.630	1,771,185.500	
MCCORMICK & CO INC	21,514	84.800	1,824,387.200	
MCDONALD'S CORPORATION	66,419	213.270	14,165,180.130	
S&P GLOBAL INC	21,572	331.790	7,157,373.880	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	244.720	835,963.520	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,115.630	1,339,871.630	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	56,191	84.450	4,745,329.950	
MARSH & MCLENNAN COS	44,208	119.020	5,261,636.160	
MASCO CORP	23,151	53.810	1,245,755.310	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,258	347.570	1,827,523.060	
METLIFE INC	67,999	59.560	4,050,020.440	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,591	96.750	2,282,429.250	
MEDTRONIC PLC	120,014	118.740	14,250,462.360	
ACTIVISION BLIZZARD INC	69,643	95.690	6,664,138.670	
CVS HEALTH CORP	117,545	70.400	8,275,168.000	
MERCK & CO. INC.	225,706	74.570	16,830,896.420	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	36,651	40.660	1,490,229.660	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,588	244.500	2,099,766.000	
MICROSOFT CORP	642,529	234.550	150,705,176.950	
MICRON TECH INC	99,960	92.520	9,248,299.200	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,894	157.250	3,442,831.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	61,287	49.260	3,018,997.620	
3M CO	51,539	177.630	9,154,872.570	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	182.980	910,508.480	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,006	181.080	2,717,286.480	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	218.810	1,826,188.260	
ILLUMINA INC	13,134	461.050	6,055,430.700	
XCEL ENERGY INC	46,591	60.210	2,805,244.110	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	110.610	891,295.380	
NETAPP INC	19,804	71.570	1,417,372.280	
NEWELL BRANDS INC	33,317	24.390	812,601.630	
NEWMONT CORP	72,665	57.080	4,147,718.200	
NVR INC	305	4,699.970	1,433,490.850	
NIKE INC-CL B	111,609	135.650	15,139,760.850	
NORDSON CORP	4,644	196.740	913,660.560	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,957	261.780	6,009,683.460	
EVERSOURCE ENERGY	30,569	80.110	2,448,882.590	
NISOURCE INC	31,427	22.180	697,050.860	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	100.270	1,741,188.550	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,698	301.730	4,133,097.540	
WELLS FARGO & CO	350,346	38.290	13,414,748.340	
NUCOR CORP	28,860	63.030	1,819,045.800	
CHENIERE ENERGY INC	19,190	70.050	1,344,259.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,751	124.480	5,197,164.480	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	85,206	28.160	2,399,400.960	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,712	217.310	1,893,204.720	
OGE ENERGY CORP	16,028	31.160	499,432.480	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,576	455.870	2,997,801.120	
ORACLE CORP	178,261	64.700	11,533,486.700	
PACCAR INC	30,446	94.280	2,870,448.880	
PTC INC	9,433	142.330	1,342,598.890	
EXELON CORP	85,323	40.190	3,429,131.370	
PARKER HANNIFIN CORP	11,900	297.070	3,535,133.000	
PAYCHEX INC	29,842	93.360	2,786,049.120	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,529	573.260	3,742,814.540	
PPL CORPORATION	71,320	27.490	1,960,586.800	
PEPSICO INC	123,516	132.090	16,315,228.440	
PENTAIR PLC	15,564	57.150	889,482.600	
PFIZER INC	497,181	33.750	16,779,858.750	
ESSENTIAL UTILITIES INC	22,937	44.090	1,011,292.330	

CONOCOPHILLIPS	123,391	54.670	6,745,785.970	
PG&E CORP	123,999	11.410	1,414,828.590	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,144	150.060	2,722,688.640	
ALTRIA GROUP INC	167,374	45.000	7,531,830.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,289	178.480	6,833,820.720	
BROWN & BROWN INC	20,308	47.790	970,519.320	
GARMIN LTD	12,365	128.450	1,588,284.250	
PPG INDUSTRIES INC	20,685	136.890	2,831,569.650	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	231.080	774,811.240	
COSTCO WHOLESALE CORP	39,444	340.700	13,438,570.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,007	166.230	3,325,763.610	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	115.740	1,380,315.240	
PROCTER & GAMBLE CO	222,379	127.660	28,388,903.140	
PROGRESSIVE CORP	52,887	87.740	4,640,305.380	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	44,503	56.050	2,494,393.150	
PULTE GROUP INC	24,305	46.920	1,140,390.600	
GLOBAL PAYMENTS INC	27,125	204.270	5,540,823.750	
QUALCOMM INC	101,000	141.100	14,251,100.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	122.650	1,317,751.600	
EXACT SCIENCES CORP	13,911	134.820	1,875,481.020	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,052	164.950	668,377.400	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,504	458.600	4,358,534.400	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	127.390	776,696.830	
RESMED INC	13,286	200.970	2,670,087.420	
US BANCORP	122,662	52.810	6,477,780.220	
SEAGEN INC	10,296	155.020	1,596,085.920	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,383	35.565	1,222,831.390	
ROSS STORES INC	31,197	123.610	3,856,261.170	
ROLLINS INC	18,567	35.460	658,385.820	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,127	378.820	3,457,490.140	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,718	247.040	2,647,774.720	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,879	96.660	1,534,864.140	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	81.180	893,304.720	
ACCENTURE PLC-CL A	56,870	259.270	14,744,684.900	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	127,863	54.330	6,946,796.790	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,794	225.640	2,661,198.160	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	22,148	150.960	3,343,462.080	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	55,729	139.440	7,770,851.760	

BOOKING HOLDINGS INC	3,687	2,443.500	9,009,184.500	
SCHLUMBERGER LTD	130,940	29.410	3,850,945.400	
SCHWAB (CHARLES) CORP	137,629	64.440	8,868,812.760	
POOL CORP	3,532	328.390	1,159,873.480	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,187	163.690	2,977,030.030	
BUNGE LTD	13,304	76.760	1,021,215.040	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	57.980	617,660.940	
ANTHEM INC	22,607	305.790	6,912,994.530	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,836	105.200	1,455,547.200	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,038	60.450	1,513,547.100	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,388	682.030	5,038,837.640	
CENTENE CORP	50,990	59.350	3,026,256.500	
SVB FINANCIAL GROUP	4,532	540.130	2,447,869.160	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	61.300	695,816.300	
SNAP-ON INC	4,825	206.820	997,906.500	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,226	89.910	3,346,989.660	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	166.150	1,034,449.900	
EDISON INTERNATIONAL	35,041	56.470	1,978,765.270	
SOUTHERN CO	92,398	58.380	5,394,195.240	
TRUIST FINANCIAL CORP	121,555	60.170	7,313,964.350	
SOUTHWEST AIRLINES	11,791	59.290	699,088.390	
AT&T INC	636,397	29.380	18,697,343.860	
CHEVRON CORP	172,163	103.310	17,786,159.530	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,026	174.980	2,454,269.480	
STATE STREET CORP	32,404	76.820	2,489,275.280	
STARBUCKS CORP	104,903	104.380	10,949,775.140	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	43.860	769,611.420	
STRYKER CORP	30,436	248.820	7,573,085.520	
NETFLIX INC	39,498	553.410	21,858,588.180	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	20.550	1,006,025.250	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	43.630	427,268.590	
SYNOPSIS INC	13,381	260.680	3,488,159.080	
SYSCO CORP	42,171	80.980	3,415,007.580	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,544	758.710	7,999,838.240	
TELEFLEX INC	4,002	400.390	1,602,360.780	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	11.320	999,805.040	
TERADYNE INC	14,284	134.190	1,916,769.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	81,850	179.390	14,683,071.500	
TEXTRON INC	19,486	53.480	1,042,111.280	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35,462	456.660	16,194,076.920	
GLOBE LIFE INC	10,578	98.320	1,040,028.960	
DAVITA INC	6,497	102.890	668,476.330	

TRACTOR SUPPLY CO	10,462	161.080	1,685,218.960	
TRIMBLE INC	22,442	76.050	1,706,714.100	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,473	473.190	1,643,388.870	
TYSON FOODS INC	24,980	68.870	1,720,372.600	
UGI CORP	20,072	40.180	806,492.960	
UNION PACIFIC CORP	60,564	211.150	12,788,088.600	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	137,210	77.670	10,657,100.700	
UNITEDHEALTH GROUP INC	84,987	332.210	28,233,531.270	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	137.940	848,744.820	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,139	175.800	1,430,836.200	
VF CORP	28,712	81.960	2,353,235.520	
VIACOMCBS INC	49,363	65.600	3,238,212.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,938	217.040	5,195,503.520	
VULCAN MATERIALS CO	12,170	174.150	2,119,405.500	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66,871	49.170	3,288,047.070	
WALMART INC	126,414	133.210	16,839,608.940	
WASTE MANAGEMENT INC	38,357	111.870	4,290,997.590	
WATERS CORP	5,211	279.900	1,458,558.900	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,009	278.920	1,954,950.280	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,306	113.220	1,166,845.320	
VAIL RESORTS INC	3,590	319.720	1,147,794.800	
WESTERN DIGITAL CORP	25,867	70.530	1,824,399.510	
WABTEC CORP	16,257	74.740	1,215,048.180	
WHIRLPOOL CORP	5,656	193.520	1,094,549.120	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,331	190.360	2,918,409.160	
WYNN RESORTS LTD	8,639	134.210	1,159,440.190	
NASDAQ INC	10,097	141.990	1,433,673.030	
CME GROUP INC	32,180	200.700	6,458,526.000	
WILLIAMS COS INC	112,535	23.910	2,690,711.850	
LKQ CORP	23,691	39.980	947,166.180	
ALLIANT ENERGY CORP	22,829	47.530	1,085,062.370	
WEC ENERGY GROUP INC	29,002	81.930	2,376,133.860	
CARMAX INC	14,209	121.840	1,731,224.560	
XILINX INC	21,400	133.810	2,863,534.000	
TJX COMPANIES INC	108,150	69.860	7,555,359.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,561	512.690	2,338,379.090	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.720	513,064.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	53.720	1,106,632.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	26.070	445,797.000	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,239	151.590	1,552,130.010	
CBRE GROUP INC	29,617	77.180	2,285,840.060	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	24.900	317,026.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	85,582	22.210	1,900,776.220	
DOMINO'S PIZZA INC	3,641	364.590	1,327,472.190	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,737	387.860	1,449,432.820	
T-MOBILE US INC	49,980	119.380	5,966,612.400	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,277	64.810	1,962,252.370	
MOSAIC CO/THE	32,592	32.120	1,046,855.040	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,209	545.460	1,750,381.140	
CELANESE CORP	11,588	141.210	1,636,341.480	
DEXCOM INC	8,706	405.640	3,531,501.840	
DISCOVERY INC-A	15,362	51.860	796,673.320	
EXPEDIA GROUP INC	11,508	162.780	1,873,272.240	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	48.610	898,069.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,614	232.100	2,463,509.400	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	24.830	844,791.090	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,785	111.460	5,437,576.100	
LIVE NATION	13,804	90.490	1,249,123.960	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,326	1,449.060	3,370,513.560	
TRANSDIGM GROUP INC	4,745	609.150	2,890,416.750	
MASTERCARD INC	79,824	367.320	29,320,951.680	
WESTERN UNION CO	35,367	23.790	841,380.930	
OWENS CORNING	9,965	83.210	829,187.650	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	90.380	1,162,829.080	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	20.750	360,012.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,959	145.080	1,444,851.720	
DELTA AIR LINES INC	14,723	49.600	730,260.800	
INSULET CORP	5,566	262.360	1,460,295.760	
DISCOVER FINANCIAL	26,975	97.960	2,642,471.000	
TE CONNECTIVITY LTD	28,930	130.720	3,781,729.600	
MASIMO CORP	4,505	251.200	1,131,656.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,817	317.700	3,436,560.900	
VMWARE INC	7,464	146.760	1,095,416.640	
MERCADOLIBRE INC	4,041	1,714.000	6,926,274.000	
ULTA BEAUTY INC	4,538	334.080	1,516,055.040	
INVESCO LTD	33,443	23.260	777,884.180	
MSCI INC	7,617	417.230	3,178,040.910	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	139,270	87.560	12,194,481.200	
VISA INC	150,580	219.430	33,041,769.400	



KEURIG DR PEPPER INC	48,480	31.460	1,525,180.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,915	149.940	2,536,235.100	
DISCOVERY INC-C	30,421	43.530	1,324,226.130	
MARATHON PETROLEUM CORP	59,587	56.650	3,375,603.550	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	87.250	1,024,664.000	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	185,992	15.720	2,923,794.240	
XYLEM INC	17,222	101.090	1,740,971.980	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	107.330	2,644,181.880	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	188.100	655,340.400	
SPLUNK INC	14,641	152.530	2,233,191.730	
EPAM SYSTEMS INC	5,333	369.260	1,969,263.580	
ZILLOW GROUP INC	5,366	172.220	924,132.520	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	51.010	755,662.140	
HCA HEALTHCARE INC	23,631	175.430	4,145,586.330	
VERISK ANALYTICS INC	13,644	167.530	2,285,779.320	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,257	173.500	912,089.500	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,806	290.190	2,265,223.140	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	14,986	178.230	2,670,954.780	
NXP SEMICONDUCTOR NV	24,375	186.210	4,538,868.750	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	78.000	910,026.000	
LEAR CORP	4,681	168.230	787,484.630	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,472	100.380	1,051,179.360	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	68.980	1,396,362.140	
DOLLAR GENERAL CORP	21,825	192.610	4,203,713.250	
FORTINET INC	12,146	169.850	2,062,998.100	
HORIZON PHARMA PLC	18,986	95.480	1,812,783.280	
TESLA INC	66,704	742.020	49,495,702.080	
GENERAC HOLDINGS INC	5,402	322.680	1,743,117.360	
ENPHASE ENERGY INC	10,163	180.870	1,838,181.810	
GENERAL MOTORS CO	116,431	52.900	6,159,199.900	
XPO LOGISTICS INC	7,614	118.130	899,441.820	
ALLY FINANCIAL INC	33,857	42.690	1,445,355.330	
VOYA FINANCIAL INC	13,503	61.490	830,299.470	
APTIV PLC	23,697	155.220	3,678,248.340	
PHILLIPS 66	39,951	87.250	3,485,724.750	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	119.510	857,125.720	
FACEBOOK INC	215,014	264.310	56,830,350.340	
IQVIA HOLDINGS INC	16,896	194.590	3,287,792.640	
SERVICENOW INC	17,289	551.830	9,540,588.870	

