

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年11月25日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【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
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【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】	D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型 D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型 D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型
【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】	各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	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」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。))をいいます。以下同じ。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下、「委託会社」といいます。)は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金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：2022年11月26日から2023年5月26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】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(1 1) 【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

(1 2) 【その他】

お申込みの方法

お申込みには、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^(注)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。

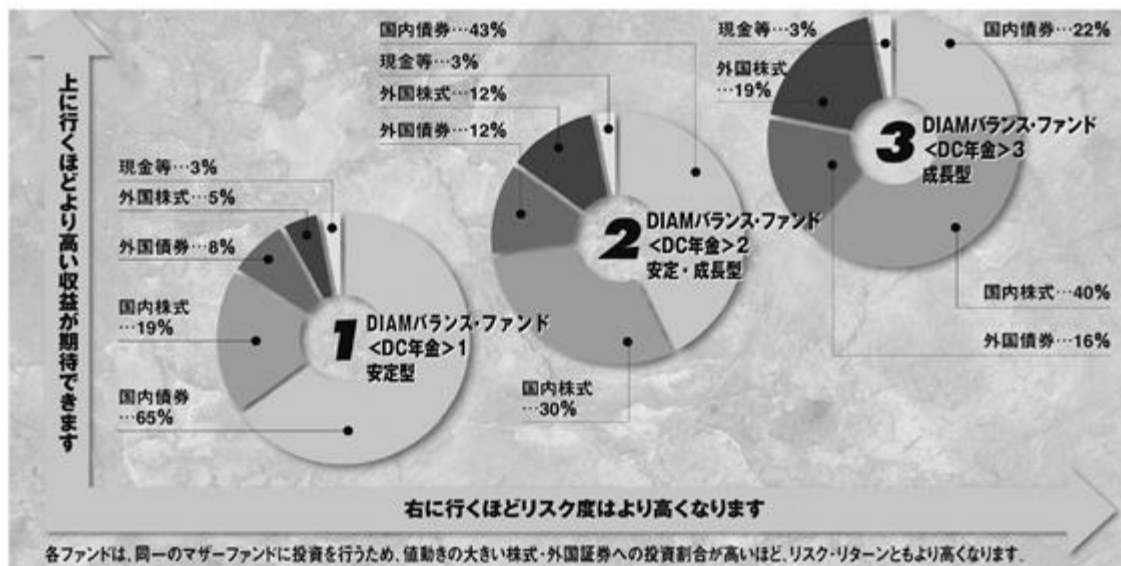
(注)委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて合成したものです。

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
比較的リスクの低い資産(国内債券)を中心に組入れ、安定運用を行います。
- DIAM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<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」

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
追加型投信	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		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<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」

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 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	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)
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。

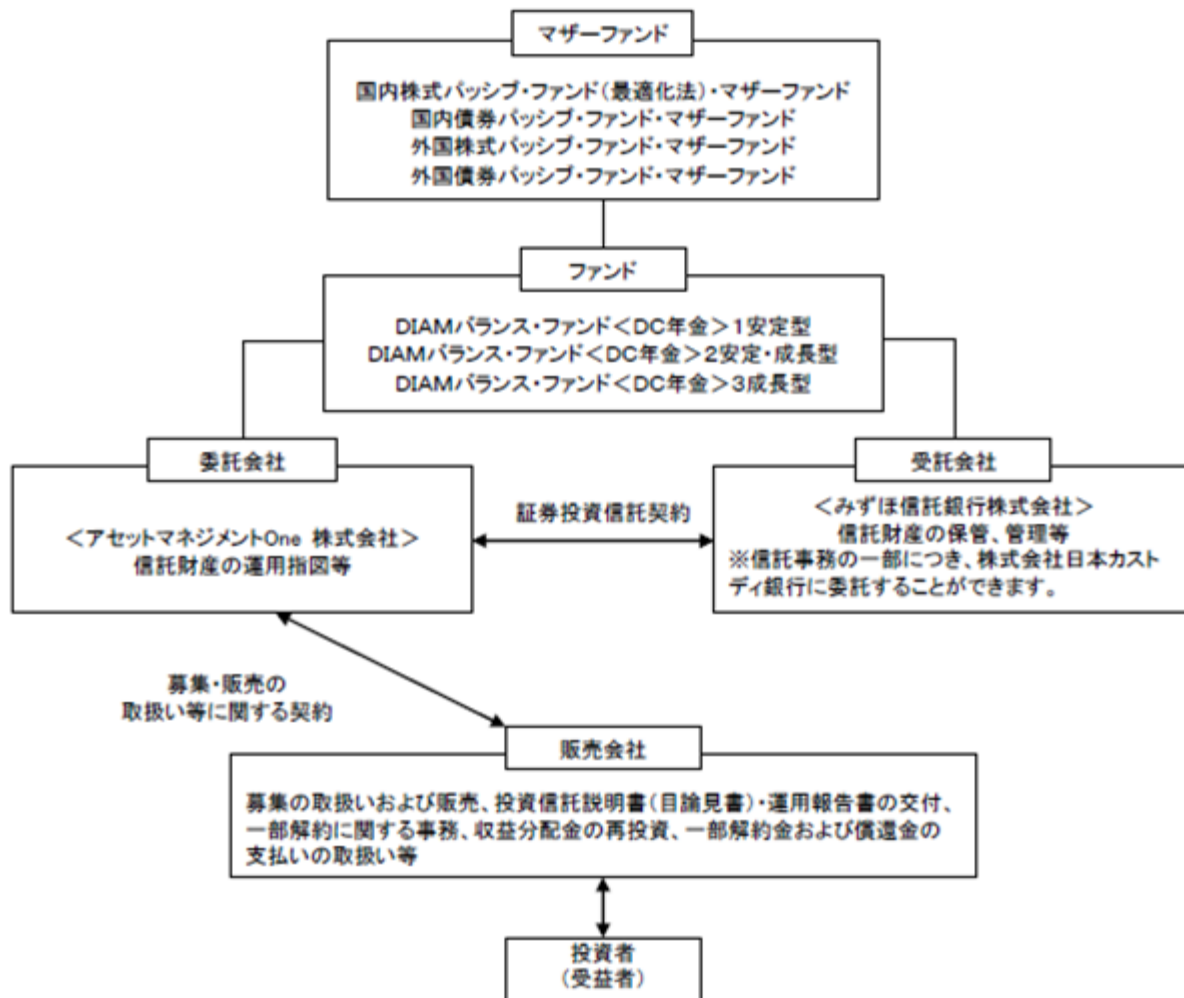
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

（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

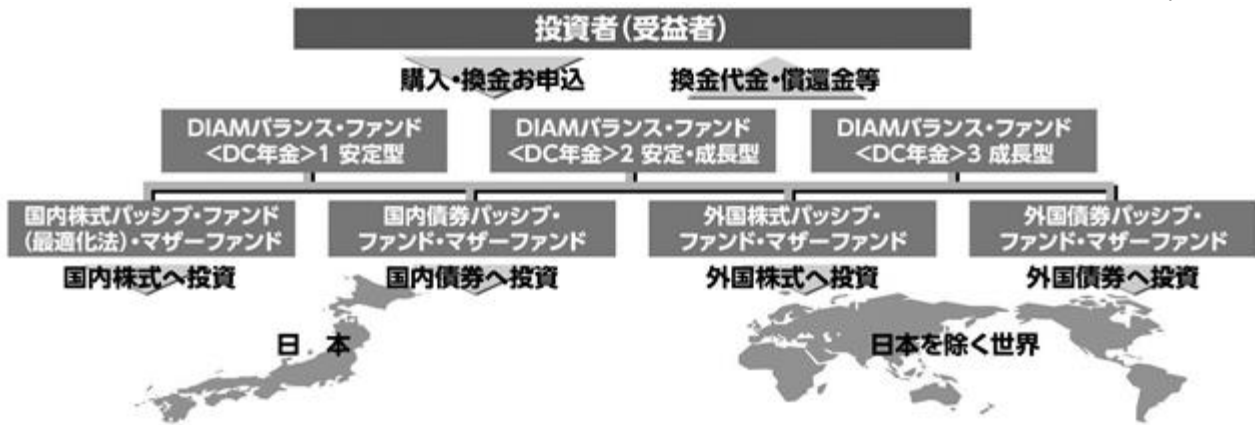
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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（2022年8月31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ルユ・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