PALO ALTO NETWORKS INC	8,460	369.610	3,126,900.600	
WORKDAY INC	15,526	262.780	4,079,922.280	
ABBVIE INC	158,152	108.690	17,189,540.880	
ZOETIS INC	42,660	159.050	6,785,073.000	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	23.810	720,562.030	
CDW CORP	12,768	162.100	2,069,692.800	
HOWMET AEROSPACE INC	38,127	30.140	1,149,147.780	
TWILIO INC	11,900	408.960	4,866,624.000	
COUPA SOFTWARE INC	6,246	348.260	2,175,231.960	
SNAP INC	82,223	69.470	5,712,031.810	
TRADE DESK INC A	3,648	781.040	2,849,233.920	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	19,546	45.500	889,343.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	45.820	381,405.680	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	45.430	645,333.150	
OKTA INC	10,651	269.900	2,874,704.900	
BLACK KNIGHT INC	13,042	78.360	1,021,971.120	
BAKER HUGHES CO	57,274	25.150	1,440,441.100	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	83.590	1,101,799.790	
ALTICE USA INC-A	21,506	33.800	726,902.800	
BROADCOM INC	36,027	480.880	17,324,663.760	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,799	388.200	2,639,371.800	
MONGODB INC	4,188	398.140	1,667,410.320	
BURLINGTON STORES INC	5,602	269.630	1,510,467.260	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	31.550	1,130,247.200	
VEEVA SYSTEMS INC	11,832	291.140	3,444,768.480	
TWITTER INC	69,005	71.920	4,962,839.600	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	59.370	784,515.180	
EVERGY INC	21,039	54.550	1,147,677.450	
ALLEGION PLC	9,022	109.330	986,375.260	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	90.170	1,032,807.180	
STERIS PLC	7,390	173.110	1,279,282.900	
DOCUSIGN INC	15,247	239.660	3,654,096.020	
WIX.COM LTD	4,918	351.170	1,727,054.060	
DROPBOX INC	28,170	22.920	645,656.400	
KKR & CO INC	47,267	45.440	2,147,812.480	
PERRIGO CO PLC	10,553	41.660	439,637.980	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	15,578	385.230	6,001,112.940	
MODERNA INC	24,031	144.790	3,479,448.490	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	25,878	127.260	3,293,234.280	
ARAMARK	18,632	39.600	737,827.200	
CIGNA CORP	33,116	214.940	7,117,953.040	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,586	81.690	1,681,670.340	
DOW INC	64,707	63.690	4,121,188.830	
AMCOR PLC	146,149	11.410	1,667,560.090	
PINTEREST INC	42,097	84.170	3,543,304.490	

PELTON INTERACTIVE INC	17,870	122.720	2,193,006.400	
FOX CORP-A	31,751	34.040	1,080,804.040	
FOX CORP-B	13,009	32.740	425,914.660	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	13,078	216.600	2,832,694.800	
CHEWY INC	6,586	105.230	693,044.780	
AVANTOR INC	44,509	27.940	1,243,581.460	
DYNATRACE INC	15,949	51.860	827,115.140	
CLOUDFLARE INC	13,218	76.430	1,010,251.740	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	70.630	499,000.950	
CARRIER GLOBAL CORP	75,077	37.450	2,811,633.650	
OTIS WORLDWIDE CORP	37,535	64.350	2,415,377.250	
UBER TECHNOLOGIES INC	83,827	53.910	4,519,113.570	
CORTEVA INC	68,639	46.410	3,185,535.990	
MATCH GROUP INC	21,566	160.790	3,467,597.140	
SLACK TECHNOLOGIES INC	32,512	42.350	1,376,883.200	
BLACKSTONE GROUP INC	58,587	69.860	4,092,887.820	
CARLYLE GROUP INC	12,509	35.590	445,195.310	
10X GENOMICS INC	5,312	179.430	953,132.160	
DATADOG INC	13,021	99.360	1,293,766.560	
INGERSOLL RAND INC	31,282	48.100	1,504,664.200	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	386.970	1,675,580.100	
PPD INC	10,828	35.330	382,553.240	
AON PLC	20,807	233.700	4,862,595.900	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	247.360	1,747,351.040	
ZENDESK INC	10,021	150.160	1,504,753.360	
ROYALTY PHARMA PLC	10,361	47.200	489,039.200	
VIATRIS INC	112,866	15.300	1,726,849.800	
DRAFTKINGS INC	14,671	60.280	884,367.880	
SNOWFLAKE INC	2,805	273.520	767,223.600	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	286.360	1,443,827.120	
IHS MARKIT LTD	34,411	91.160	3,136,906.760	
FNF GROUP	24,567	41.310	1,014,862.770	
CATALENT INC	14,673	115.150	1,689,595.950	
SYNCHRONY FINANCIAL	45,491	40.220	1,829,648.020	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	41,503	46.380	1,924,909.140	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	152.540	527,330.780	
WAYFAIR INC	5,543	258.130	1,430,814.590	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,407	143.640	2,500,341.480	
HUBSPOT INC	3,741	518.730	1,940,568.930	
QORVO INC	10,168	179.150	1,821,597.200	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,947	143.350	422,452.450	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	13,189	147.840	1,949,861.760	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	28.620	487,055.160	

	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,257	308.150	1,311,794.550	
	GODADDY INC	14,540	81.520	1,185,300.800	
	ETSY INC	10,237	209.100	2,140,556.700	
	TRANSUNION	16,760	87.780	1,471,192.800	
	SQUARE INC	33,506	237.320	7,951,643.920	
	DUPONT DE NEMOURS INC	47,757	71.680	3,423,221.760	
	CARVANA CO	5,347	284.940	1,523,574.180	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	18,296	53.710	982,678.160	
	TELADOC HEALTH INC	10,454	254.530	2,660,856.620	
	WESTROCK CO	22,778	44.870	1,022,048.860	
	KRAFT HEINZ CO	56,879	37.600	2,138,650.400	
	NOVOCURE LTD	7,408	173.130	1,282,547.040	
	FORTIVE CORP	25,981	67.640	1,757,354.840	
	WASTE CONNECTIONS INC	24,778	98.630	2,443,854.140	
	ALPHABET INC-CL A	26,900	2,083.810	56,054,489.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	116,257	14.840	1,725,253.880	
	PAYPAL HOLDINGS INC	100,053	266.070	26,621,101.710	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	30.730	1,084,062.210	
	SUNRUN INC	10,000	62.560	625,600.000	
	ZILLOW GROUP INC-C	13,376	164.280	2,197,409.280	
	ALPHABET INC-CL C	26,796	2,095.170	56,142,175.320	
	ZSCALER INC	6,193	207.810	1,286,967.330	
	CABLE ONE INC	392	2,010.900	788,272.800	
	LINDE PLC	47,049	254.610	11,979,145.890	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	47.780	566,049.660	
	ROKU INC	9,587	413.790	3,967,004.730	
	AVALARA INC	7,102	162.970	1,157,412.940	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,932	608.510	7,869,251.320	
	VISTRA CORP	38,032	23.830	906,302.560	
アメリカ・ドル	小計	27,849,128		3,095,738,825.380 (328,334,059,823)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	18.285	581,426.430	
	ASHTED GROUP	38,916	40.570	1,578,822.120	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	22.230	487,570.590	
	BHP GROUP PLC	184,454	23.240	4,286,710.960	
	BARCLAYS PLC	1,608,889	1.645	2,646,622.400	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	6.948	571,702.280	
	BT GROUP PLC	795,507	1.306	1,038,932.140	
	BUNZL PLC	28,834	22.600	651,648.400	
	AVIVA PLC	363,464	3.729	1,355,357.250	
	CRODA INTERNATIONAL	12,568	62.700	788,013.600	
	DIAGEO PLC	209,647	29.450	6,174,104.150	
	SCHRODERS PLC	11,354	36.240	411,468.960	
	DCC PLC	7,898	59.300	468,351.400	

NATIONAL GRID PLC	306,881	8.286	2,542,815.960	
KINGFISHER PLC	197,159	2.663	525,034.410	
BAE SYSTEMS PLC	273,749	4.960	1,357,795.040	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	206,585	25.845	5,339,189.320	
HALMA PLC	31,901	23.640	754,139.640	
NEXT PLC	11,467	76.880	881,582.960	
IMPERIAL BRANDS PLC	87,708	14.000	1,227,912.000	
JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	31.900	609,513.300	
ANGLO AMERICAN PLC	107,554	28.415	3,056,146.910	
COMPASS GROUP PLC	156,443	14.935	2,336,476.200	
HSBC HOLDINGS PLC	1,825,585	4.293	7,837,236.400	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	514,692	2.743	1,411,800.150	
UNILEVER PLC	235,136	38.390	9,026,871.040	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.716	395,043.790	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	8.836	598,320.900	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	95,487	6.754	644,919.190	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	24.370	759,515.420	
PEARSON PLC	65,009	7.526	489,257.730	
PERSIMMON PLC	28,126	27.640	777,402.640	
PRUDENTIAL PLC	226,896	14.310	3,246,881.760	
RIO TINTO PLC	101,008	63.550	6,419,058.400	
VODAFONE GROUP PLC	2,423,237	1.255	3,041,162.430	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	64,558	58.820	3,797,301.560	
RELX PLC	174,163	17.135	2,984,283.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	4.700	797,900.200	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	670,969	1.119	750,814.310	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.865	788,995.710	
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	12.280	611,408.920	
SSE PLC	88,646	13.850	1,227,747.100	
BP PLC	1,838,294	2.988	5,492,822.470	
SAGE GROUP PLC(THE)	108,448	5.740	622,491.520	
SMITHS GROUP PLC	40,317	15.220	613,624.740	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	109.250	718,209.500	
STANDARD CHARTERED PLC	240,093	5.094	1,223,033.740	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,495,356	0.393	2,552,674.900	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.666	577,758.800	
TESCO PLC	679,368	2.278	1,547,600.300	
3I GROUP PLC	88,651	11.420	1,012,394.420	
SMITH & NEPHEW PLC	76,928	14.340	1,103,147.520	
GLAXOSMITHKLINE PLC	449,985	12.130	5,458,318.050	

LONDON STOCK EXCHANGE PLC	27,589	95.800	2,643,026.200		
WPP PLC	111,598	8.726	973,804.140		
ASTRAZENECA PLC	117,551	71.200	8,369,631.200		
WHITBREAD PLC	18,594	35.650	662,876.100		
INTERTEK GROUP PLC	13,842	54.700	757,157.400		
BURBERRY GROUP PLC	38,950	18.515	721,159.250		
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	51.500	857,578.000		
SAINSBURY (J) PLC	190,205	2.293	436,140.060		
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	30.910	491,252.630		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,581	43.170	499,951.770		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	377,776	14.816	5,597,129.210		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	323,858	14.288	4,627,283.100		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,200	24.170	439,894.000		
AVEVA GROUP PLC	10,408	35.060	364,904.480		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	3.267	674,024.570		
EXPERIAN PLC	80,376	23.300	1,872,760.800		
MONDI PLC	47,170	18.020	850,003.400		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	15.450	432,769.950		
FRESNILLO PLC NPR	17,385	9.658	167,904.330		
OCADO GROUP PLC	42,789	22.870	978,584.430		
INFORMA PLC	149,358	5.508	822,663.860		
GLENCORE PLC	880,408	3.025	2,663,234.200		
ENTAIN PLC	49,618	14.390	714,003.020		
EVRAZ PLC	48,765	5.648	275,424.720		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.185	358,930.390		
COCA-COLA HBC AG	15,208	22.940	348,871.520		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,721	7.210	372,908.410		
FERGUSON PLC	20,531	87.740	1,801,389.940		
M&G PLC	204,940	1.905	390,410.700		
JD SPORTS FASHION PLC	32,086	8.508	272,987.680		
AUTO TRADER GROUP PLC	98,062	5.780	566,798.360		
MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.763	748,702.020		
イギリス・ボンド 小計	26,454,927		147,953,492.870 (22,200,421,605)		
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	23.470	2,402,365.730	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	20.170	2,636,279.510	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	442.000	777,920.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	12.510	1,277,696.340	
	ICL GROUP LTD	49,411	19.110	944,244.210	
	NICE LTD	5,535	751.000	4,156,785.000	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	79.860	834,057.840	
	AZRIELI GROUP	4,414	208.000	918,112.000	
イスラエル・シュケル 小計		406,760		13,947,460.630 (453,292,470)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	63.280	1,066,521.120	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	257,713	26.630	6,862,897.190	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	318,022	24.050	7,648,429.100	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	153,517	24.480	3,758,096.160	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.130	1,140,600.170	
	AMP LTD	302,414	1.375	415,819.250	
	ASX LTD	19,162	68.220	1,307,231.640	
	BHP GROUP LTD	263,749	48.860	12,886,776.140	
	AMPOL LTD	20,946	25.580	535,798.680	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	13.250	504,030.000	
	CSL LIMITED	40,766	267.960	10,923,657.360	
	REA GROUP LTD	5,745	141.940	815,445.300	
	TRANSURBAN GROUP	250,816	12.930	3,243,050.880	
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,693	13.380	705,032.340	
	COCHLEAR LTD	5,533	210.290	1,163,534.570	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,860	4.610	612,484.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	158,940	82.780	13,157,053.200	
	RIO TINTO LIMITED	33,859	126.450	4,281,470.550	
	APA GROUP	118,205	9.330	1,102,852.650	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	32.360	1,673,562.120	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	5.030	1,132,655.400	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.020	201,607.380	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,839	37.880	1,509,101.320	
	ORICA LTD	41,311	15.030	620,904.330	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	21.510	187,330.590	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	12.920	802,538.720	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,693	16.850	837,327.050	
	SYDNEY AIRPORT	116,056	6.080	705,620.480	
	MACQUARIE GROUP LTD	29,821	146.900	4,380,704.900	
	SUNCORP GROUP LTD	117,454	10.090	1,185,110.860	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	299,819	24.900	7,465,493.100	
	NEWCREST MINING LTD	73,202	25.300	1,852,010.600	
OIL SEARCH LTD	197,895	4.240	839,074.800		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	5.010	312,032.820		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	144,868	9.420	1,364,656.560		

	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93,404	10.460	977,005.840	
	SANTOS LTD	159,618	7.120	1,136,480.160	
	SONIC HEALTHCARE	40,148	32.860	1,319,263.280	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	29.600	248,817.600	
	TABCORP HOLDINGS LTD	205,649	4.480	921,307.520	
	WESFARMERS LTD	101,575	50.380	5,117,348.500	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	24.770	2,135,074.920	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	111,703	39.500	4,412,268.500	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	45.340	453,173.300	
	SEEK LTD	35,836	25.990	931,377.640	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.665	274,834.890	
	AGL ENERGY LTD	49,076	9.620	472,111.120	
	BRAMBLES LTD	127,166	9.970	1,267,845.020	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	10.000	328,610.000	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.290	604,735.560	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.950	593,092.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	11.160	643,563.720	
	XERO LTD	10,498	116.330	1,221,232.340	
	AFTERPAY LTD	18,322	134.360	2,461,743.920	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	2.790	789,999.660	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.800	1,154,566.000	
	COLES GROUP LTD	121,032	15.990	1,935,301.680	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	29.850	406,079.400	
オーストラリア・ドル	小計	6,537,359		127,006,345.000 (10,728,225,962)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,578	77.140	1,587,386.920	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	78,479	37.820	2,968,075.780	
	BARRICK GOLD CORP	155,961	25.150	3,922,419.150	
	ATCO LTD	7,193	37.610	270,528.730	
	BANK OF MONTREAL	58,493	107.800	6,305,545.400	
	BANK OF NOVA SCOTIA	109,436	76.320	8,352,155.520	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,132	79.480	2,315,411.360	
	BCE INC	14,959	54.810	819,902.790	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	115,924	55.300	6,410,597.200	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	38.930	1,097,514.560	
	SAPUTO INC	25,395	36.230	920,060.850	
	BLACKBERRY LTD	46,671	14.150	660,394.650	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	56,193	20.250	1,137,908.250	
	CGI INC	19,859	95.950	1,905,471.050	
	CCL INDUSTRIES INC	15,358	65.310	1,003,030.980	
	CAE INC	25,006	34.190	854,955.140	
	CAMECO CORP	32,627	20.230	660,044.210	



ROGERS COMM-CL B	31,543	55.100	1,738,019.300	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	40,956	117.840	4,826,255.040	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,758	36.500	3,677,667.000	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	166.670	810,349.540	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	31.350	285,880.650	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,482	138.380	8,784,639.160	
YAMANA GOLD INC	84,317	5.660	477,234.220	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	34.060	541,928.660	
OPEN TEXT CORP	25,261	57.160	1,443,918.760	
EMPIRE CO LTD	15,093	34.700	523,727.100	
KINROSS GOLD CORP	127,809	8.530	1,090,210.770	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	68.020	677,683.260	
FORTIS INC	45,228	49.320	2,230,644.960	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	31.060	1,543,495.640	
TELUS CORP	31,890	25.450	811,600.500	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	31.990	807,747.500	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	29.040	625,579.680	
ENBRIDGE INC	183,050	44.700	8,182,335.000	
IGM FINANCIAL INC	6,069	35.410	214,903.290	
MANULIFE FINANCIAL CORP	171,681	25.590	4,393,316.790	
LOBLAW CO LTD	15,136	60.860	921,176.960	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,024	108.640	2,935,887.360	
SUN LIFE FINANCIAL INC	51,808	63.380	3,283,591.040	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	512.740	1,229,550.520	
METRO INC	20,760	52.840	1,096,958.400	
EMERA INC	22,433	49.960	1,120,752.680	
ONEX CORP	6,646	70.970	471,666.620	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	46.040	863,986.640	
POWER CORP OF CANADA	46,551	31.010	1,443,546.510	
QUEBECOR INC-B	16,042	31.920	512,060.640	
ROYAL BANK OF CANADA	127,082	111.880	14,217,934.160	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,236	457.540	5,598,459.440	
SHAW COMM INC-B	43,484	22.190	964,909.960	
SUNCOR ENERGY INC	130,806	26.920	3,521,297.520	
LUNDIN MINING CORP	64,310	15.100	971,081.000	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	29.740	1,219,815.840	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	111.550	1,678,715.950	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	91.280	677,023.760	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	161,238	79.400	12,802,297.200	
TC ENERGY CORP	82,424	56.160	4,628,931.840	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	85.220	613,584.000	

WESTON (GEORGE) LTD	6,184	92.110	569,608.240	
INTACT FINANCIAL CORP	12,515	142.500	1,783,387.500	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,993	49.860	2,043,910.980	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,864	1,698.460	3,165,929.440	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	17,652	142.390	2,513,468.280	
B2GOLD CORP	101,675	6.110	621,234.250	
CI FINANCIAL CORP	20,285	17.550	356,001.750	
KEYERA CORP	16,668	25.430	423,867.240	
PARKLAND CORP	14,497	39.060	566,252.820	
ALTAGAS LTD	23,944	20.060	480,316.640	
PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	35.180	1,773,423.800	
DOLLARAMA INC	26,906	47.200	1,269,963.200	
CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	9.540	1,142,023.860	
NORTHLAND POWER INC	17,568	43.260	759,991.680	
TMX GROUP LTD	5,058	123.160	622,943.280	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	44.670	975,592.800	
INTER PIPELINE LTD	41,863	17.970	752,278.110	
NUTRIEN LTD	50,630	70.650	3,577,009.500	
SSR MINING INC	18,000	19.490	350,820.000	
WSP GLOBAL INC	10,194	117.460	1,197,387.240	
IA FINANCIAL CORP INC	12,278	66.870	821,029.860	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	38.950	642,090.750	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	58.430	633,673.350	
AIR CANADA	10,722	26.340	282,417.480	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	77.590	1,953,405.840	
SHOPIFY INC	9,739	1,632.440	15,898,333.160	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	191.760	671,735.280	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	44.530	829,772.020	
HYDRO ONE LTD	27,340	26.720	730,524.800	
カナダ・ドル 小計	3,575,937		193,060,160.550 (16,357,987,403)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.730	466,250.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	155,700	26.400	4,110,480.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.330	266,812.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.880	680,732.000	
CAPITALAND LTD	308,815	3.150	972,767.250	
GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.845	360,646.000	
KEPPEL CORP LTD	134,900	5.030	678,547.000	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	271,653	10.850	2,947,435.050	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,822	2.380	1,610,836.360	
SINGAPORE AIRLINES LTD	160,850	4.690	754,386.500	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	23.880	2,445,312.000	

	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.500	303,750.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	19.480	409,080.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	5.400	979,560.000	
シンガポール・ドル 小計		2,711,140		16,986,594.160 (1,366,061,902)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	225,770	13.250	2,991,452.500	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	98.820	1,425,873.780	
	NESTLE SA-REGISTERED	257,032	96.750	24,867,846.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	47,414	89.380	4,237,863.320	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	62,885	302.550	19,025,856.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	258.100	894,832.700	
	SIKA INHABER	12,363	248.500	3,072,205.500	
	SGS SA-REG	540	2,675.000	1,444,500.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	198,127	79.370	15,725,339.990	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	159.800	680,588.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	1,997.000	529,205.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.515	389,890.180	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	468.200	1,165,349.800	
	ABB LTD	165,776	26.780	4,439,481.280	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	59.700	772,756.800	
	GEBERIT AG	3,181	549.000	1,746,369.000	
	LONZA GROUP AG-REG	6,869	592.400	4,069,195.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	7,835.000	744,325.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	82,900.000	746,100.000	
	GIVAUDAN-REG	812	3,521.000	2,859,052.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,585	379.500	5,155,507.500	
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,895	51.600	2,471,382.000	
	TEMENOS GROUP	5,723	127.600	730,254.800	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	237.400	1,115,305.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,518	213.900	966,400.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1,120.000	1,029,280.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,441	270.600	660,534.600	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	51.950	238,554.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	253.600	421,736.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,761	455.500	1,257,635.500	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	97.100	242,750.000	
	VIFOR PHARMA AG	4,645	114.100	529,994.500	
EMS-CHEMIE HOLDING	827	830.000	686,410.000		
SWISS PRIME SITE AG	8,337	87.700	731,154.900		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,658	1,103.000	1,828,774.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	20,118	56.640	1,139,483.520		
SWISS RE LTD	24,871	86.620	2,154,326.020		
ALCON INC	42,961	64.180	2,757,236.980		
UBS GROUP AG	331,428	14.435	4,784,163.180		
スイス・フラン 小計		1,564,845		120,728,967.500	

				(14,116,838,170)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	56,489	494.600	27,939,459.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	417.800	15,062,107.800	
	ERICSSON LM-B SHS	264,968	103.850	27,516,926.800	
	LUNDBERGS B	7,382	415.200	3,065,006.400	
	SKF AB-B SHS	34,849	233.300	8,130,271.700	
	SANDVIK AB	103,400	231.500	23,937,100.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,990	97.620	14,153,923.800	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	204.400	6,469,873.200	
	SWEDBANK AB	79,825	149.080	11,900,311.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	146.950	7,780,267.750	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	90.100	12,544,623.000	
	VOLVO AB-B SHS	130,590	221.500	28,925,685.000	
	SWEDISH MATCH AB	13,845	610.200	8,448,219.000	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	106.200	4,997,241.000	
	INDUSTRIVARDEN A	11,955	293.800	3,512,379.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	279.100	3,182,577.300	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	207.700	3,985,970.700	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	130.350	3,141,174.300	
	INVESTOR AB-B SHS	39,567	632.400	25,022,170.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	68,814	197.200	13,570,120.800	
	ASSA ABLOY AB-B	87,021	216.800	18,866,152.800	
	TELIA CO AB	210,477	34.250	7,208,837.250	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	273.500	4,031,116.500	
	BOLIDEN AB	28,376	339.000	9,619,464.000	
	ALFA LAVAL AB	28,392	264.300	7,504,005.600	
	KINNEVIK AB-B	21,722	398.750	8,661,647.500	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	399.400	3,581,419.800	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	402.400	3,625,221.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	102.250	3,445,007.000	
	NIBE INDUSTRIER AB	28,834	266.900	7,695,794.600	
	HEXAGON AB	26,534	725.800	19,258,377.200	
	EPIROC AB-A	60,750	185.200	11,250,900.000	
	EPIROC AB-B	30,899	170.250	5,260,554.750	
ESSITY AB-B	52,143	259.000	13,505,037.000		
EQT AB	20,934	237.400	4,969,731.600		
EVOLUTION GAMING GROUP AB	13,641	1,083.000	14,773,203.000		
NORDEA BANK ABP	295,752	76.430	22,604,325.360		
INVESTMENT AB LATOUR	14,945	193.400	2,890,363.000		
スウェーデン・クローナ 小計	2,305,127		422,036,567.310 (5,402,068,062)		
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	9,974	987.400	9,848,327.600	
	A P MOLLER A/S	568	13,805.000	7,841,240.000	

	AP MOLLER MAERSK A	255	12,700.000	3,238,500.000	
	DANSKE BANK A/S	59,305	114.200	6,772,631.000	
	GENMAB A/S	6,190	2,150.000	13,308,500.000	
	NOVOZYMES-B SHS	17,740	377.800	6,702,172.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,166.000	1,760,958.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	154,044	441.450	68,002,723.800	
	GN STORE NORD A/S	12,895	521.800	6,728,611.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,127	1,130.000	20,483,510.000	
	COLOPLAST-B	10,734	933.600	10,021,262.400	
	DSV PANALPINA A S	19,049	1,109.500	21,134,865.500	
	DEMANT A/S	10,739	257.900	2,769,588.100	
	H LUNDBECK A/S	4,840	242.500	1,173,700.000	
	TRYG A/S	11,107	197.000	2,188,079.000	
	PANDORA A/S	8,251	623.400	5,143,673.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	522.400	4,877,126.400	
	AMBU A/S B	14,156	273.900	3,877,328.400	
	ORSTED A/S	16,471	988.600	16,283,230.600	
デンマーク・クローネ 小計		384,594		212,156,027.200 (3,678,785,512)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.300	804,649.800	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	14.780	441,833.320	
	A2 MILK CO LTD	55,091	11.130	613,162.830	
	FISHER & PAYKEL	49,044	29.500	1,446,798.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.660	743,843.180	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.140	379,046.760	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.500	682,891.000	
ニュージーランド・ドル 小計		589,774		5,112,224.890 (402,843,321)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,537	212.100	9,234,197.700	
	DNB ASA	80,709	168.450	13,595,431.050	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	47.640	6,147,275.040	
	TELENOR ASA	63,038	140.500	8,856,839.000	
	SCHIBSTED ASA	7,537	350.000	2,637,950.000	
	ORKLA ASA	65,283	80.340	5,244,836.220	
	EQUINOR ASA	83,149	164.150	13,648,908.350	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	427.000	6,487,411.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	202.000	3,369,966.000	
	ADEVINTA ASA	22,265	126.300	2,812,069.500	
	SCHIBSTED ASA	7,445	294.000	2,188,830.000	
ノルウェー・クローネ 小計		533,875		74,223,713.860 (938,929,980)	
ユーロ	CRH PLC	71,653	37.110	2,659,042.830	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,128	163.250	2,306,396.000	

KERRY GROUP PLC-A	14,730	103.200	1,520,136.000	
KINGSPAN GROUP PLC	13,452	61.050	821,244.600	
UMICORE	17,654	48.600	857,984.400	
AIR LIQUIDE	41,200	129.300	5,327,160.000	
AIRBUS SE	53,176	102.720	5,462,238.720	
AXA SA	169,493	20.305	3,441,555.360	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,707	23.350	1,184,008.450	
ADIDAS AG	17,202	288.700	4,966,217.400	
ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	15.565	1,518,661.480	
DASSAULT AVIATION SA	295	920.000	271,400.000	
DANONE	54,315	57.960	3,148,097.400	
SAFRAN SA	28,036	121.000	3,392,356.000	
INTESA SANPAOLO	1,512,369	2.127	3,216,808.860	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,217	70.390	2,197,364.630	
ACCOR SA	17,380	35.110	610,211.800	
BOUYGUES	21,417	34.490	738,672.330	
BNP PARIBAS	101,791	50.170	5,106,854.470	
THALES SA	10,513	80.340	844,614.420	
CAPGEMINI SA	14,912	136.100	2,029,523.200	
UNICREDIT SPA	193,910	8.743	1,695,355.130	
NATIXIS	70,166	4.047	283,961.800	
KONINKLIJKE DSM NV	15,210	138.000	2,098,980.000	
COMMERZBANK AG	83,118	5.440	452,161.920	
EIFFAGE	8,465	86.500	732,222.500	
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,030	35.430	1,382,832.900	
UNITED INTERNET	9,882	37.430	369,883.260	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	46.180	256,114.280	
PUBLICIS GROUPE	18,595	49.030	911,712.850	
FAURECIA	6,117	43.310	264,927.270	
IBERDROLA SA	550,872	10.395	5,726,314.440	
ENI SPA	219,331	9.577	2,100,532.980	
JERONIMO MARTINS	19,517	12.930	252,354.810	
KESKO OYJ-B	24,085	21.180	510,120.300	
KBC GROUPE	21,038	61.200	1,287,525.600	
HANNOVER RUECK SE	4,868	142.000	691,256.000	
WARTSILA OYJ	34,935	9.320	325,594.200	
L'OREAL	22,447	307.200	6,895,718.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	24,873	532.800	13,252,334.400	
GEA GROUP AG	11,838	28.900	342,118.200	
BOLLORE	71,347	4.030	287,528.410	
MEDIOBANCA SPA	57,442	8.960	514,680.320	
MICHELIN(CGDE) -B	14,802	118.550	1,754,777.100	
CONTINENTAL AG	10,336	120.500	1,245,488.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	86,975	41.820	3,637,294.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	30.400	644,662.400	
OMV AG	12,817	41.500	531,905.500	