（2022年8月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種類株式（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)^(注1)、国内債券についてはNOMURA-BPI総合^(注2)、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)^(注3)、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)^(注4)、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)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)のに関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

(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、またはその他の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す。)
- (21) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- (22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- (23) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- (24) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- (25) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- (26) 外国の者に対する権利で上記(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）

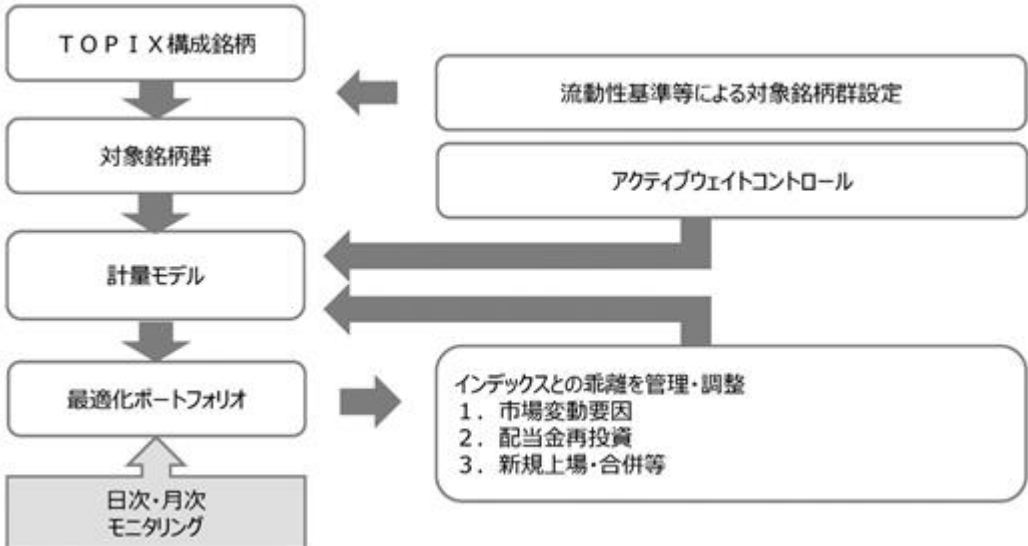
委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

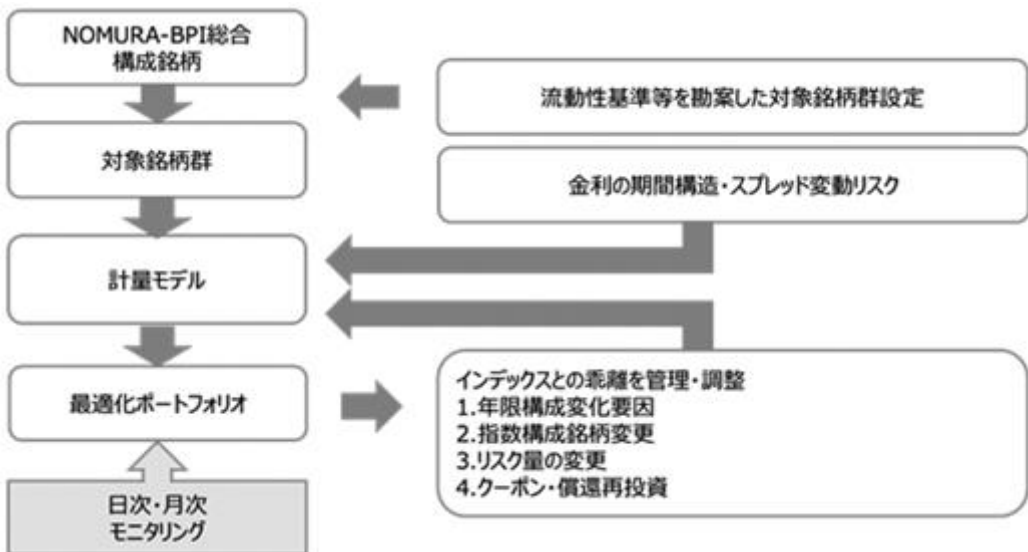
- (1) 預金
- (2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形
- (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

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

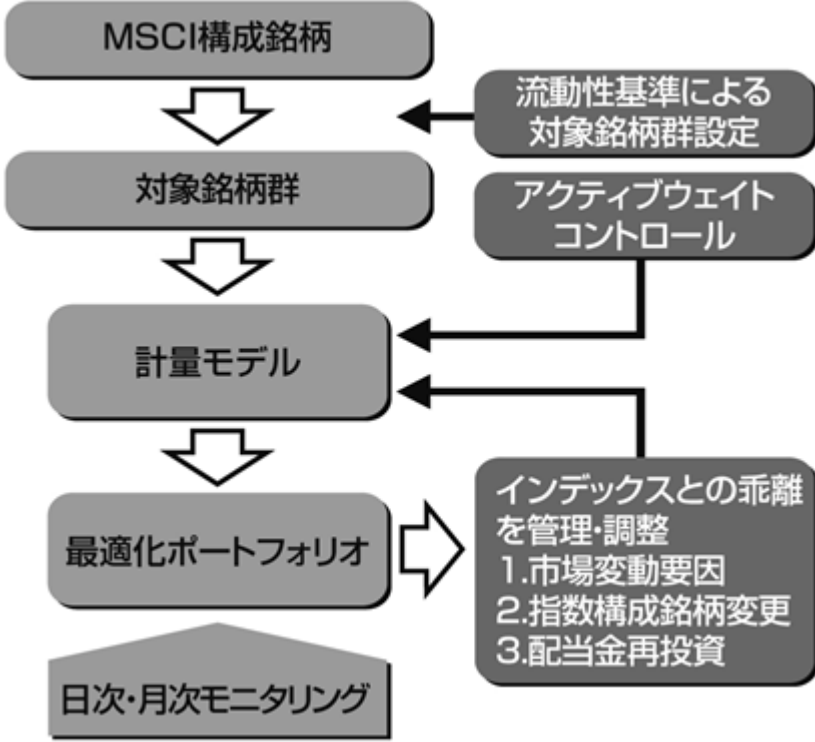
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

運用プロセス	<p>1)流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。</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。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。</p> <p>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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 
主な投資制限	<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>

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。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資 

<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、</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>
---------------	--

<p>ファンド名</p>	<p>外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の株式を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス	<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"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[アクティブウェイトコントロール] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> F F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
--------	--

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"> 1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

運用プロセス

1)流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2)最適化法によるポートフォリオの構築

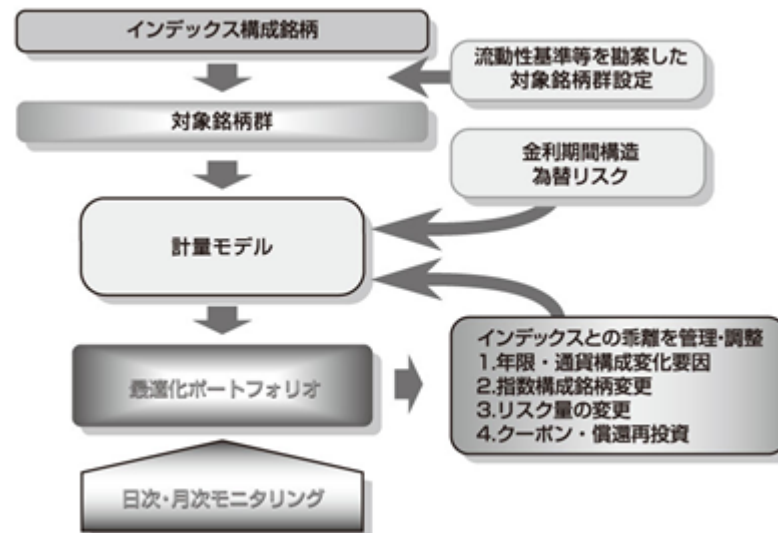
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3)インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン・償還再投資