VERBUND AG	6,924	64.450	446,251.800	
PERNOD-RICARD	19,038	160.500	3,055,599.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,649	65.920	833,822.080	
RENAULT SA	19,019	36.965	703,037.330	
REPSOL SA	135,990	10.320	1,403,416.800	
REMY COINTREAU	1,860	161.300	300,018.000	
MERCK KGAA	11,874	137.000	1,626,738.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,560	43.410	1,934,349.600	
RWE AG	59,273	31.520	1,868,284.960	
SEB SA	2,218	158.900	352,440.200	
SOCIETE GENERALE-A	69,595	20.380	1,418,346.100	
VINCI S.A.	47,257	87.900	4,153,890.300	
SODEXO	9,178	82.600	758,102.800	
SOFINA	1,382	279.500	386,269.000	
SOLVAY SA	7,183	104.050	747,391.150	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	48,376	123.600	5,979,273.600	
VIVENDI SA	70,995	29.400	2,087,253.000	
SAP SE	93,454	103.220	9,646,321.880	
TELEFONICA S.A	455,887	3.640	1,659,428.680	
TOTAL SE	225,811	38.975	8,800,983.720	
VALEO	19,653	30.930	607,867.290	
E.ON SE	209,842	8.558	1,795,827.830	
VOEST-ALPINE AG	9,875	33.090	326,763.750	
HENKEL AG & CO KGAA	8,602	74.550	641,279.100	
SIEMENS AG-REG	68,652	130.920	8,987,919.840	
UPM-KYMMENE OYJ	44,829	32.240	1,445,286.960	
ING GROEP NV-CVA	344,892	9.216	3,178,524.670	
PUMA AG	9,239	85.360	788,641.040	
BAYER AG	88,708	55.110	4,888,697.880	
STORA ENSO OYJ-R SHS	53,250	16.595	883,683.750	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,241	83.100	1,349,627.100	
DAIMLER AG	78,056	65.840	5,139,207.040	
BASF SE	83,215	69.400	5,775,121.000	
BEIERSDORF AG	8,371	84.900	710,697.900	
HOCHTIEF AG	1,707	77.600	132,463.200	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,571	67.600	984,999.600	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	20,191	57.860	1,168,251.260	
ORANGE	184,093	9.768	1,798,220.420	
SAMPO OYJ-A SHS	44,822	36.950	1,656,172.900	
RANDSTAD NV	12,601	56.620	713,468.620	
ALLIANZ SE	37,504	200.450	7,517,676.800	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,662	4.718	1,126,007.310	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	99,280	22.120	2,196,073.600	
HERMES INTL	2,880	937.800	2,700,864.000	

ENDESA S.A.	27,736	21.220	588,557.920	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	12.070	337,839.300	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	27.730	671,176.920	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,301	241.300	2,968,231.300	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	19.850	1,222,640.900	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,183	174.900	2,130,806.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,734	25.840	561,606.560	
HEINEKEN NV	22,683	85.820	1,946,655.060	
AKZO NOBEL	17,959	87.160	1,565,306.440	
ASML HOLDING NV	38,098	473.450	18,037,498.100	
AEGON NV	150,349	4.048	608,612.750	
VOLKSWAGEN AG	2,758	195.100	538,085.800	
VOLKSWAGEN AG PFD	16,361	172.620	2,824,235.820	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	578,251	4.630	2,677,302.130	
KERING	6,827	526.300	3,593,050.100	
CNP ASSURANCES	13,987	14.630	204,629.810	
FORTUM OYJ	39,409	21.040	829,165.360	
AGEAS	14,365	46.560	668,834.400	
UCB SA	10,571	81.320	859,633.720	
NEMETSCHKE SE	5,095	53.000	270,035.000	
CARREFOUR SA	49,926	14.565	727,172.190	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	20.500	484,046.000	
ATOS SE	8,972	63.900	573,310.800	
NOKIA OYJ	518,532	3.286	1,703,896.150	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	82,919	46.110	3,823,395.090	
WOLTERS KLUWER-CVA	25,715	63.880	1,642,674.200	
SANOFI	101,454	76.630	7,774,420.020	
STMICROELECTRONICS NV	54,176	32.710	1,772,096.960	
ELISA OYJ	13,642	50.380	687,283.960	
BANCO SANTANDER SA	1,586,957	2.962	4,700,566.630	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	13.850	479,154.600	
QIAGEN N.V.	20,763	42.620	884,919.060	
DEUTSCHE BANK AG-REG	165,949	10.186	1,690,356.510	
BMW VORZUG	4,116	55.650	229,055.400	
ENEL SPA	729,944	7.920	5,781,156.480	
COLRUYT NV	4,673	49.980	233,556.540	
VOPAK (KON.)	5,364	39.750	213,219.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	299,358	14.770	4,421,517.660	
SARTORIUS AG	3,044	428.000	1,302,832.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	67.960	522,340.560	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	118,879	35.350	4,202,372.650	
RATIONAL AG	479	712.500	341,287.500	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	126.000	475,146.000	
BECHTLE AG	2,511	157.100	394,478.100	
KONINKLIJKE KPN NV	347,824	2.731	949,907.340	



EUROFINS SCIENTIFIC	11,330	74.990	849,636.700	
TELEPERFORMANCE	5,312	274.000	1,455,488.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,752	134.750	2,257,332.000	
EURAZEO	5,229	62.900	328,904.100	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	83.140	823,418.560	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	74.450	744,797.800	
INDITEX	100,423	26.990	2,710,416.770	
ESSILORLUXOTTICA	24,984	136.950	3,421,558.800	
SNAM SPA	171,294	4.353	745,642.780	
CREDIT AGRICOLE SA	98,685	11.660	1,150,667.100	
ORPEA	4,932	105.700	521,312.400	
ENAGAS	23,477	17.430	409,204.110	
WENDEL	2,220	94.450	209,679.000	
TENARIS SA	36,959	7.688	284,140.790	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.414	315,747.450	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.459	228,396.560	
ATLANTIA SPA	45,299	15.920	721,160.080	
ILIAD SA	1,046	149.050	155,906.300	
PROXIMUS	13,739	18.300	251,423.700	
SES FDR	28,847	6.904	199,159.680	
TERNA SPA	113,654	5.808	660,102.430	
BIOMERIEUX	3,248	109.400	355,331.200	
GRIFOLS SA	23,518	21.490	505,401.820	
FERROVIAL SA	40,593	21.520	873,561.360	
LANXESS AG	6,856	62.540	428,774.240	
NESTE OYJ	36,796	54.440	2,003,174.240	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	17.510	313,621.610	
RECORDATI SPA	10,303	42.870	441,689.610	
GALAPAGOS NV	3,426	70.280	240,779.280	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	9.646	533,462.380	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,873	207.100	1,009,198.300	
KONE OYJ	29,890	67.740	2,024,748.600	
ELIA GROUP	2,862	92.400	264,448.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	364.400	869,822.800	
ENGIE	166,061	12.645	2,099,841.340	
ALSTOM	21,779	41.590	905,788.610	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	10.060	551,066.680	
IPSEN SA	3,646	71.500	260,689.000	
DEUTSCHE WOHNEN	29,097	39.290	1,143,221.130	
ARKEMA SA	6,393	90.260	577,032.180	
LEGRAND SA	23,806	72.500	1,725,935.000	
AMPLIFON SPA	11,372	33.310	378,801.320	
ADP	2,313	107.500	248,647.500	
ORION OYJ	8,051	35.120	282,751.120	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	9.454	378,991.950	

SYMRISE AG	11,308	98.960	1,119,039.680	
SCOR SE	15,667	28.280	443,062.760	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,870	40.300	841,061.000	
PRYSMIAN SPA	22,328	26.700	596,157.600	
DIASORIN SPA	2,223	158.200	351,678.600	
CAIXABANK	307,331	2.415	742,204.360	
BUREAU VERITAS SA	29,810	21.970	654,925.700	
GETLINK	37,646	14.030	528,173.380	
SUEZ SA	26,620	17.200	457,864.000	
AMADEUS IT GROUP SA	41,118	60.000	2,467,080.000	
BRENTAG SE	14,044	64.960	912,298.240	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	28.400	486,094.400	
EDENRED	21,488	47.070	1,011,440.160	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.271	223,432.330	
LEG IMMOBILIEN AG	5,934	114.240	677,900.160	
KION GROUP AG	5,903	71.700	423,245.100	
VONOVIA SE	45,451	52.860	2,402,539.860	
KNORR-BREMSE AG	6,860	105.120	721,123.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,805	46.240	1,100,743.200	
FERRARI NV	11,542	161.050	1,858,839.100	
CNH INDUSTRIAL NV	89,378	12.565	1,123,034.570	
AROUNDTOWN SA	83,054	5.984	496,995.130	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	37.530	303,692.760	
MONCLER SPA	17,567	51.000	895,917.000	
NEXI SPA	43,097	15.110	651,195.670	
TEAMVIEWER AG	13,668	45.040	615,606.720	
PROSUS NV	44,219	99.440	4,397,137.360	
JDE PEET'S BV	7,308	32.810	239,775.480	
SIEMENS ENERGY AG	35,831	30.390	1,088,904.090	
WORLDLINE SA	22,386	73.700	1,649,848.200	
NN GROUP NV	25,274	38.210	965,719.540	
FINECOBANK SPA	53,818	14.875	800,542.750	
ARGENX SE	3,879	283.600	1,100,084.400	
ZALANDO SE	14,756	86.800	1,280,820.800	
STELLANTIS NV	176,958	13.580	2,403,089.640	
AENA SME SA	6,256	144.200	902,115.200	
CELLNEX TELECOM SAU	27,234	41.700	1,135,657.800	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	80.860	876,198.960	
ABN AMRO BANK NV	34,251	9.586	328,330.080	
EXOR NV	9,966	67.460	672,306.360	
SCOUT24 AG	9,670	63.000	609,210.000	
COVESTRO AG	16,337	60.940	995,576.780	
HELLOFRESH SE	12,838	65.050	835,111.900	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	66,327	53.190	3,527,933.130	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	9.550	382,143.250	
AMUNDI SA	5,924	63.500	376,174.000	

	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	8.540	199,357.760	
	ADYEN NV	1,589	1,978.500	3,143,836.500	
	UNIPER SE	18,203	30.040	546,818.120	
	DELIVERY HERO SE	10,974	109.100	1,197,263.400	
ユーロ 小計		16,661,763		382,477,707.530 (49,320,500,386)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	109.800	3,612,420.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	20.750	3,403,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	17.840	1,852,862.400	
	CLP HOLDINGS LTD	134,500	76.900	10,343,050.000	
	PCCW LTD	331,000	4.500	1,489,500.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	43.350	2,145,825.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	109,040	509.000	55,501,360.000	
	MTR CORP	126,000	46.150	5,814,900.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	149.100	9,795,870.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	33.750	3,896,437.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	134,500	43.200	5,810,400.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	913,292	11.720	10,703,782.240	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	197,000	74.900	14,755,300.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	25.100	7,969,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	39.800	6,490,026.800	
	SINO LAND CO	255,400	12.320	3,146,528.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,500	121.000	13,128,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	57.250	2,833,875.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	128,500	122.200	15,702,700.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	21.800	3,618,800.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	11.200	1,747,200.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	15.800	1,965,520.000	
	AIA GROUP LTD	1,087,227	101.400	110,244,817.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	10.500	3,034,500.000	
	SANDS CHINA LTD	198,800	37.450	7,445,060.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.800	2,479,960.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	47.600	7,128,100.000	
	ESR CAYMAN LTD	147,400	25.250	3,721,850.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.670	1,764,100.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	27.200	4,096,320.000	
	WH GROUP LTD	897,000	6.720	6,027,840.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	255,332	59.100	15,090,121.200	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	45.950	10,331,030.400	
香港・ドル	小計	7,679,749		357,090,806.340 (4,885,002,231)	
合計		97,254,978		458,185,016,827 (458,185,016,827)	

## (2) 株式以外の有価証券

2021年2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	108,972.000	999,273.240		
		GOODMAN GROUP	148,357.000	2,482,012.610		
		GPT GROUP	158,232.000	680,397.600		
		MIRVAC GROUP	329,418.000	734,602.140		
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,193,561.120		
		STOCKLAND	194,018.000	878,901.540		
		VICINITY CENTRES	371,711.000	602,171.820		
		オーストラリア・ドル 小計		1,730,976.000	7,570,920.070 (639,515,618)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	869,039.820		
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	483,636.000	996,290.160		
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	382,677.000		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	502,386.000		
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	282,387.000		
		シンガポール・ドル 小計		1,430,742.000	3,032,779.980 (243,896,166)	
	投資信託受益証券	合計		3,161,718	883,411,784 (883,411,784)	
	投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	763,144.240	
			ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,006.000	1,967,903.460	
AMERICAN TOWER CORP			39,736.000	8,931,858.080		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT			127,559.000	1,088,078.270		
AVALONBAY COMMUNITIES INC			12,329.000	2,280,865.000		
BOSTON PROPERTIES INC			12,947.000	1,355,421.430		
CAMDEN PROPERTY TRUST			9,643.000	1,029,486.680		
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP			38,831.000	6,259,557.200		
DIGITAL REALTY TRUST INC			23,492.000	3,174,943.800		
DUKE REALTY TRUST			31,929.000	1,288,335.150		
EQUINIX INC			7,992.000	5,106,888.000		

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,087.000	995,463.560	
	EQUITY RESIDENTIAL	35,108.000	2,434,739.800	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,504.000	1,486,795.520	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,385.000	1,574,133.500	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,543.000	1,425,495.900	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,094,858.240	
	INVITATION HOMES INC	50,475.000	1,507,688.250	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	852,078.150	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,211,919.280	
	MID AMERICA	10,854.000	1,525,095.540	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	22,693.000	880,488.400	
	PROLOGIS INC	66,350.000	6,849,974.000	
	PUBLIC STORAGE	13,834.000	3,356,266.740	
	REALTY INCOME CORP	29,466.000	1,837,794.420	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	816,293.700	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,838.000	2,464,517.380	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,083.000	3,341,877.000	
	SUN COMMUNITIES INC	9,670.000	1,496,045.700	
	UDR INC	27,057.000	1,175,085.510	
	VENTAS INC	35,021.000	1,958,374.320	
	VEREIT INC	20,534.000	827,314.860	
	VICI PROPERTIES INC	47,083.000	1,340,923.840	
	VORNADO REALTY TRUST	12,714.000	567,044.400	
	WELLTOWER INC	38,411.000	2,827,049.600	
	WEYERHAEUSER CO	64,096.000	2,301,046.400	
	WP CAREY INC	15,529.000	1,114,050.460	
アメリカ・ドル	小計	1,135,780.000	80,508,895.780 (8,538,773,486)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	363,058.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	381,184.310	
	SEGRO PLC	100,956.000	951,409.340	
イギリス・ポンド	小計	226,618.000	1,695,652.450 (254,432,650)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	396,984.140	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	263,279.850	
	小計	21,421.000	660,263.990 (55,944,168)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	321,513.850	
	GECINA SA	3,670.000	423,151.000	
	KLEPIERRE	17,099.000	318,468.870	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	765,639.200	
ユーロ	小計	38,352.000	1,828,772.920	

				(235,820,268)	
	香港・ドル	LINK REIT	200,200.000	14,514,500.000	
	香港・ドル	小計	200,200.000	14,514,500.000	
				(198,558,360)	
投資証券	合計		1,622,371	9,283,528,932	
				(9,283,528,932)	
合計				10,166,940,716	
				(10,166,940,716)	

(注) 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 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	592銘柄	68.41	-	-	71.93
	投資証券	37銘柄	-	-	1.78	
イギリス・ポンド	株式	85銘柄	4.63	-	-	4.79
	投資証券	3銘柄	-	-	0.05	
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.09	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式	58銘柄	2.24	-	-	2.43
	投資信託受益証券	7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式	87銘柄	3.41	-	-	3.50
	投資証券	2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.28	-	-	0.34
	投資信託受益証券	5銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式	39銘柄	2.94	-	-	3.01
スウェーデン・クローナ	株式	38銘柄	1.13	-	-	1.15
デンマーク・クローネ	株式	19銘柄	0.77	-	-	0.79
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.08	-	-	0.09
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.20	-	-	0.20
ユーロ	株式	232銘柄	10.28	-	-	10.58
	投資証券	4銘柄	-	-	0.05	
香港・ドル	株式	33銘柄	1.02	-	-	1.09
	投資証券	1銘柄	-	-	0.04	

(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)

2021年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,127,523,818
国債証券	227,692,741,200
地方債証券	17,188,011,000
特殊債券	16,281,849,396
社債券	10,564,022,650
未収入金	637,998,000
未収利息	543,006,407
前払費用	82,215,319
流動資産合計	274,117,367,790
資産合計	
274,117,367,790	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	566,144,000
流動負債合計	566,144,000
負債合計	
566,144,000	
純資産の部	
元本等	
元本	211,258,108,968
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	62,293,114,822
元本等合計	273,551,223,790
純資産合計	
273,551,223,790	
負債純資産合計	
274,117,367,790	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年2月26日 至 2021年2月25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	2021年2月25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	169,257,068,344円
同期中追加設定元本額	168,533,230,141円
同期中一部解約元本額	126,532,189,517円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	20,093,429,398円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	75,739,659円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	64,284,684円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	13,679,522円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	739,856,464円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	174,979,574円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	20,926,923円
たわらノーロード 国内債券	13,516,835,395円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,433,642,829円
たわらノーロード バランス(堅実型)	488,392,662円
たわらノーロード バランス(標準型)	792,181,415円
たわらノーロード バランス(積極型)	96,487,331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)	37,751,069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)	845,741,162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)	873,282,760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)	274,109,635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)	101,855,321円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	12,370,743円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,129,263円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	15,733,702円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,613,180円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,761,539円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,584,388,062円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	8,010,802,658円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	10,638,855,349円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	4,243,719,533円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,948,928,403円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,100,996,248円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	317,515,894円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	69,643,768円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,183,121,770円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,343,546円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,834,269,246円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,222,758,713円



D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	245,959,510円
投資のソムリエ	19,968,780,596円
クルーズコントロール	1,804,525,001円
投資のソムリエ<DC年金>	1,200,230,759円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,601,786,821円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	462,177,298円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	7,278,578円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	14,490,817円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,572,825,479円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	28,534,806,570円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	15,663,827円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,365,387円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	25,891,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	37,653,006円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	594,834,878円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,535,529,529円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,553,714,682円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,031,113円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,154,214円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,082,107円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	12,078,589円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010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)	203,762,853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)	250,829,496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)	1,519,942,923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)	127,491,625円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,794,956,440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)	1,101,630,563円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	308,141,870円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,804,574,674円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,780,092,239円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,759,938,173円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,767,537,679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)	333,271,914円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	192,250,470円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	114,040,022円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	41,408,164円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	118,744,423円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	46,837,507円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,271,033円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	63,059,998円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	144,208,706円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,099,137,325円

D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,449,083,659円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,593,070,686円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	509,704,234円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	209,605,289円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,518,908,521円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	226,730,909円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,843,033円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	2,792,325,819円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	54,001,054円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	448,922,701円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	713,955,739円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,208,506,372円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	337,369,277円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	106,770,675円
One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)	1,044,335,771円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	382,409,178円
計	211,258,108,968円
2. 受益権の総数	211,258,108,968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 2020年2月26日 至 2021年2月25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。リスク管理に関する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	2021年2月25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	2021年2月25日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,475,548,700	
地方債証券	36,049,000	
特殊債券	57,307,713	
社債券	19,801,970	
合計	1,588,707,383	

(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(2021年2月16日から2021年2月25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)

		2021年2月25日現在
1口当たり純資産額		1.2949円
(1万口当たり純資産額)		(12,949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

2021年2月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 1 1 回 利付国庫債券(2年)	900,000,000	902,160,000	
	4 1 2 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,503,870,000	

413回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	501,385,000	
414回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,950,000	
415回 利付国庫債券(2年)	200,000,000	200,628,000	
416回 利付国庫債券(2年)	1,270,000,000	1,274,229,100	
418回 利付国庫債券(2年)	1,300,000,000	1,304,693,000	
419回 利付国庫債券(2年)	600,000,000	602,220,000	
420回 利付国庫債券(2年)	1,600,000,000	1,606,208,000	
132回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,507,050,000	
133回 利付国庫債券(5年)	1,980,000,000	1,986,652,800	
134回 利付国庫債券(5年)	1,690,000,000	1,696,286,800	
135回 利付国庫債券(5年)	1,840,000,000	1,847,580,800	
136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,255,787,500	
137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,407,196,000	
138回 利付国庫債券(5年)	2,550,000,000	2,564,739,000	
139回 利付国庫債券(5年)	1,720,000,000	1,730,543,600	
140回 利付国庫債券(5年)	1,690,000,000	1,700,663,900	
141回 利付国庫債券(5年)	1,660,000,000	1,670,972,600	
142回 利付国庫債券(5年)	1,920,000,000	1,932,844,800	
143回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,711,764,000	
144回 利付国庫債券(5年)	2,750,000,000	2,769,607,500	
145回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,115,855,000	
146回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,208,976,000	
2回 利付国庫債券(40年)	280,000,000	385,280,000	
3回 利付国庫債券(40年)	290,000,000	401,342,600	
4回 利付国庫債券(40年)	550,000,000	764,373,500	
5回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	671,830,000	
6回 利付国庫債券(40年)	570,000,000	755,027,700	
7回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	803,451,600	
8回 利付国庫債券(40年)	620,000,000	739,362,400	

9回 利付国庫債券(40年)	1,020,000,000	908,279,400	
10回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	940,986,000	
11回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	760,867,500	
12回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	686,355,000	
13回 利付国庫債券(40年)	560,000,000	510,759,200	
321回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,315,379,000	
323回 利付国庫債券(10年)	3,200,000,000	3,242,464,000	
324回 利付国庫債券(10年)	1,050,000,000	1,062,547,500	
325回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,419,964,000	
326回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	507,265,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,219,620,000	
328回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,815,865,500	
329回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,806,709,800	
330回 利付国庫債券(10年)	1,250,000,000	1,278,750,000	
331回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	661,609,000	
332回 利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,406,610,000	
333回 利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,297,992,500	
334回 利付国庫債券(10年)	2,380,000,000	2,434,145,000	
335回 利付国庫債券(10年)	2,940,000,000	3,000,946,200	
336回 利付国庫債券(10年)	1,060,000,000	1,083,097,400	
337回 利付国庫債券(10年)	1,440,000,000	1,460,361,600	
338回 利付国庫債券(10年)	2,030,000,000	2,068,427,900	
339回 利付国庫債券(10年)	3,040,000,000	3,101,104,000	
340回 利付国庫債券(10年)	2,350,000,000	2,400,008,000	
341回 利付国庫債券(10年)	2,210,000,000	2,247,857,300	
342回 利付国庫債券(10年)	2,580,000,000	2,598,963,000	

343回 利付国庫債券(10年)	2,280,000,000	2,296,986,000	
344回 利付国庫債券(10年)	2,780,000,000	2,800,127,200	
345回 利付国庫債券(10年)	3,010,000,000	3,031,882,700	
346回 利付国庫債券(10年)	2,470,000,000	2,487,981,600	
347回 利付国庫債券(10年)	2,010,000,000	2,023,949,400	
348回 利付国庫債券(10年)	1,980,000,000	1,993,642,200	
349回 利付国庫債券(10年)	2,560,000,000	2,577,433,600	
350回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,717,118,000	
351回 利付国庫債券(10年)	1,960,000,000	1,970,721,200	
352回 利付国庫債券(10年)	2,220,000,000	2,230,878,000	
353回 利付国庫債券(10年)	1,840,000,000	1,847,875,200	
354回 利付国庫債券(10年)	1,870,000,000	1,876,750,700	
355回 利付国庫債券(10年)	1,920,000,000	1,925,548,800	
356回 利付国庫債券(10年)	2,180,000,000	2,183,706,000	
357回 利付国庫債券(10年)	2,160,000,000	2,161,879,200	
358回 利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,100,000,000	
359回 利付国庫債券(10年)	2,160,000,000	2,156,997,600	
360回 利付国庫債券(10年)	2,090,000,000	2,084,064,400	
361回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	796,896,000	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,084,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	120,585,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,482,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,134,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	236,290,000	
11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	235,060,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,370,000	
13回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	121,727,000	
14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	368,389,900	

15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,312,000	
16回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	193,642,500	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	256,048,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	406,342,400	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	254,542,000	
20回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,854,000	
21回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	255,826,000	
22回 利付国庫債券(30年)	220,000,000	288,492,600	
23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,874,000	
24回 利付国庫債券(30年)	190,000,000	250,294,600	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,858,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	522,696,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	557,881,800	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	640,468,800	
29回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	740,762,400	
30回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	746,751,300	
31回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	596,385,400	
32回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	804,571,700	
33回 利付国庫債券(30年)	930,000,000	1,180,700,100	
34回 利付国庫債券(30年)	920,000,000	1,206,239,600	
35回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,405,052,000	
36回 利付国庫債券(30年)	950,000,000	1,216,874,000	
37回 利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,252,478,700	
38回 利付国庫債券(30年)	690,000,000	861,375,300	
39回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	774,425,500	

40回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	625,455,000	
41回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	738,366,000	
42回 利付国庫債券(30年)	810,000,000	997,563,600	
43回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	640,915,600	
44回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	727,741,400	
45回 利付国庫債券(30年)	580,000,000	690,925,000	
46回 利付国庫債券(30年)	750,000,000	893,797,500	
47回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	862,472,500	
48回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	830,707,100	
49回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	936,200,000	
50回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	629,715,200	
51回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	567,889,000	
52回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	653,337,200	
53回 利付国庫債券(30年)	750,000,000	736,822,500	
54回 利付国庫債券(30年)	700,000,000	720,188,000	
55回 利付国庫債券(30年)	700,000,000	719,544,000	
56回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	636,740,000	
57回 利付国庫債券(30年)	690,000,000	707,974,500	
58回 利付国庫債券(30年)	870,000,000	891,819,600	
59回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	680,000,000	
60回 利付国庫債券(30年)	760,000,000	796,039,200	
61回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	657,703,200	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	472,665,000	
63回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	523,408,200	
64回 利付国庫債券(30年)	640,000,000	586,611,200	



65回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	558,089,000	
66回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	474,874,400	
67回 利付国庫債券(30年)	790,000,000	761,520,500	
68回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	684,227,000	
69回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	296,706,000	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	377,272,000	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	366,911,000	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	152,338,200	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	206,100,600	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	262,627,200	
85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	487,867,600	
88回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	393,599,500	
90回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	337,287,000	
92回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	977,636,400	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	280,640,000	
94回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	507,883,500	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	401,065,000	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	572,395,000	
99回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	514,386,000	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	692,706,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	422,406,000	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	462,316,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	407,165,500	
107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	464,000,000	
108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	457,772,000	

109回 利付国庫債券(20年)	220,000,000	252,571,000	
110回 利付国庫債券(20年)	330,000,000	384,153,000	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	341,187,900	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	642,532,000	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	902,686,400	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	646,948,500	
115回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	237,004,000	
116回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	380,508,800	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	767,065,000	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	364,005,100	
119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	346,734,000	
120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	454,936,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	630,887,400	
122回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	405,597,500	
123回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	893,167,500	
124回 利付国庫債券(20年)	390,000,000	460,668,000	
125回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	794,877,600	
126回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	402,736,800	
127回 利付国庫債券(20年)	420,000,000	493,332,000	
128回 利付国庫債券(20年)	620,000,000	730,180,200	
129回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	688,860,400	
130回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	795,851,600	
131回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	347,994,000	
132回 利付国庫債券(20年)	420,000,000	488,233,200	
133回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	668,655,600	

134回 利付国庫債券(20年)	630,000,000	740,672,100	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	407,690,500	
136回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	507,755,600	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	408,527,000	
138回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	435,126,600	
139回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	520,263,000	
140回 利付国庫債券(20年)	1,090,000,000	1,274,079,200	
141回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	878,310,000	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	473,040,000	
143回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	882,694,400	
144回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	494,371,000	
145回 利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,422,113,000	
146回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,236,217,500	
147回 利付国庫債券(20年)	1,180,000,000	1,376,930,200	
148回 利付国庫債券(20年)	1,090,000,000	1,259,124,400	
149回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,306,924,100	
150回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,408,177,800	
151回 利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,577,268,300	
152回 利付国庫債券(20年)	1,270,000,000	1,421,320,500	
153回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,326,007,800	
154回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,153,723,600	
155回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,342,594,200	
156回 利付国庫債券(20年)	940,000,000	944,013,800	
157回 利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,119,226,000	
158回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	995,817,200	