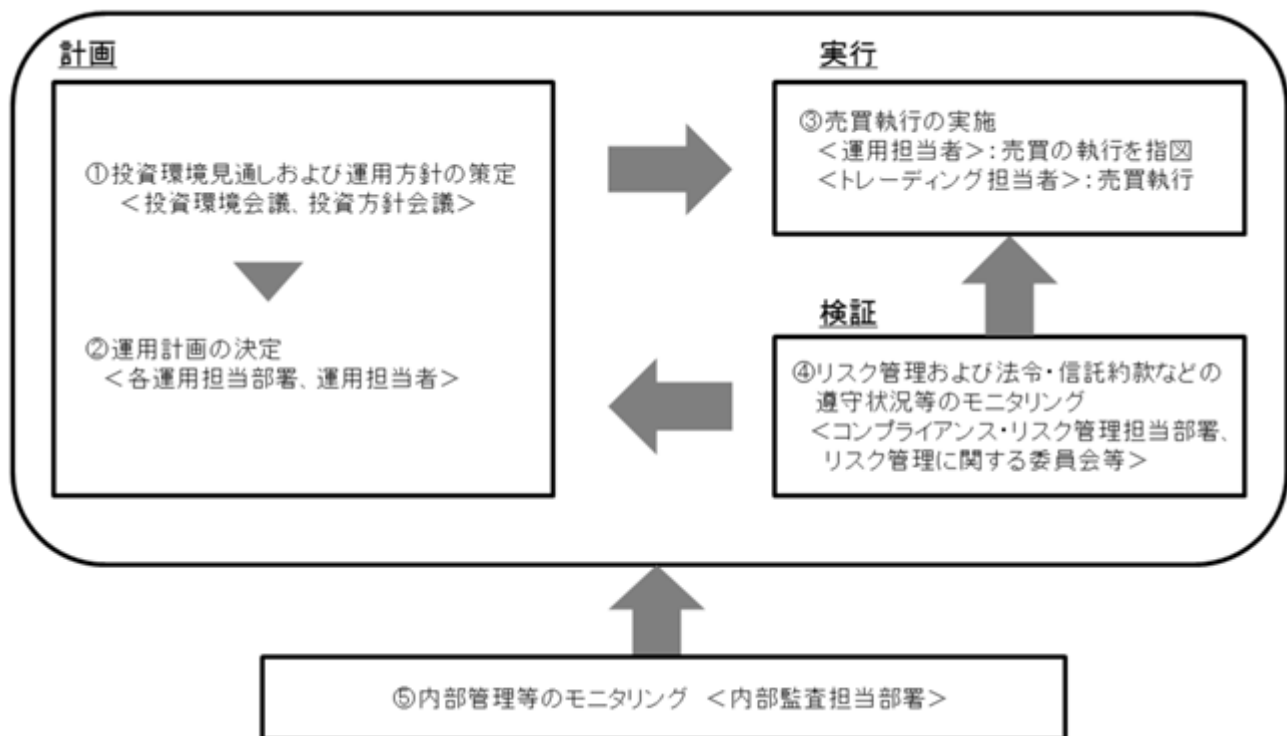


<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動によ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。

定期的で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

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2022年8月31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、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2)売買損益に評価損益を加減した利益金額(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るものとします。

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

- 1)信託財産に属する株券および新株引受権証券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せん。)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

外貨建て、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はその必要性を認めるときあるいは担保の受入れが必要と委託会社が認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(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委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。

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことと、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が、各マザーファンドが各対象インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流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。

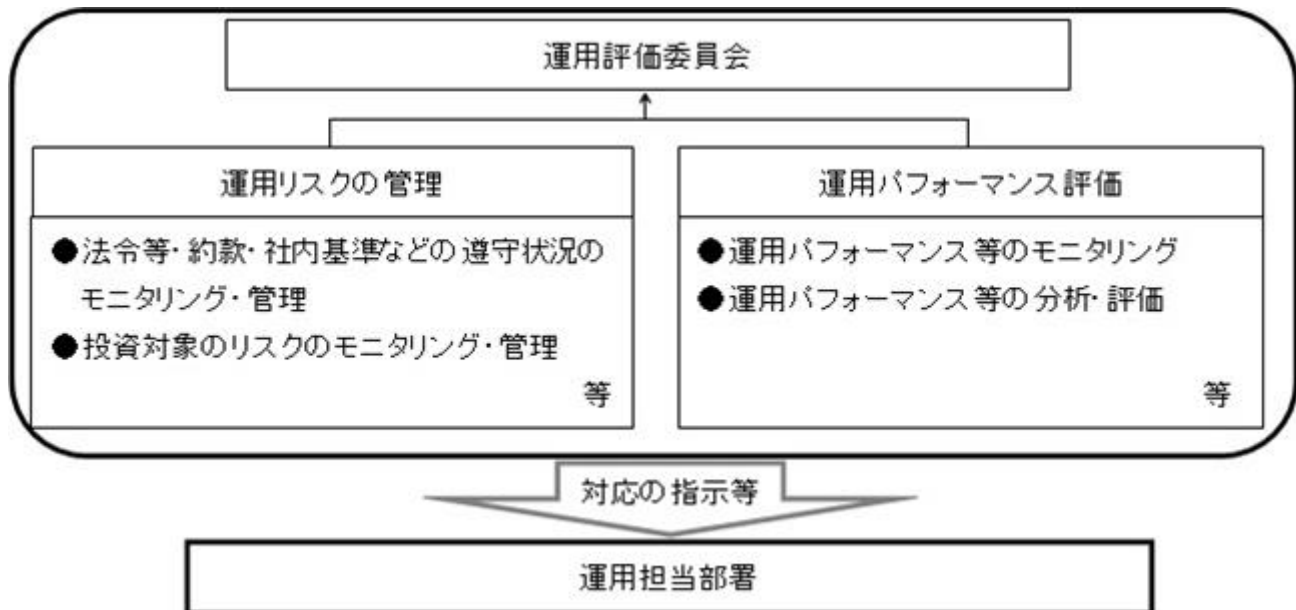
注意事項

- 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。
- ・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



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

リスク管理体制は2022年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

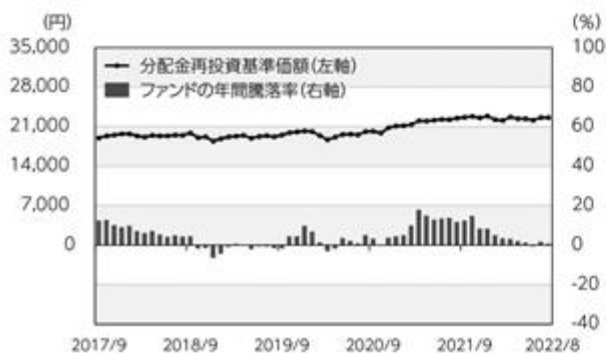
<参考情報>

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



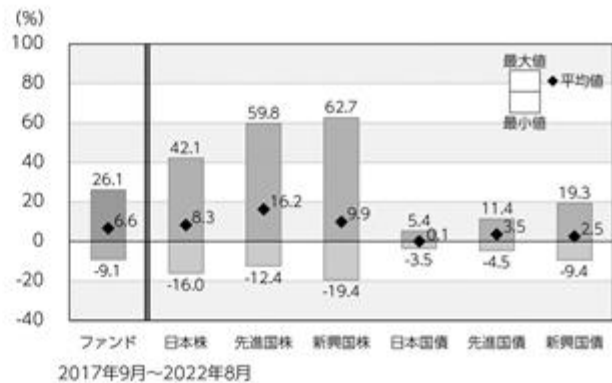
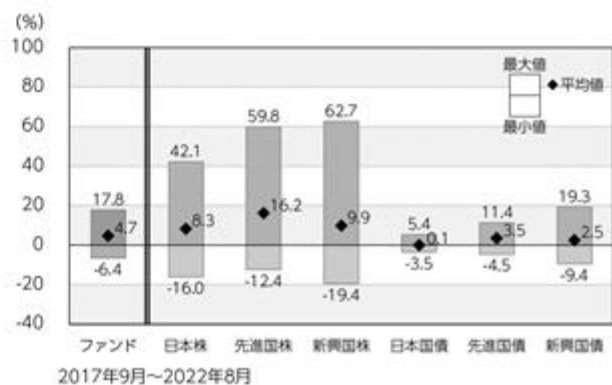
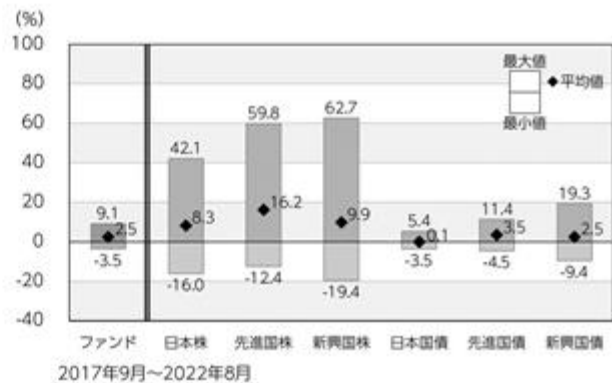
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型



*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、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村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	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬 税込（税抜）			
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】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

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、2022年8月末現在のもので、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<DC年金>1安定型

2022年8月31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	18,013,690,212	97.00
内 日本	18,013,690,212	97.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	557,879,397	3.00
純資産総額	18,571,569,609	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<DC年金>2安定・成長型

2022年8月31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	38,185,265,084	96.99
内 日本	38,185,265,084	96.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,185,933,463	3.01
純資産総額	39,371,198,547	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<DC年金>3成長型

2022年8月31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	31,457,960,644	96.98
内 日本	31,457,960,644	96.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	979,598,715	3.02
純資産総額	32,437,559,359	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

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	445,744,949,460	98.00
内 日本	445,744,949,460	98.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,113,217,945	2.00
純資産総額	454,858,167,405	100.00

その他資産の投資状況

2022年8月31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)	9,162,540,000	2.01
内 日本	9,162,540,000	2.01

(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

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	729,535,261,637	94.58
内 アメリカ	521,330,536,617	67.59
内 イギリス	31,342,669,843	4.06
内 カナダ	28,441,832,211	3.69
内 スイス	24,250,397,588	3.14
内 フランス	21,909,220,910	2.84
内 オーストラリア	16,298,661,376	2.11
内 ドイツ	15,706,794,598	2.04
内 アイルランド	12,925,234,640	1.68
内 オランダ	12,663,834,880	1.64
内 スウェーデン	6,700,351,064	0.87
内 デンマーク	5,797,840,606	0.75
内 スペイン	5,171,553,477	0.67
内 香港	4,875,175,654	0.63
内 イタリア	3,406,644,016	0.44
内 ジャージー	2,743,263,771	0.36
内 フィンランド	2,622,282,834	0.34
内 シンガポール	2,441,669,433	0.32
内 ノルウェー	1,902,169,195	0.25
内 イスラエル	1,735,942,747	0.23
内 ベルギー	1,626,956,170	0.21
内 ケイマン諸島	1,527,595,363	0.20
内 パミュダ	1,046,320,205	0.14
内 オランダ領キュラソー	854,194,435	0.11
内 ニュージーランド	517,137,617	0.07
内 ルクセンブルグ	516,617,332	0.07
内 ポルトガル	410,254,315	0.05
内 オーストリア	343,662,329	0.04
内 リベリア	158,993,357	0.02
内 パナマ	139,430,262	0.02
内 マン島	128,024,792	0.02
投資信託受益証券	1,316,650,899	0.17
内 オーストラリア	955,475,530	0.12
内 シンガポール	361,175,369	0.05
投資証券	17,111,736,390	2.22
内 アメリカ	16,058,988,838	2.08
内 イギリス	382,656,350	0.05
内 フランス	272,475,970	0.04
内 香港	253,315,435	0.03
内 カナダ	73,056,543	0.01
内 ベルギー	71,243,254	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	23,382,973,690	3.03
純資産総額	771,346,622,616	100.00

その他資産の投資状況

2022年8月31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)		24,171,524,819	3.13
内 アメリカ		17,965,581,562	2.33
内 ドイツ		3,282,754,115	0.43
内 カナダ		1,296,888,278	0.17
内 イギリス		1,083,303,585	0.14
内 オーストラリア		542,997,279	0.07

(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

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	519,472,283,950	84.77
内 日本	519,472,283,950	84.77
地方債証券	32,815,336,745	5.35
内 日本	32,815,336,745	5.35
特殊債券	30,476,098,073	4.97
内 日本	30,476,098,073	4.97
社債券	26,077,400,260	4.26
内 日本	25,280,678,260	4.13
内 フランス	796,722,000	0.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,975,212,052	0.65
純資産総額	612,816,331,080	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

2022年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	185,898,464,150	98.73
内 アメリカ	96,399,519,066	51.20
内 フランス	16,096,829,055	8.55
内 イタリア	14,383,778,257	7.64
内 ドイツ	12,084,258,296	6.42
内 スペイン	9,380,805,357	4.98
内 イギリス	8,774,008,542	4.66
内 中国	4,705,481,291	2.50
内 カナダ	3,967,057,424	2.11
内 ベルギー	3,596,822,509	1.91
内 オランダ	2,969,740,330	1.58
内 オーストラリア	2,879,454,983	1.53
内 オーストリア	2,238,808,499	1.19
内 メキシコ	1,486,742,587	0.79
内 アイルランド	1,192,486,349	0.63
内 マレーシア	992,690,087	0.53
内 フィンランド	957,710,813	0.51
内 ポーランド	787,682,510	0.42
内 イスラエル	768,735,134	0.41
内 シンガポール	746,206,509	0.40

	内 デンマーク	680,623,851	0.36
	内 スウェーデン	451,986,082	0.24
	内 ノルウェー	357,036,619	0.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,389,554,799	1.27
純資産総額		188,288,018,949	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

2022年8月31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	9,483,286,308	1.2861 12,196,900,796	1.2747 12,088,345,056	- -	65.09
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	1,068,137,563	3.1096 3,321,495,108	3.2985 3,523,251,751	- -	18.97
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	706,467,973	2.0119 1,421,376,719	2.1015 1,484,642,445	- -	7.99
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	150,881,650	5.5122 831,696,353	6.0806 917,450,960	- -	4.94

(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

2022年8月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.00
合計	97.00

(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。

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

2022年8月31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	13,245,783,215	1.2860 17,035,119,038	1.2747 16,884,399,864	- -	42.89

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	3,608,291,514	3.1101 11,222,239,732	3.2985 11,901,949,558	- -	30.23
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	782,298,858	5.5129 4,312,738,416	6.0806 4,756,846,435	- -	12.08
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	2,208,931,348	2.0101 4,440,191,372	2.1015 4,642,069,227	- -	11.79

(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

2022年8月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.99
合計	96.99

(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

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>3成長型

2022年8月31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	3,944,456,889	3.1109 12,271,104,615	3.2985 13,010,791,048	- -	40.11
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	5,565,057,336	1.2858 7,156,036,226	1.2747 7,093,778,586	- -	21.87
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	1,017,586,270	5.5137 5,610,741,679	6.0806 6,187,535,073	- -	19.08
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	2,458,175,559	2.0122 4,946,422,724	2.1015 5,165,855,937	- -	15.93