159回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,081,227,000		
160回	利付国庫債券(20年)	1,080,000,000	1,127,185,200		
161回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,180,693,500		
162回	利付国庫債券(20年)	920,000,000	943,450,800		
163回	利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,095,936,800		
164回	利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,167,331,200		
165回	利付国庫債券(20年)	890,000,000	894,272,000		
166回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,191,940,500		
167回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	950,769,500		
168回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	834,530,000		
169回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	914,289,500		
170回	利付国庫債券(20年)	820,000,000	787,454,200		
171回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,016,550,600		
172回	利付国庫債券(20年)	760,000,000	740,969,600		
173回	利付国庫債券(20年)	1,020,000,000	993,286,200		
174回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,069,904,000		
175回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	396,424,000		
国債証券 合計		214,920,000,000	227,692,741,200		
地方債証券	708回	東京都公募公債	500,000,000	505,685,000	
	720回	東京都公募公債	300,000,000	305,829,000	
	726回	東京都公募公債	400,000,000	407,880,000	
	802回	東京都公募公債	400,000,000	396,968,000	
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	108,415,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	224,738,000	
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	336,996,000	
	30年度14回	北海道公募公債	300,000,000	300,111,000	
	36回2号	宮城県公募公債 10年	250,000,000	247,875,000	
	194回	神奈川県公募公債	300,000,000	304,143,000	
	208回	神奈川県公募公債	300,000,000	305,127,000	
	19回	神奈川県公募公債 20年	100,000,000	116,431,000	

364回 大阪府公募公債	300,000,000	303,564,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	306,474,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	231,772,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	100,875,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	355,880,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,276,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	310,479,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	324,732,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	211,160,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	109,778,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	348,495,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	505,765,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	305,589,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	178,296,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	198,960,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	99,170,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	407,876,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	345,039,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	203,984,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	344,787,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	303,879,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	204,040,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	109,604,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	109,871,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,965,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	708,022,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,685,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,830,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,184,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,055,000	

	144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	407,084,000	
	146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,768,000	
	148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,410,000	
	166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,330,000	
	29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	200,180,000	
	488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	459,027,000	
	4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	113,328,000	
	30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	301,992,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	408,164,000	
	2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	128,368,000	
	25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	203,562,000	
	第91回 川崎市公募公債	200,000,000	200,296,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	114,705,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	204,836,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	301,677,000	
地方債証券 合計		16,600,000,000	17,188,011,000	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	215,794,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,318,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	96,372,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	216,990,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	266,862,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	708,568,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	101,775,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	108,484,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	193,526,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	576,615,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,705,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,150,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	337,174,200	
	239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	331,353,000	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,690,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	229,736,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	802,320,000	
	319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	204,396,000	

28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	521,072,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	228,538,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	233,618,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	351,273,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	232,432,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,366,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	230,752,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	406,372,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	510,660,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	553,495,820	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,520,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	222,674,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,996,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	231,200,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	212,070,000	
165回 都市再生機構債券	100,000,000	96,584,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	232,480,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	412,968,500	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,290,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,875,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,729,000	34,355,347	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,700,000	24,283,968	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,535,000	36,414,491	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,851,000	39,059,960	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,602,000	9,621,107	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	48,380,000	48,461,278	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,520,000	12,955,570	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,532,000	49,870,027	

	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,441,000	37,526,577	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,815,000	61,428,210	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,650,000	135,449,642	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	201,216,000	212,667,202	
	1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	243,543,000	243,104,622	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,239,000	257,033,340	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,635,000	257,258,623	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,603,000	261,804,434	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,339,000	261,532,390	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	269,649,000	271,194,088	
	い第828号 利付商工債	100,000,000	100,214,000	
	3 6 9 回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	399,996,000	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	115,582,000	
	7 2 回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,674,000	
	8 5 回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,928,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	508,370,000	
特殊債券 合計		15,394,979,000	16,281,849,396	
社債券	1 回 B P C E S A 円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	199,992,000	
	6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	204,242,000	
	3 3 回 西日本高速道路債券	300,000,000	302,661,000	
	3 4 回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,426,000	
	1 9 回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,609,000	
	6 回 J X ホールディングス社債	100,000,000	102,330,000	
	1 4 回 プリヂェストン社債	200,000,000	199,530,000	
	2 3 回 ジェイ エフ イーホールディングス社債	100,000,000	99,932,000	
	1 3 回 パナソニック社債	100,000,000	100,490,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,510,000	
	1 6 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,108,000	
	9 4 回 丸紅社債	100,000,000	101,647,000	
	4 5 回 住友商事社債	100,000,000	101,138,000	
	4 7 回 住友商事社債	100,000,000	101,756,000	
	4 8 回 クレディセゾン社債	100,000,000	102,333,000	
	5 7 回 東京三菱銀行社債	200,000,000	207,142,000	
	1 0 回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,124,000	
	1 0 回 セブン銀行社債	100,000,000	101,444,000	



18回 NTTファイナンス社債	200,000,000	200,992,000	
47回 日立キャピタル社債	200,000,000	203,056,000	
56回 三菱UFJリース社債	200,000,000	201,644,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	107,418,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	199,610,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	106,970,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	98,985,000	
21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,101,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	324,651,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	217,824,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	234,098,000	
9回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	204,842,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	315,105,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	96,807,000	
11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	305,988,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	210,876,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,456,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	134,001,600	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	95,317,000	
518回 中部電力社債	200,000,000	200,458,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	303,135,000	
377回 中国電力社債	400,000,000	410,216,000	
301回 北陸電力社債	100,000,000	102,210,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	104,398,000	
471回 東北電力社債	400,000,000	411,996,000	
253回 四国電力社債	200,000,000	204,218,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	206,176,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	411,328,000	
321回 北海道電力社債	161,000,000	165,355,050	
340回 北海道電力社債	300,000,000	303,495,000	
350回 北海道電力社債	200,000,000	200,268,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	215,894,000	
38回 電源開発社債	300,000,000	307,404,000	
23回 東京瓦斯社債	300,000,000	306,468,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	102,577,000	
27回 NTTデータ社債	100,000,000	101,753,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,518,000	
社債券 合計	10,281,000,000	10,564,022,650	
合計		271,726,624,246	

## 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)

2021年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	384,688,857
コール・ローン	752,601,016
国債証券	134,780,848,944
派生商品評価勘定	14,491
未収入金	681,107,667
未収利息	810,243,402
前払費用	43,330,545
流動資産合計	137,452,834,922
資産合計	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	575,283,000
流動負債合計	575,283,000
負債合計	
575,283,000	
純資産の部	
元本等	
元本	68,826,099,673
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	68,051,452,249
元本等合計	136,877,551,922
純資産合計	
136,877,551,922	
負債純資産合計	
137,452,834,922	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年2月26日 至 2021年2月25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本となる重要な事項	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	2021年2月25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	66,694,972,797円
同期中追加設定元本額	22,323,922,904円
同期中一部解約元本額	20,192,796,028円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,267,562,231円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,005,013円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	17,901,375円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	15,827,367円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	58,667,541円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	48,715,853円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	24,440,185円
たわらノーロード 先進国債券	9,999,134,187円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	186,608,626円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	973,523,280円
たわらノーロード バランス（堅実型）	27,022,114円
たわらノーロード バランス（標準型）	125,740,293円
たわらノーロード バランス（積極型）	25,268,712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）	4,247,237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）	220,889,452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）	214,665,752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）	46,211,416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）	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	271,871円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,559,857円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,998,602円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,232,322円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,199,385円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,004,251,635円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	287,590,490円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	632,089,833円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,830,048,277円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,993,683,959円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	361,021,755円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	767,057,750円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	628,786,186円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	16,652,719円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	516,637,062円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	28,446,399円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,346,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	95,961,436円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	160,912,150円
クルーズコントロール	1,777,893,438円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	112,880,979円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	216,614,702円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	7,184,218円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	13,602,076円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	112,011,808円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	157,862,427円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,205,377円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,153,273,300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)	288,411,930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)	353,533,881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)	161,736,477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)	179,290,591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)	6,015,406,638円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	3,819,894,345円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,325,976,349円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,698,785,267円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	61,358,370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)	471,072,165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)	503,573,522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)	298,873,925円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	27,090,649円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	51,781,571円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,259,425円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,352,957円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	41,286,229円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	62,816,454円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,343,965,366円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,734,356,726円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,002,731,662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)	553,039,600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)	192,002,729円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,181,197,557円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	541,945,752円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,548,316円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	456,033,204円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	467,152,429円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	632,499,155円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	66,775,811円
計	68,826,099,673円
2. 受益権の総数	68,826,099,673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 2020年2月26日 至 2021年2月25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。リスク管理に関する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	2021年2月25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	2021年2月25日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	692,558,066	
合計	692,558,066	

(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(2021年2月23日から2021年2月25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	2021年2月25日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	750,000,000	-	749,985,509	14,491
イギリス・ポンド	363,426,000	-	363,425,999	1
ユーロ	75,160,000	-	75,159,999	1
合計	311,414,000	-	311,399,511	14,489
合計	750,000,000	-	749,985,509	14,491

(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。

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。

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)

	2021年2月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,9887円 (19,887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

2021年2月25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 0.125 01/15/24	7,000,000.000	6,978,671.910	
		US T N/B 0.125 04/30/22	1,000,000.000	1,000,351.500	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,998,359.360	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,598,437.480	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,997,421.860	
		US T N/B 0.125 08/31/22	4,000,000.000	4,000,468.720	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,997,109.360	
		US T N/B 0.125 11/30/22	5,340,000.000	5,341,460.110	
		US T N/B 0.125 12/15/23	1,000,000.000	997,460.930	
		US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	2,004,687.400	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,428,093.750	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,805,796.860	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,968,828.110	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	988,828.120	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	987,890.620	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,961,328.110	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,971,406.240	
		US T N/B 0.25 11/15/23	6,000,000.000	6,007,734.360	
		US T N/B 0.375 03/31/22	1,500,000.000	1,504,687.500	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,993,125.000	
		US T N/B 0.375 07/31/27	2,000,000.000	1,931,718.740	
		US T N/B 0.375 09/30/27	1,700,000.000	1,636,781.250	
		US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,566,325.760	
		US T N/B 0.375 12/31/25	1,000,000.000	989,609.370	
		US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	2,015,000.000	
		US T N/B 0.5 03/31/25	800,000.000	802,000.000	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,955,546.880	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,464,257.800	
		US T N/B 0.5 06/30/27	1,700,000.000	1,657,500.000	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,907,890.610	
		US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,775,742.190	
		US T N/B 0.625 05/15/30	4,000,000.000	3,757,812.480	
		US T N/B 0.625 08/15/30	6,210,000.000	5,811,201.560	
		US T N/B 0.625 11/30/27	2,000,000.000	1,952,500.000	
US T N/B 0.625 12/31/27	1,000,000.000	975,156.250			
US T N/B 0.875 11/15/30	6,400,000.000	6,113,000.000			
US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	1,028,125.000			

US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,118,820.230	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,788,937.500	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,100,000.000	3,476,671.870	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,180,000.000	3,279,667.200	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,518,537.500	
US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,403,768.730	
US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,097,343.720	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,558,393.750	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,540,000.000	3,681,301.520	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,137,984.370	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,546,406.250	
US T N/B 1.375 11/15/40	2,300,000.000	2,039,453.120	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,589,210.930	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,970,000.000	4,045,057.800	
US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,027,421.870	
US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,056,718.740	
US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,234,625.380	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,220,359.370	
US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	765,966.790	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,292,468.750	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	2,084,375.000	
US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,389,979.660	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,096,328.110	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,243,775.760	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,996,062.500	
US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,068,461.700	
US T N/B 1.625 08/15/29	2,380,000.000	2,459,209.370	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	1,992,476.550	
US T N/B 1.625 10/31/23	4,000,000.000	4,154,062.480	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,461,257.810	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,765,110.140	
US T N/B 1.625 11/15/50	2,900,000.000	2,508,953.120	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,020,000.000	1,067,971.870	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,136,014.030	
US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,115,874.590	
US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,509,054.660	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,712,928.120	
US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	847,669.910	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,404,696.870	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,872,770.310	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,386,992.180	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,940,000.000	2,022,450.000	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,683,124.990	
US T N/B 1.75 12/31/26	740,000.000	780,526.550	
US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,710,450.000	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,670,000.000	4,961,145.310	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,516,458.580	
US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,778,037.480	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,289,406.230	



US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,628,150.730	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,530,460.930	
US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,635,390.620	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,270,000.000	3,106,500.000	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	5,035,331.250	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,525,603.120	
US T N/B 2.0 11/15/26	2,640,000.000	2,821,500.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,809,838.240	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,373,226.550	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,314,600.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,150,000.000	5,511,304.680	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,204,871.080	
US T N/B 2.125 06/30/22	4,530,000.000	4,653,867.180	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,116,558.570	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	2,106,093.740	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,723,981.220	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	370,699.210	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,845,925.760	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,341,786.700	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,506,507.790	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	2,915,707.810	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,370,000.000	2,389,626.550	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,400,000.000	2,412,749.990	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	5,016,834.370	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,190,000.000	5,601,550.750	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,544,884.370	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	3,215,625.000	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,915,100.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,383,843.750	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	3,072,120.310	
US T N/B 2.375 08/15/24	3,920,000.000	4,200,218.730	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	2,856,346.070	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,148,320.310	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,208,050.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,087,276.550	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,788,066.390	
US T N/B 2.5 03/31/23	3,020,000.000	3,169,820.290	
US T N/B 2.5 05/15/24	4,240,000.000	4,544,418.720	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,810,000.000	1,916,761.580	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,579,313.250	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,396,296.870	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,572,053.860	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,800,000.000	1,890,000.000	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,342,324.200	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,925,360.920	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,269,418.750	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,513,990.620	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,715,675.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	4,886,547.610	