(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

2022年8月31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。

(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

2022年8月31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	8,094,000	2,196.52 17,778,682,610	2,101.50 17,009,541,000	- -	3.74
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,112,200	12,220.07 13,591,169,803	11,135.00 12,384,347,000	- -	2.72
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	160,900	54,582.93 8,782,394,741	52,840.00 8,501,956,000	- -	1.87
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,250,000	748.76 7,674,803,195	721.10 7,391,275,000	- -	1.62
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,952,800	3,620.37 7,069,870,947	3,769.00 7,360,103,200	- -	1.62
6	日立製作所 日本	株式 電気機器	853,900	6,184.68 5,281,099,432	6,996.00 5,973,884,400	- -	1.31
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,044,700	5,323.80 5,561,779,181	5,562.00 5,810,621,400	- -	1.28
8	任天堂 日本	株式 その他製品	100,200	58,867.75 5,898,549,080	56,990.00 5,710,398,000	- -	1.26
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,215,300	5,151.21 6,260,275,622	4,483.00 5,448,189,900	- -	1.20
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,270,100	4,051.70 5,146,071,142	4,277.00 5,432,217,700	- -	1.19
11	第一三共 日本	株式 医薬品	1,287,900	2,746.78 3,537,586,071	4,197.00 5,405,316,300	- -	1.19
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,395,500	3,589.88 5,009,678,121	3,850.00 5,372,675,000	- -	1.18
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,146,600	4,124.21 4,728,828,152	4,564.00 5,233,082,400	- -	1.15
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	112,700	54,466.10 6,138,329,475	44,160.00 4,976,832,000	- -	1.09
15	HOYA 日本	株式 精密機器	342,800	14,223.11 4,875,683,480	14,250.00 4,884,900,000	- -	1.07
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,298,100	3,363.69 4,366,417,811	3,724.00 4,834,124,400	- -	1.06
17	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,136,400	4,207.43 4,781,325,016	4,194.00 4,766,061,600	- -	1.05

18	ダイキン工業 日本	株式 機械	193,900	22,068.09 4,279,002,727	24,485.00 4,747,641,500	- -	1.04
19	信越化学工業 日本	株式 化学	275,600	18,156.79 5,004,012,337	16,315.00 4,496,414,000	- -	0.99
20	三井物産 日本	株式 卸売業	1,267,500	3,051.94 3,868,342,449	3,266.00 4,139,655,000	- -	0.91
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,638,800	1,475.99 3,894,861,158	1,529.50 4,036,044,600	- -	0.89
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,048,400	3,780.08 3,963,044,478	3,843.00 4,029,001,200	- -	0.89
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	487,300	7,364.16 3,588,559,329	7,792.00 3,797,041,600	- -	0.83
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	180,400	20,681.78 3,730,993,317	20,850.00 3,761,340,000	- -	0.83
25	日本電産 日本	株式 電気機器	394,400	9,423.03 3,716,445,363	9,324.00 3,677,385,600	- -	0.81
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	484,300	8,085.52 3,915,817,669	7,554.00 3,658,402,200	- -	0.80
27	ファナック 日本	株式 電気機器	155,800	21,848.01 3,403,919,963	22,535.00 3,510,953,000	- -	0.77
28	S M C 日本	株式 機械	52,000	64,363.74 3,346,914,723	66,600.00 3,463,200,000	- -	0.76
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,099,600	1,595.11 3,349,111,550	1,593.50 3,345,712,600	- -	0.74
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	586,400	5,590.55 3,278,300,601	5,533.00 3,244,551,200	- -	0.71

(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

2022年8月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	98.00
合計	98.00

(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

2022年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.13
情報・通信業		8.87
輸送用機器		7.89
化学		6.04
卸売業		5.65
サービス業		5.30
機械		5.26
医薬品		5.22
銀行業		5.11

小売業	4.32
食料品	3.31
陸運業	3.04
精密機器	2.79
その他製品	2.36
保険業	2.17
建設業	2.14
不動産業	1.90
電気・ガス業	1.25
その他金融業	1.13
鉄鋼	0.80
非鉄金属	0.73
ゴム製品	0.72
証券、商品先物取引業	0.71
ガラス・土石製品	0.71
海運業	0.67
金属製品	0.59
石油・石炭製品	0.53
繊維製品	0.46
空運業	0.44
鉱業	0.31
パルプ・紙	0.18
倉庫・運輸関連業	0.16
水産・農林業	0.10
合計	98.00

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年8月31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	1,837,323	22,929.72 42,129,303,492	22,029.69 40,475,662,183	- -	5.25
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	802,234	40,376.85 32,391,682,369	36,455.53 29,245,866,536	- -	3.79
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	1,031,831	20,801.30 21,463,436,401	17,845.83 18,413,890,829	- -	2.39
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	297,021	39,506.34 11,734,213,137	38,497.55 11,434,581,095	- -	1.48

5	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	677,697	18,368.66 12,448,387,360	15,102.35 10,234,818,778	- -	1.33
6	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	638,911	18,388.15 11,748,392,899	15,236.82 9,734,974,011	- -	1.26
7	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	106,087	66,548.97 7,059,981,467	72,481.30 7,689,324,649	- -	1.00
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	295,991	23,248.23 6,881,267,477	22,517.67 6,665,027,927	- -	0.86
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	477,994	11,260.70 5,382,549,753	13,351.45 6,381,915,524	- -	0.83
10	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	282,153	32,481.05 9,164,627,518	21,443.28 6,050,288,151	- -	0.78
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	145,492	43,662.52 6,352,547,968	39,567.77 5,756,794,662	- -	0.75
12	META PLATFORMS 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	260,198	29,395.76 7,648,719,996	21,787.09 5,668,957,451	- -	0.73
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	333,755	20,395.55 6,807,117,461	15,860.65 5,293,574,010	- -	0.69
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	270,541	21,444.99 5,801,750,344	19,433.15 5,257,464,753	- -	0.68
15	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	186,998	30,711.69 5,743,025,942	27,917.30 5,220,481,023	- -	0.68
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	317,300	16,688.04 5,295,116,952	16,398.78 5,203,334,163	- -	0.67

17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	219,749	19,849.00 4,361,799,934	22,266.75 4,893,096,177	- -	0.63
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	117,817	47,155.98 5,555,776,136	40,632.45 4,787,193,715	- -	0.62
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	98,406	50,816.40 5,000,639,238	45,444.30 4,471,991,815	- -	0.58
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	634,358	6,962.44 4,416,682,410	6,356.18 4,032,097,121	- -	0.52
21	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	465,102	8,459.61 3,934,584,403	8,615.85 4,007,251,159	- -	0.52
22	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	822,779	6,278.10 5,165,491,928	4,725.89 3,888,368,560	- -	0.50
23	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	91,316	34,477.40 3,148,339,171	42,564.95 3,886,861,449	- -	0.50
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	200,408	20,128.21 4,033,854,335	18,791.29 3,765,926,148	- -	0.49
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	156,147	23,042.00 3,597,939,689	23,981.60 3,744,655,472	- -	0.49
26	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品 小売り	50,179	69,986.91 3,511,873,275	72,661.52 3,646,082,823	- -	0.47
27	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	79,959	48,662.45 3,891,001,069	45,055.35 3,602,581,530	- -	0.47
28	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	285,212	10,911.72 3,112,155,460	12,044.17 3,435,143,068	- -	0.45
29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサイエンス・ツール/サービス	44,225	77,651.92 3,434,156,297	76,841.22 3,398,303,073	- -	0.44
30	SHELL PLC イギリス	株式 石油・ガス・消耗燃料	861,789	3,303.95 2,847,309,659	3,785.31 3,262,139,380	- -	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

2022年8月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	94.58
投資信託受益証券	0.17

投資証券	2.22
合計	96.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.01
銀行		5.58
コンピュータ・周辺機器		5.48
石油・ガス・消耗燃料		5.15
医薬品		5.05
半導体・半導体製造装置		4.18
情報技術サービス		3.74
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.55
資本市場		3.16
保険		3.03
インターネット販売・通信販売		2.72
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.44
ヘルスケア機器・用品		2.16
自動車		2.11
化学		2.00
電力		1.96
バイオテクノロジー		1.84
飲料		1.81
ホテル・レストラン・レジャー		1.71
食品		1.69
専門小売り		1.59
機械		1.58
航空宇宙・防衛		1.55
食品・生活必需品小売り		1.52
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.46
金属・鉱業		1.43
繊維・アパレル・贅沢品		1.27
各種電気通信サービス		1.16
家庭用品		1.15
娯楽		1.12
陸運・鉄道		1.09
各種金融サービス		0.97
総合公益事業		0.89
コングロマリット		0.86
メディア		0.75
電気設備		0.75
タバコ		0.71
専門サービス		0.67
通信機器		0.66
航空貨物・物流サービス		0.59
パーソナル用品		0.58
電子装置・機器・部品		0.54
商業サービス・用品		0.51

建設関連製品	0.50
複合小売り	0.47
消費者金融	0.41
不動産管理・開発	0.35
商社・流通業	0.34
無線通信サービス	0.30
家庭用耐久財	0.27
容器・包装	0.26
建設・土木	0.25
建設資材	0.24
エネルギー設備・サービス	0.23
自動車部品	0.18
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
運送インフラ	0.14
ガス	0.14
水道	0.12
販売	0.11
紙製品・林産品	0.11
海運業	0.08
ヘルスケア・テクノロジー	0.07
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	94.58

（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

2022年8月31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	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	11,310,000,000	100.96 11,419,004,000	100.92 11,414,617,500	0.6 2023/12/20	1.86
2	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	7,130,000,000	101.17 7,213,784,000	101.08 7,207,360,500	0.6 2024/3/20	1.18
3	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	7,150,000,000	100.54 7,189,112,000	100.64 7,196,260,500	0.1 2026/6/20	1.17
4	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,700,000,000	100.45 6,730,396,000	100.54 6,736,649,000	0.1 2025/6/20	1.10
5	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,290,000,000	100.49 6,321,038,000	100.58 6,326,544,900	0.1 2026/12/20	1.03
6	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,020,000,000	101.37 6,102,664,400	101.25 6,095,430,600	0.6 2024/6/20	0.99

7	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,040,000,000	100.03 6,041,859,000	100.17 6,050,388,800	0.005 2026/12/20	0.99
8	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,000,000,000	100.51 6,031,106,000	100.61 6,036,720,000	0.1 2025/12/20	0.99
9	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,960,000,000	100.22 5,973,282,000	100.30 5,978,118,400	0.1 2028/3/20	0.98
10	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,770,000,000	100.45 5,796,194,100	100.54 5,801,504,200	0.1 2027/3/20	0.95
11	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,840,000,000	99.02 5,783,302,000	99.07 5,786,038,400	0.1 2031/3/20	0.94
12	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,700,000,000	99.29 5,659,747,000	99.34 5,662,722,000	0.1 2030/6/20	0.92
13	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,590,000,000	100.32 5,608,203,000	100.42 5,613,981,100	0.1 2027/9/20	0.92
14	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	99.21 5,456,973,000	99.14 5,452,810,000	0.1 2030/12/20	0.89
15	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	98.89 5,439,327,000	99.06 5,448,630,000	0.1 2031/9/20	0.89
16	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,410,000,000	100.36 5,429,743,000	100.48 5,435,968,000	0.1 2027/6/20	0.89
17	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,440,000,000	98.90 5,380,640,000	99.08 5,390,278,400	0.1 2031/12/20	0.88
18	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,220,000,000	101.25 5,285,538,000	101.27 5,286,502,800	0.3 2025/12/20	0.86
19	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,300,000,000	98.95 5,244,375,000	99.00 5,247,318,000	0.1 2031/6/20	0.86
20	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,130,000,000	100.41 5,151,300,200	100.62 5,162,267,700	0.1 2026/9/20	0.84
21	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,080,000,000	101.37 5,149,693,000	101.38 5,150,561,200	0.4 2025/6/20	0.84
22	356回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,140,000,000	99.61 5,120,358,000	99.72 5,125,608,000	0.1 2029/9/20	0.84
23	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,140,000,000	99.29 5,103,788,000	99.24 5,101,244,400	0.1 2030/9/20	0.83

24	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,050,000,000	99.37 5,018,424,000	99.40 5,019,902,000	0.1 2030/3/20	0.82
25	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.27 5,013,800,000	100.27 5,013,650,000	0.1 2023/12/20	0.82
26	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,880,000,000	100.54 4,906,834,000	100.64 4,911,232,000	0.1 2026/3/20	0.80
27	337回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	100.91 4,844,084,000	100.91 4,843,728,000	0.3 2024/12/20	0.79
28	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	100.21 4,810,274,000	100.23 4,811,088,000	0.1 2028/6/20	0.79
29	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,810,000,000	99.63 4,792,398,000	99.53 4,787,441,100	0.1 2029/12/20	0.78
30	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,760,000,000	99.93 4,757,092,000	100.03 4,761,523,200	0.1 2029/3/20	0.78

(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

2022年8月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.77
地方債証券	5.35
特殊債券	4.97
社債券	4.26
合計	99.35

(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

2022年8月31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 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,039,725,000	95.90 997,161,365	94.71 984,733,289	0.25 2024/5/15	0.52
2	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,107,653,700	94.94 1,051,646,658	86.13 954,053,277	1.375 2031/11/15	0.51
3	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,109,040,000	90.03 998,483,069	84.08 932,546,674	0.875 2030/11/15	0.50
4	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,075,768,800	93.65 1,007,499,608	85.45 919,278,054	1.125 2031/2/15	0.49
5	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,109,040,000	83.26 923,417,493	82.45 914,438,136	0.625 2030/8/15	0.49

6	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証 券	1,009,226,400	92.77 936,271,934	89.84 906,726,842	1.875 2032/2/15	0.48
7	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,057,746,900	94.51 999,734,451	85.60 905,530,508	1.25 2031/8/15	0.48
8	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	921,889,500	100.61 927,600,099	97.96 903,091,590	2.875 2032/5/15	0.48
9	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	881,686,800	102.26 901,689,103	99.18 874,523,094	2.75 2023/11/15	0.46
10	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	920,503,200	97.86 900,817,573	88.85 817,953,390	1.625 2031/5/15	0.43
11	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証 券	822,075,900	97.65 802,789,999	96.53 793,624,361	2 2025/2/15	0.42
12	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証 券	823,462,200	98.82 813,768,450	92.41 761,027,031	1.5 2027/1/31	0.40
13	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	707,013,000	102.14 722,155,303	98.42 695,910,680	2.5 2024/5/15	0.37
14	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証 券	726,421,200	96.62 701,880,569	95.16 691,320,293	2.25 2027/8/15	0.37
15	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	705,626,700	103.89 733,078,024	97.79 690,080,860	2.875 2028/5/15	0.37
16	US T N/B 2.875 06/15/25 アメリカ	国債証 券	693,150,000	99.54 690,018,348	98.37 681,913,386	2.875 2025/6/15	0.36
17	US T N/B 1.25 05/31/28 アメリカ	国債証 券	748,602,000	94.05 704,112,078	89.39 669,238,486	1.25 2028/5/31	0.36
18	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証 券	783,259,500	84.50 661,913,469	82.84 648,912,134	0.625 2030/5/15	0.34
19	US T N/B 2.25 03/31/24 アメリカ	国債証 券	658,492,500	99.49 655,151,763	98.12 646,120,037	2.25 2024/3/31	0.34
20	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証 券	676,514,400	95.23 644,286,751	94.67 640,521,715	1.125 2025/1/15	0.34
21	US T N/B 2.0 04/30/24 アメリカ	国債証 券	654,333,600	98.14 642,215,341	97.67 639,125,453	2 2024/4/30	0.34
22	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証 券	665,424,000	97.41 648,214,642	95.30 634,154,267	0.125 2024/2/15	0.34
23	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証 券	639,084,300	101.93 651,445,253	97.97 626,152,824	2.375 2024/8/15	0.33
24	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証 券	630,766,500	101.99 643,328,375	98.67 622,389,130	2.5 2024/1/31	0.33
25	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	634,925,400	102.86 653,096,049	97.25 617,514,549	2.75 2028/2/15	0.33
26	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証 券	627,993,900	106.13 666,517,105	97.75 613,913,094	2.875 2028/8/15	0.33
27	US T N/B 1.875 02/15/41 アメリカ	国債証 券	790,191,000	86.70 685,126,207	77.35 611,225,077	1.875 2041/2/15	0.32
28	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証 券	639,084,300	98.31 628,324,191	94.59 604,533,804	1 2024/12/15	0.32
29	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	607,199,400	107.87 655,039,025	99.07 601,554,337	3.125 2028/11/15	0.32
30	US T N/B 1.5 02/15/25 アメリカ	国債証 券	630,766,500	99.66 628,671,535	95.35 601,494,991	1.5 2025/2/15	0.32