US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,814,717.170	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,631,229.680	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,461,601.560	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	867,025.000	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,474,630.450	
US T N/B 2.75 08/15/42	630,000.000	703,188.270	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,085,771.860	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,310,032.810	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,802,462.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	5,520,000.000	5,902,950.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,220,000.000	1,361,062.500	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,140,000.000	2,374,396.870	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	4,996,555.440	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,200,000.000	2,502,500.000	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	3,522,117.180	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,788,139.060	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	2,053,410.920	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,680,000.000	4,155,525.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,890,000.000	2,144,116.390	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	898,537.500	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,954,353.880	
US T N/B 2.875 11/15/46	2,020,000.000	2,291,753.120	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,640,000.000	1,903,681.240	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	2,953,345.280	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,577,509.370	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,138,790.620	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,630,000.000	1,887,616.390	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,290,000.000	1,497,810.930	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,210,000.000	3,736,891.370	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,568,514.830	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,137,949.990	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,790,000.000	2,073,323.430	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,240,000.000	1,437,140.610	
US T N/B 3.125 02/15/42	680,000.000	806,118.750	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,703,925.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,660,000.000	3,164,153.110	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	2,067,871.080	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,840,000.000	5,561,084.330	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	900,065.620	
US T N/B 3.375 05/15/44	2,030,000.000	2,493,886.700	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,660,000.000	3,311,076.530	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,121,835.920	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	2,078,504.680	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,670,000.000	2,128,467.180	
US T N/B 3.75 08/15/41	710,000.000	917,564.050	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,765,343.740	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,454,013.260	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,105,017.180	
US T N/B 4.25 11/15/40	510,000.000	700,492.960	

	US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	755,433.590	
	US T N/B 4.375 05/15/40	1,200,000.000	1,668,375.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,454,943.740	
	US T N/B 4.375 11/15/39	910,000.000	1,262,411.710	
	US T N/B 4.5 02/15/36	730,000.000	1,000,385.140	
	US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	753,089.050	
	US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,109,950.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,072,382.800	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,753,406.240	
	US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	728,007.810	
	US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	644,617.960	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,112,703.120	
	US T N/B 5.375 02/15/31	700,000.000	966,164.050	
	US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	857,796.870	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,062,600.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,205,789.050	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,020,846.870	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,150,429.680	
	アメリカ・ドル 小計	518,340,000.000 (54,975,140,400)	547,274,958.440 (58,043,982,096)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,200,000.000	1,187,760.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,503,145.200	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	500,000.000	500,242.800	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	973,140.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	750,000.000	704,587.500	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,450,000.000	1,394,813.580	
	UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,920,000.000	1,934,658.040	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	470,000.000	349,088.740	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,250,000.000	1,273,882.500	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	800,000.000	744,957.760	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,050,000.000	854,748.300	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,587,112.800	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	250,000.000	223,785.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	924,111.910	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,120,000.000	1,152,656.500	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,260,000.000	1,324,229.760	

UK TREASURY 1.25 10/22/41	880,000.000	866,286.430	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	957,398.940	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	910,000.000	934,231.830	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	1,004,287.640	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	520,000.000	554,521.760	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	580,000.000	665,386.900	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	890,000.000	966,275.840	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	910,000.000	1,013,928.540	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,571,699.840	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,556,046.130	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	854,252.280	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,245,875.860	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,369,863.600	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	524,701.440	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,310,000.000	1,798,184.600	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,836,889.600	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,706,521.320	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	940,000.000	1,509,433.950	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	870,000.000	1,573,788.580	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,330,000.000	1,904,693.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	810,000.000	1,101,899.050	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,379,156.170	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	977,915.640	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,458,079.870	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,721,228.420	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	990,000.000	1,666,424.430	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,835,026.920	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	760,000.000	1,092,519.600	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,280,000.000	2,048,287.730	

	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,140,000.000	1,569,663.720	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,380,694.290	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,684,222.440	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,071,887.280	
イギリス・ポンド 小計		49,370,000.000 (7,407,968,500)	60,034,194.030 (9,008,130,814)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	300,000.000	302,407.200	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	950,000.000	937,506.550	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,018,478.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	500,000.000	478,595.500	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,149,347.760	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,812,663.890	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,877,407.000	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,260,000.000	1,636,658.100	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,920,000.000	3,166,360.400	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,423,761.500	
イスラエル・シュケル 小計		15,670,000.000 (509,275,000)	17,803,185.900 (578,603,542)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,437,169.530	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,428,098.400	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,680,000.000	1,654,300.900	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,495,788.750	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,740,000.000	1,650,554.030	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,390,000.000	1,325,176.610	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,623,136.650	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,000,000.000	804,100.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,740,000.000	1,866,672.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,190,000.000	2,271,344.260	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,231,824.750	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,143,078.740	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	785,094.860	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	581,779.620	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,807,181.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,780,000.000	1,981,000.620	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,860,000.000	2,054,370.000		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	948,955.980		
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,720,000.000	3,035,564.060		

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,440,000.000	2,809,505.790	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	712,483.720	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	931,823.990	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,375,581.410	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	980,000.000	1,277,197.930	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,670,000.000	2,055,790.700	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,510,000.000	2,799,730.800	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	680,000.000	733,294.930	
オーストラリア・ドル 小計		41,700,000.000 (3,522,399,000)	44,820,600.030 (3,785,996,085)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	800,000.000	777,624.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	300,000.000	301,173.000	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,350,000.000	2,326,265.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,100,000.000	1,021,515.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	704,438.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	1,500,000.000	1,518,975.000	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	718,368.000	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,816,986.600	
	CANADA 1.5 05/01/22	920,000.000	934,793.600	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,244,122.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	827,696.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	3,160,000.000	3,257,960.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	720,000.000	771,364.800	
	CANADA 2.0 09/01/23	920,000.000	959,173.600	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,280,000.000	1,310,336.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	559,510.400	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,300,000.000	1,387,373.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	665,894.300	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,706,544.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,313,472.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	1,009,477.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	437,857.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	920,000.000	1,220,260.400	
CANADA 4.0 06/01/41	680,000.000	940,650.800		
CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	578,997.900		
CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,365,850.000		
CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,066,838.400		
カナダ・ドル 小計		29,460,000.000 (2,496,145,800)	31,743,515.800 (2,689,628,094)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.875 03/01/50	210,000.000	216,195.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	310,000.000	331,948.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	523,718.400	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	366,010.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	100,000.000	111,604.500	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	130,000.000	144,625.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	505,680.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	450,680.000	
SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	737,660.000		

	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	227,500.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	423,400.250	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	597,630.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	800,000.000	833,456.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	584,400.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	842,055.000	
シンガポール・ドル 小計		6,200,000.000 (498,604,000)	6,896,562.150 (554,621,528)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,200,000.000	2,150,244.030	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,611,148.000	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	1,970,000.000	2,058,610.600	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,499,299.900	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	8,200,000.000	8,603,654.840	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,180,000.000	6,883,358.160	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,825,081.200	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	3,000,000.000	3,145,695.000	
スウェーデン・クローナ 小計		30,610,000.000 (391,808,000)	33,777,091.730 (432,346,774)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	3,660,000.000	3,704,652.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	1,650,000.000	1,606,275.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,518,413.880	
	DENMARK 0.5 11/15/29	2,670,000.000	2,825,661.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	2,300,000.000	2,429,404.900	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,877,058.260	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,050,000.000	14,450,690.230	
デンマーク・クローネ 小計		30,780,000.000 (533,725,200)	38,412,155.270 (666,066,772)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,724,740.700	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,876,449.720	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,000,000.000	1,039,301.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,945,160.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,700,000.000	1,758,701.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,189,128.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,000,000.000	1,034,070.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,650,988.000	
ノルウェー・クローネ 小計		23,270,000.000 (294,365,500)	24,218,538.920 (306,364,517)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 07/25/22	1,200,000.000	1,199,903.640	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,850,000.000	2,810,843.440	
	POLAND 2.25 04/25/22	1,500,000.000	1,539,860.400	
	POLAND 2.25 10/25/24	600,000.000	640,119.060	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,982,468.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,449,919.160	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,080,000.000	2,274,572.140	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,280,000.000	2,505,295.230	

	POLAND 2.75 04/25/28	3,010,000.000	3,359,009.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	235,578.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,659,863.010	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,940,000.000	4,344,244.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,961,064.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	1,720,000.000	1,875,642.800	
ポーランド・ズロチ 小計		28,350,000.000 (811,093,500)	30,838,382.380 (882,286,120)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,067,585.800	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,258,434.630	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,128,521.800	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	600,000.000	603,290.640	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,219,786.600	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	859,694.960	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,593,483.590	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,360,441.340	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	2,012,407.920	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,315,192.080	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	2,912,663.780	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,233,960.200	
マレーシア・リングgit 小計		21,930,000.000 (575,443,200)	23,565,463.340 (618,357,758)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	20,000,000.000	21,019,600.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,795,763.050	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	26,797,726.200	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	15,381,293.850	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	7,830,000.000	8,063,336.340	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	20,193,104.630	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,310,825.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	14,976,455.900	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,878,979.500	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	10,000,000.000	11,124,600.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	9,254,000.000	10,398,997.420	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,371,440.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	20,244,272.150	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	8,125,000.000	9,615,207.060	



メキシコ・ペソ 小計		180,572,000.000 (938,974,400)	203,171,601.100 (1,056,492,326)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	840,000.000	850,624.320	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	202,697.400	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	200,000.000	187,040.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	360,610.800	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	550,057.560	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	883,208.880	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	180,000.000	192,128.760	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	680,000.000	726,796.920	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	170,000.000	167,726.420	
	AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	659,457.500	
	AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	815,804.800	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	474,732.900	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	692,094.010	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	520,000.000	656,226.480	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	207,465.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	584,691.480	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	750,000.000	797,352.750	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	380,000.000	671,138.520	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	626,847.450	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	470,000.000	766,728.620	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	792,237.340	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	280,000.000	293,748.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	454,646.850	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,448,119.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	752,386.290	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	958,562.300	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	500,000.000	511,058.000	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	816,400.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	674,883.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	320,000.000	314,557.760	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	551,146.470	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,206,452.880	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	850,000.000	913,265.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	880,000.000	951,368.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,010,000.000	1,100,884.850	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,020,000.000	1,099,917.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	895,131.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	808,509.660	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	230,000.000	270,002.750	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	640,000.000	778,031.360	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	490,000.000	612,905.720	
BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	689,284.200		
BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	614,796.000		
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	886,345.380		
BELGIUM 2.25 06/22/57	420,000.000	604,863.750		
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,162,838.250		
BELGIUM 3.0 06/22/34	670,000.000	918,836.660		

BELGIUM 3.75 06/22/45	650,000.000	1,106,345.500	
BELGIUM 4.0 03/28/22	420,000.000	441,303.240	
BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	764,018.850	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,060,000.000	1,818,938.800	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,283,572.310	
BELGIUM 4.5 03/28/26	820,000.000	1,030,327.540	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,817,213.120	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,757,909.560	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,284,306.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,300,000.000	1,338,506.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	300,000.000	309,138.000	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,573,610.500	
BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,045,513.240	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,415,589.000	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,303,987.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,158,187.050	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,747,324.800	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	800,000.000	824,096.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,100,000.000	1,112,045.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,064,140.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	518,015.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,070,000.000	1,004,925.810	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,500,000.000	1,552,380.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,057,882.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,900,000.000	2,007,308.200	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,519,804.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,860,000.000	1,947,624.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,912,862.300	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,430,000.000	1,532,988.600	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,300,000.000	2,458,619.500	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,736,196.000	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,910,000.000	1,976,949.320	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,419,833.980	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,902,219.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,620,000.000	2,085,663.470	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,482,415.390	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,731,484.420	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,410,000.000	1,510,929.210	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,705,520.190	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,611,033.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,590,688.330	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	4,550,000.000	4,857,639.150	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,748,697.600	

DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,750,000.000	2,794,982.570	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,100,000.000	1,854,061.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,790,000.000	2,961,153.310	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	2,039,346.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	837,564.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,420,000.000	2,370,789.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,180,000.000	2,270,862.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,970,248.400	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,660,748.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,008,529.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,139,003.300	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,035,740.900	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	183,910.500	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	172,066.180	
FINLAND 0.125 04/15/36	210,000.000	208,317.060	
FINLAND 0.25 09/15/40	170,000.000	168,456.400	
FINLAND 0.5 04/15/26	430,000.000	452,332.910	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	317,758.800	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	254,611.200	
FINLAND 0.5 09/15/29	570,000.000	604,925.610	
FINLAND 0.75 04/15/31	380,000.000	413,034.920	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	319,689.900	
FINLAND 04/15/22	120,000.000	120,874.920	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	233,855.510	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	329,715.500	
FINLAND 1.375 04/15/47	130,000.000	162,711.510	
FINLAND 1.5 04/15/23	340,000.000	355,708.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	414,340.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	303,444.170	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	519,141.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	467,287.140	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	516,886.660	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,235,057.550	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,113,805.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	1,500,000.000	1,533,859.500	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,450,000.000	2,476,114.550	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,200,000.000	2,208,076.200	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,850,000.000	3,994,983.300	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,620,000.000	2,734,913.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,173,458.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,140,000.000	2,259,709.460	

FRANCE OAT 0.5 05/25/40	700,000.000	703,596.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	300,000.000	246,438.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,750,000.000	2,953,659.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,380,000.000	1,374,159.840	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,340,000.000	2,518,074.000	
FRANCE OAT 02/25/22	690,000.000	694,207.680	
FRANCE OAT 03/25/23	2,700,000.000	2,735,465.040	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,769,145.220	
FRANCE OAT 03/25/25	2,470,000.000	2,523,292.720	
FRANCE OAT 05/25/22	2,190,000.000	2,207,526.570	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,650,000.000	1,791,487.500	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,378,059.560	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,340,000.000	2,665,524.420	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	2,516,529.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,569,756.490	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,870,000.000	2,257,632.300	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,130,000.000	3,298,090.390	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	940,000.000	1,241,568.920	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,990,000.000	2,472,614.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,914,625.960	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,251,274.350	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,163,686.580	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,030,000.000	2,127,949.530	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,940,000.000	3,650,950.800	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,780,000.000	3,358,823.800	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,350,000.000	2,449,992.500	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,800,000.000	2,891,682.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,407,829.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,060,000.000	2,085,126.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,244,935.660	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,473,344.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,730,000.000	3,088,388.940	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,180,000.000	3,888,165.160	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,650,000.000	2,704,861.500	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,740,873.900	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,260,000.000	3,766,665.160	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,355,091.200	
IRISH 0.0 10/18/31	360,000.000	357,300.000	
IRISH 0.2 05/15/27	280,000.000	289,181.200	
IRISH 0.2 10/18/30	260,000.000	265,295.160	
IRISH 0.4 05/15/35	240,000.000	244,942.320	
IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	375,237.120	
IRISH 0.9 05/15/28	430,000.000	465,654.310	
IRISH 1.0 05/15/26	980,000.000	1,052,350.460	
IRISH 1.1 05/15/29	380,000.000	418,900.600	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	387,652.360	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	238,781.970	
IRISH 1.5 05/15/50	400,000.000	483,099.390	
IRISH 1.7 05/15/37	400,000.000	486,077.200	

IRISH 10/18/22	220,000.000	222,062.940	
IRISH 2.0 02/18/45	560,000.000	740,534.480	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	773,977.680	
IRISH 3.4 03/18/24	510,000.000	571,922.160	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	622,892.010	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	992,564.800	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	1,005,300.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,013,500.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,097,976.600	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	300,000.000	306,257.400	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,003,344.580	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,400,000.000	1,452,150.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,000,000.000	1,020,192.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	997,257.800	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	943,046.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	600,000.000	584,100.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,097,820.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,205,919.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	600,000.000	624,960.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	783,028.400	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,432,981.800	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,613,065.050	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	980,000.000	998,801.300	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,072,836.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,422,923.220	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	900,000.000	925,084.800	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,099,966.400	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,799,503.550	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,185,250.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,190,000.000	2,392,618.800	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,618,932.040	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	700,000.000	710,439.100	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,275,900.000	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	600,000.000	645,780.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	862,974.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	972,270.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,547,726.080	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,060,436.980	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	940,000.000	1,046,107.200	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,630,000.000	1,801,888.390	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	920,000.000	1,031,136.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,187,790.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,600,000.000	1,890,960.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	870,000.000	1,041,825.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	995,355.750	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,395,553.750	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,283,828.130	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,274,286.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	747,825.000	

ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,200,000.000	1,415,890.800	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,205,080.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,602,648.670	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	810,000.000	1,052,554.500	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,351,913.310	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,090,000.000	1,420,880.400	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,446,070.320	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,935,780.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,010,000.000	1,147,360.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	840,000.000	1,275,271.200	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,347,074.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,090,000.000	1,243,929.800	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,989,578.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,546,731.200	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,135,220.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,390,000.000	1,834,077.200	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,604,209.280	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,792,650.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,153,645.660	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,423,855.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,152,206.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,150,000.000	1,876,455.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,750,000.000	2,452,100.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,251,297.750	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,150,943.200	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,993,600.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,474,109.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,518,888.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,513,404.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,485,715.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	460,000.000	472,750.740	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	570,000.000	518,978.160	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	950,000.000	970,522.850	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,057,587.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	826,808.470	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	590,000.000	630,930.660	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	993,157.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	700,000.000	754,028.800	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	850,000.000	921,967.800	
NETHERLANDS 01/15/24	830,000.000	846,020.660	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,110,000.000	2,233,013.410	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	894,013.200	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	980,000.000	1,019,714.880	

NETHERLANDS 2.5 01/15/33	780,000.000	1,024,642.320	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	960,000.000	1,574,995.200	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	390,000.000	422,721.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,060,000.000	1,850,753.640	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,543,275.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,202,624.200	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,416,240.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	500,000.000	505,195.500	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	999,900.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	600,000.000	582,624.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	940,000.000	960,345.830	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,420,000.000	1,447,576.400	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,586,233.800	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,361,406.500	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,150,000.000	1,173,010.350	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,480,000.000	1,528,052.640	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,263,240.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	870,000.000	811,396.800	
SPAIN 1.2 10/31/40	970,000.000	1,005,815.310	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,770,000.000	1,921,158.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,550,000.000	1,677,661.100	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,240,000.000	1,360,406.480	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,210,000.000	1,328,096.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,291,910.250	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,480,000.000	1,623,487.480	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,327,612.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,565,636.050	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,290,000.000	1,490,704.650	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,411,654.530	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,684,428.280	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,536,595.500	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,504,120.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,159,667.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,716,507.100	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,634,859.320	
SPAIN 3.45 07/30/66	960,000.000	1,535,656.320	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,441,259.500	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,380,000.000	2,093,139.840	
SPAIN 4.4 10/31/23	480,000.000	543,022.460	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,671,083.530	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,270,000.000	2,143,074.200	
SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,304,837.210	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,996,371.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	1,180,000.000	1,633,238.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	830,000.000	1,532,814.950	
SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,626,454.600	

	SPAIN 5.75 07/30/32	1,520,000.000	2,414,988.300	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,810,000.000	1,917,466.940	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,170,000.000	1,556,455.910	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,312,021.260	
	ユーロ 小計	367,550,000.000 (47,395,572,500)	435,501,919.490 (56,157,972,518)	
国債証券 合計		120,350,515,000 (120,350,515,000)	134,780,848,944 (134,780,848,944)	
合計			134,780,848,944 (134,780,848,944)	

(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 202銘柄	42.41	43.07
イギリス・ポンド	国債証券 49銘柄	6.58	6.68
イスラエル・シケル	国債証券 10銘柄	0.42	0.43
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	2.77	2.81
カナダ・ドル	国債証券 27銘柄	1.96	2.00
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	0.41	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.32	0.32
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.49	0.49
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.22	0.23
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.64	0.65
マレーシア・リングギット	国債証券 12銘柄	0.45	0.46
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.77	0.78
ユーロ	国債証券 322銘柄	41.03	41.67

(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。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 1 安定型

2021年2月26日現在

資産総額	16,011,562,596円
負債総額	41,595,989円
純資産総額( - )	15,969,966,607円
発行済数量	9,304,901,390口
1口当たり純資産額( / )	1.7163円

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 2 安定・成長型

2021年2月26日現在

資産総額	32,991,552,669円
負債総額	41,520,369円
純資産総額( - )	32,950,032,300円
発行済数量	15,437,582,110口
1口当たり純資産額( / )	2.1344円

## D I A Mバランス・ファンド&lt; D C年金&gt; 3 成長型

2021年2月26日現在

資産総額	25,831,863,827円
負債総額	39,444,783円
純資産総額( - )	25,792,419,044円
発行済数量	10,023,674,099口
1口当たり純資産額( / )	2.5732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

2021年2月26日現在

資産総額	307,016,757,695円
負債総額	1,689,421,321円
純資産総額( - )	305,327,336,374円
発行済数量	100,942,358,488口
1口当たり純資産額( / )	3.0248円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年2月26日現在

資産総額	471,505,370,135円
負債総額	597,136,552円
純資産総額( - )	470,908,233,583円
発行済数量	101,267,356,072口
1口当たり純資産額( / )	4.6501円

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年2月26日現在

資産総額	278,054,068,482円
負債総額	5,222,885,100円
純資産総額( - )	272,831,183,382円
発行済数量	210,914,619,905口
1口当たり純資産額( / )	1.2936円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年2月26日現在

資産総額	136,398,520,767円
負債総額	1,037,610,604円
純資産総額( - )	135,360,910,163円
発行済数量	68,447,315,049口
1口当たり純資産額( / )	1.9776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。

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

## (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2021年2月26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（2021年2月26日現在）

###### 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。

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年2月26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	1,570,560,416,431
追加型株式投資信託	851	15,220,981,170,031
単位型公社債投資信託	32	72,197,313,686
単位型株式投資信託	204	1,266,892,227,814
合計	1,113	18,130,631,127,962

### 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。  
また、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）、ならびに同規則第38条及び第57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．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千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、第35期事業年度（自2019年4月1日至2020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、第36期中間会計期間（自2020年4月1日至2020年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
建物	1 1,096,916	1 1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
ソフトウェア仮勘定	1,522,040	221,784
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
長期差入保証金	4,499,196	5,299,196
繰延税金資産	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859



(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			-	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	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	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
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	<p>(1) 有形固定資産 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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
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	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>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。</p> <p>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、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

**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

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自2018年4月1日至2019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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類 株式				

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種 類株式					

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21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  
2020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(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020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あります。

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あります。

有価証券及び投資有価証券は、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あります。

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

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おります。

有価証券及び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おります。

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。

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あります。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。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

第34期(2019年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

第35期(2020年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

**負債**

## (1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (注3) 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34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

## 第35期(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 2. その他有価証券

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

(注)非上場株式(貸借対照表計上額276,764千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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			
株式	-	-	-
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			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

(注) 投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、償還によるものであります。

## (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

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

## (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

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

## (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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

## 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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

## (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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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  
 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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## （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

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、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	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
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	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(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	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

## (2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

(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。

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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

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。

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。

## ( 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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
	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	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
								子会社株式 の取得	10,294,840	未払 手数料	1,231,431
	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

## 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) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,281,363
金銭の信託		25,870,423
有価証券		996
未収委託者報酬		13,747,204
未収運用受託報酬		3,023,356
未収投資助言報酬		304,673
未収収益		24,940
前払費用		757,672
その他		2,912,168
	流動資産計	73,922,799
固定資産		
有形固定資産		1,199,340
建物	1	961,771
器具備品	1	237,569
無形固定資産		3,660,076
ソフトウェア		3,099,921
ソフトウェア仮勘定		556,224
電話加入権		3,931
投資その他の資産		9,943,868
投資有価証券		261,361
関係会社株式		5,299,196
長期差入保証金		1,295,930
繰延税金資産		2,294,343
その他		793,037
	固定資産計	14,803,286
	資産合計	88,726,085

(単位:千円)

	第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,297,202
未払金	5,820,782
未払収益分配金	899
未払償還金	19,850
未払手数料	5,549,722
その他未払金	250,310
未払費用	7,902,650
未払法人税等	2,901,506
未払消費税等	824,900
前受収益	20,779
賞与引当金	1,126,713
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	19,928,648
固定負債	
退職給付引当金	2,207,043
時効後支払損引当金	156,886
固定負債計	2,363,929
負債合計	22,292,578
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	44,880,558
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	44,757,265
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	13,077,265
株主資本計	66,433,515
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	8
評価・換算差額等計	8
純資産合計	66,433,506
負債・純資産合計	88,726,085



## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	40,520,928	
運用受託報酬	6,813,891	
投資助言報酬	548,146	
その他営業収益	773,786	
	営業収益計	48,656,752
営業費用		
支払手数料	16,685,574	
広告宣伝費	116,359	
調査費	12,452,140	
調査費	4,305,114	
委託調査費	8,147,025	
委託計算費	269,176	
営業雑経費	450,999	
通信費	24,247	
印刷費	314,201	
協会費	20,394	
諸会費	32,852	
支払販売手数料	59,302	
	営業費用計	29,974,250
一般管理費		
給料	4,693,004	
役員報酬	75,939	
給料・手当	4,496,351	
賞与	120,714	
交際費	5,108	
寄付金	6,331	
旅費交通費	20,383	
租税公課	277,754	
不動産賃借料	734,008	
退職給付費用	267,068	
固定資産減価償却費	1 534,020	
福利厚生費	17,379	
修繕費	511	
賞与引当金繰入額	1,126,713	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	139	
事務委託費	1,899,643	
事務用消耗品費	35,787	
器具備品費	265	
諸経費	66,792	
	一般管理費計	9,719,026
営業利益		8,963,474

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	17,653	
受取配当金	2,356	
時効成立分配金・償還金	176	
時効後支払損引当金戻入額	16,343	
為替差益	8,484	
金銭の信託運用損益	1,367,091	
雑収入	1,361	
営業外収益計		1,413,467
経常利益		10,376,942
特別損失		
固定資産除却損	0	
特別損失計		0
税引前中間純利益		10,376,942
法人税、住民税及び事業税		2,957,106
法人税等調整額		213,661
法人税等合計		3,170,767
中間純利益		7,206,174

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,000,000
中間純利益							7,206,174
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,793,825
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	13,077,265

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	49,674,383	71,227,341	7	7	71,227,333
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,000,000	12,000,000			12,000,000
中間純利益	7,206,174	7,206,174			7,206,174
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,793,825	4,793,825	0	0	4,793,826
当中間期末残高	44,800,558	66,433,515	8	8	66,433,506

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
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	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28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 …… 6～18年 器具備品 …… 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
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、中間決算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	<p>(1) 賞与引当金は、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中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、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中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 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中間会計期間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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	365,042千円
	器具備品	980,577千円

## （中間損益計算書関係）

項目	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	79,115千円
	無形固定資産	454,905千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30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）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2020年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、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。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,281,363	27,281,363	-
(2) 金銭の信託	25,870,423	25,870,423	-
(3) 未収委託者報酬	13,747,204	13,747,204	-
(4) 未収運用受託報酬	3,023,356	3,023,356	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,987	2,987	-
資産計	69,925,335	69,925,335	-
(1) 未払手数料	5,549,722	5,549,722	-
負債計	5,549,722	5,549,722	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

#### 資 産

(1) 現金・預金

これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## 負債

## (1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	259,369
関係会社株式	5,299,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (有価証券関係)

第36期中間会計期間末

(2020年9月30日現在)

## 1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間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	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	2,987	3,000	12
小計	2,987	3,000	12
合計	2,987	3,000	12

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## （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

MHAM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、TB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、DIAM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」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」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IA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」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」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2020年4月1日から2020年9月30日まで

## (2) 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 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

## (4) 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 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(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。

## (5) 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 53,030,000千円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

## 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

流動資産	- 千円
固定資産	90,405,440千円
資産合計	90,405,440千円
流動負債	- 千円
固定負債	7,722,834千円
負債合計	7,722,834千円
純資産	82,682,605千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額60,979,870千円及び顧客関連資産の金額32,301,694千円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,411,813千円
経常利益	4,411,813千円
税引前中間純利益	4,411,813千円
中間純利益	3,644,417千円
1株当たり中間純利益	91,110円42銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,508,336千円が含まれております。

## (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。

(セグメント情報等)

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

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

(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

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。

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。

(1株当たり情報)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,660,837円67銭
1株当たり中間純利益金額	180,154円36銭

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

1株当たり中間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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益金額	7,206,174千円
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中間純利益金額	7,206,174千円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって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。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2020年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
労働金庫連合会	( 1 ) 120,000	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央機関です。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

( 1 ) 出資の総額

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2)信託財産の計算
- (3)信託財産に関する報告書の作成
- (4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）・運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・ 金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・ 詳細情報の入手方法  
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など  
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・ 目論見書の使用開始日
- ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。  
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法  
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・ 投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2020年5月27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 山野 浩 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

## 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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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2020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。

## 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。

#### 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) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年4月2日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の2020年2月26日から2021年2月25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バランス・ファンド<DC年金>1安定型の2021年2月25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。

## 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）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年4月2日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2020年2月26日から2021年2月25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バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2021年2月25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。

### 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、継続企業的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。継続企業的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）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年4月2日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の2020年2月26日から2021年2月25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バランス・ファンド<DC年金>3成長型の2021年2月25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。

### 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）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年11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	丘本 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 印

#### 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、「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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、アセットマネジメントOne株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)の経営成績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、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、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。

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。

#### 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、企業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、監査等委員会に対して、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

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) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。