(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

2022年8月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.73
合計	98.73

(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】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC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】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

該当事項はありません。

DIAMバランス・ファンド<DC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

2022年8月31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 0409月	買建	467	9,254,429,110	9,162,540,000	2.01

(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

2022年8月31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 Sep22	買建	650	18,126,480,739	17,965,581,562	2.33
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep22	買建	664	3,324,941,378	3,282,754,115	0.43
	モン トリ オ ール 取 引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep22	買建	52	1,296,360,747	1,296,888,278	0.17
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep22	買建	91	1,074,611,689	1,083,303,585	0.14
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Sep22	買建	33	529,363,717	542,997,279	0.07

(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】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

直近日(2022年8月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第19計算期間末 (2022年2月25日)	17,694	17,694	1.7336	1.7336
2021年8月末日	17,406	-	1.7726	-
9月末日	17,512	-	1.7801	-
10月末日	17,678	-	1.7829	-
11月末日	17,822	-	1.7713	-
12月末日	17,983	-	1.7843	-
2022年1月末日	17,825	-	1.7506	-
2月末日	17,755	-	1.7400	-
3月末日	18,157	-	1.7645	-
4月末日	18,075	-	1.7497	-
5月末日	18,163	-	1.7492	-
6月末日	18,069	-	1.7330	-
7月末日	18,454	-	1.7566	-
8月末日	18,571	-	1.7565	-

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

直近日(2022年8月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第19計算期間末 (2022年2月25日)	36,908	36,908	2.1956	2.1956
2021年8月末日	36,452	-	2.2493	-
9月末日	36,672	-	2.2670	-
10月末日	37,274	-	2.2806	-
11月末日	37,103	-	2.2538	-

12月末日	37,816	-	2.2869	-
2022年1月末日	37,235	-	2.2220	-
2月末日	37,125	-	2.2072	-
3月末日	38,460	-	2.2691	-
4月末日	38,125	-	2.2382	-
5月末日	38,393	-	2.2392	-
6月末日	38,238	-	2.2162	-
7月末日	39,173	-	2.2588	-
8月末日	39,371	-	2.2629	-

D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型

直近日(2022年8月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第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
第19計算期間末 (2022年2月25日)	29,757	29,757	2.6891	2.6891
2021年8月末日	29,058	-	2.7594	-
9月末日	29,587	-	2.7898	-
10月末日	30,196	-	2.8198	-
11月末日	30,079	-	2.7733	-
12月末日	30,835	-	2.8335	-
2022年1月末日	30,057	-	2.7274	-
2月末日	29,954	-	2.7076	-
3月末日	31,447	-	2.8207	-
4月末日	30,934	-	2.7689	-
5月末日	31,261	-	2.7720	-
6月末日	31,171	-	2.7411	-
7月末日	32,152	-	2.8084	-
8月末日	32,437	-	2.8182	-

【分配の推移】

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

	1口当たりの分配金（円）
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
第19計算期間	0.0000
2022年2月26日～2022年8月25日	-

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 2 安定・成長型

	1口当たりの分配金（円）
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
第19計算期間	0.0000
2022年2月26日～2022年8月25日	-

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 3 成長型

	1口当たりの分配金（円）
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
第19計算期間	0.0000
2022年2月26日～2022年8月25日	-

【収益率の推移】

D I A Mバランス・ファンド< D C 年金 > 1 安定型

	収益率（％）
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
第19計算期間	0.2
2022年2月26日～2022年8月25日	1.5

(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> 2 安定・成長型

	収益率(%)
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
第19計算期間	1.5
2022年2月26日～2022年8月25日	3.5

(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
第19計算期間	2.6
2022年2月26日～2022年8月25日	5.4

(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
第19計算期間	2,220,967,739	1,320,382,866
2022年2月26日～ 2022年8月25日	902,167,307	572,850,597

(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
第19計算期間	2,931,027,984	1,557,985,089
2022年2月26日～ 2022年8月25日	1,270,015,186	729,838,026

(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
第19計算期間	2,436,219,650	1,392,409,226
2022年2月26日～ 2022年8月25日	971,918,235	560,254,485

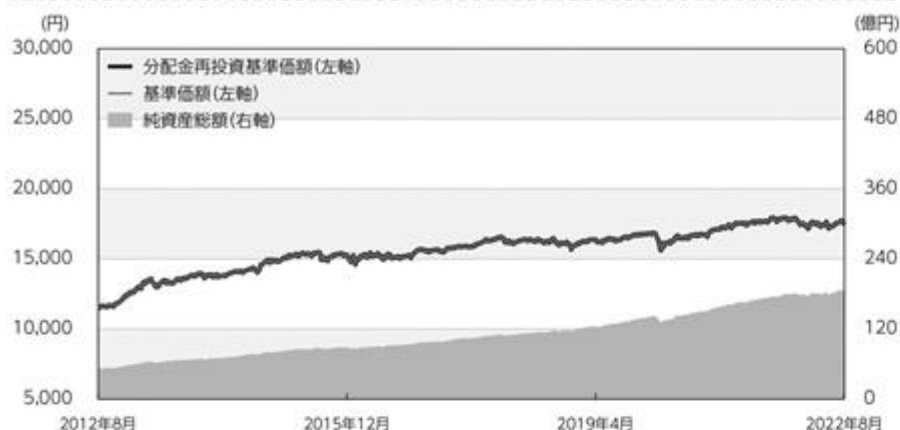
(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2022年8月31日

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

基準価額・純資産の推移 (2012年8月31日～2022年8月31日)



※基準価額は1万円当たり・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)

2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
設定来累計	0円

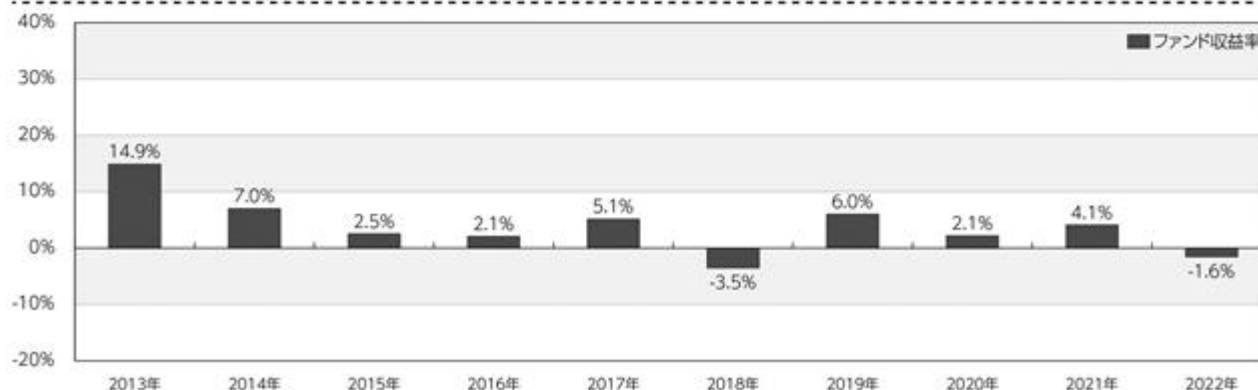
※分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	65.09
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	18.97
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.99
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.94

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。

※2022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<DC年金>2安定・成長型

基準価額・純資産の推移 (2012年8月31日～2022年8月31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)

2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
設定来累計	0円

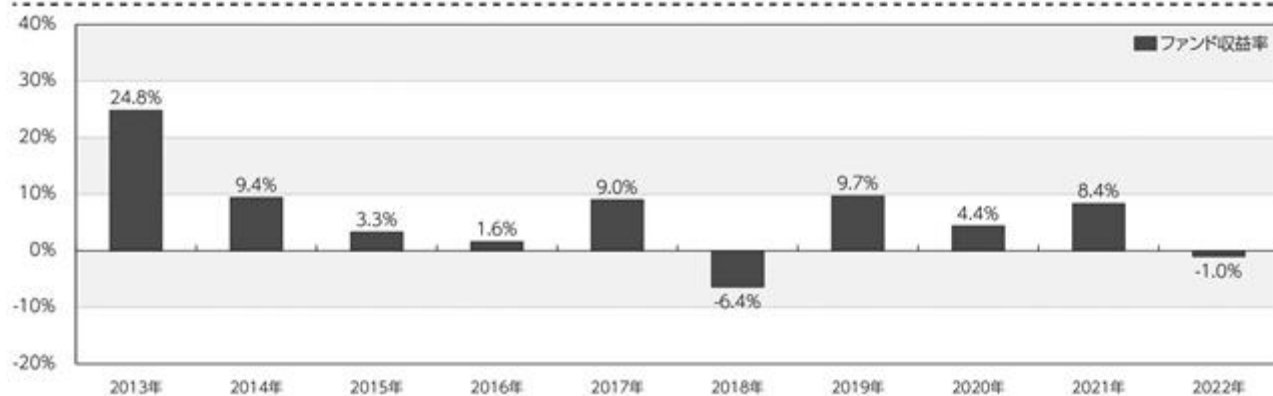
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	42.89
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	30.23
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.08
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.79

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。

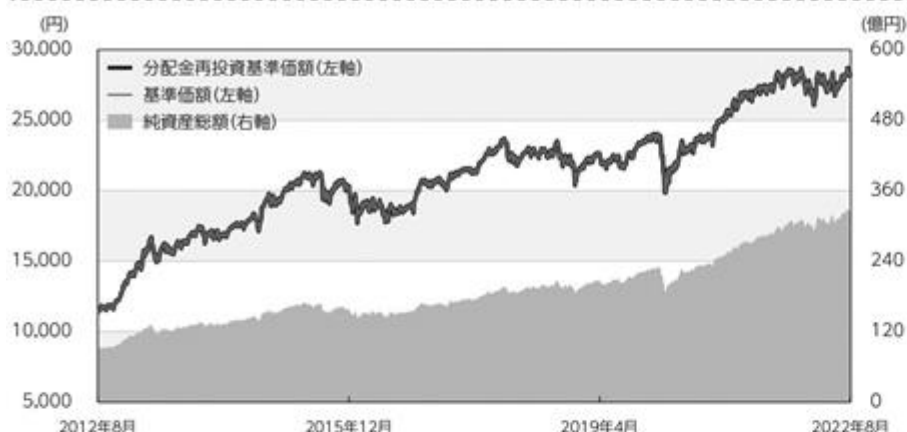
※2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はい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<DC年金>3成長型

基準価額・純資産の推移 (2012年8月31日～2022年8月31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)

2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
設定来累計	0円

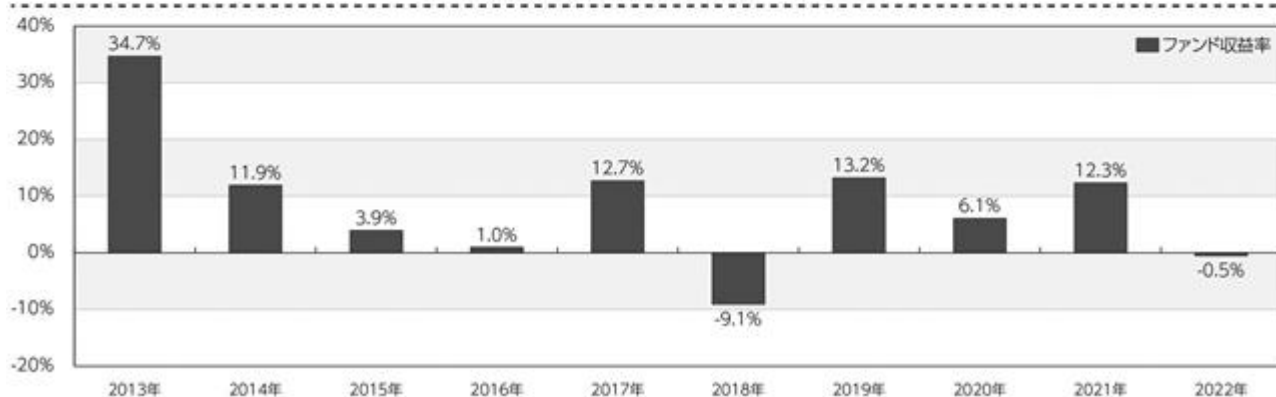
※分配金は1万口当たりです。

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	40.11
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.87
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.08
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.93

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。

※2022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。

○掲載データ等はい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	3.74
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.72
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.87
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.62
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.62

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.25
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.79
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.39
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.48
5	ALPHABET INC-CL A	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	1.33

■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	332回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2023/12/20	1.86
2	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.18
3	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/6/20	1.17
4	144回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/6/20	1.10
5	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	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 0.25 05/15/24	国債証券	アメリカ	0.25	2024/5/15	0.52
2	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	0.51
3	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.50
4	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.49
5	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.49

○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1万口当たりには換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <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経由して受託会社の指定するファンド口座(受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座)に払込まれます。

2【換金(解約)手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、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

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

- a. 委託会社は各ファンドについて受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に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。
- b. 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。
- c. 委託会社は上記a. b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記a. b.につき、上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記c. ~ e.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引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。

ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <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19期計算期間(2021年2月26日から2022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<DC年金>1安定型】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第18期 2021年2月25日現在	第19期 2022年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	529,288,378	575,069,039
親投資信託受益証券	15,621,454,220	17,163,528,953
未収入金	10,090,000	40,585,000
流動資産合計	16,160,832,598	17,779,182,992
資産合計	16,160,832,598	17,779,182,992
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,854,307	58,362,378
未払受託者報酬	2,550,717	2,949,926
未払委託者報酬	19,555,728	22,616,411
その他未払費用	303,399	349,969
流動負債合計	55,264,151	84,278,684
負債合計	55,264,151	84,278,684
純資産の部		
元本等		
元本	9,306,233,072	10,206,817,945
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,799,335,375	7,488,086,363
(分配準備積立金)	1,840,274,372	1,606,932,137
元本等合計	16,105,568,447	17,694,904,308
純資産合計	16,105,568,447	17,694,904,308
負債純資産合計	16,160,832,598	17,779,182,992

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第18期 自 2020年2月26日 至 2021年2月25日	第19期 自 2021年2月26日 至 2022年2月25日
営業収益		
受取利息	477	1,754
有価証券売買等損益	596,836,856	48,397,733
営業収益合計	596,837,333	48,399,487
営業費用		
支払利息	190,008	121,874
受託者報酬	4,835,684	5,689,790
委託者報酬	37,074,119	43,622,332
その他費用	578,273	675,017
営業費用合計	42,678,084	50,109,013
営業利益又は営業損失()	554,159,249	1,709,526
経常利益又は経常損失()	554,159,249	1,709,526
当期純利益又は当期純損失()	554,159,249	1,709,526
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()	14,043,645	41,904,786
期首剰余金又は期首欠損金()	5,638,263,771	6,799,335,375
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,618,937,324	1,701,266,918
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	1,618,937,324	1,701,266,918
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,026,068,614	968,901,618
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,026,068,614	968,901,618
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()	6,799,335,375	7,488,086,363

(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19期	
	自 2021年2月26日	至 2022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18期	第19期
	2021年2月25日現在	2022年2月25日現在
1. 期首元本額	8,407,981,806円	9,306,233,072円
期中追加設定元本額	2,435,613,354円	2,220,967,739円
期中一部解約元本額	1,537,362,088円	1,320,382,866円
2. 受益権の総数	9,306,233,072口	10,206,817,945口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期	第19期
	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日	自 2021年2月26日 至 2022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(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。	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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(5,881,267,146円)及び分配準備積立金(1,606,932,137円)より分配対象収益は7,488,199,283円(1万口当たり7,336.46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18期	第19期
	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日	自 2021年2月26日 至 2022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。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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	557,199,582	6,924,290
合計	557,199,582	6,924,290

（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18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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）	1.7306円 (17,306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

2022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	1,068,061,226	3,320,388,739	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	8,975,298,917	11,548,517,116	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	156,996,113	864,247,902	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	711,700,267	1,430,375,196	
親投資信託受益証券	合計	10,912,056,523	17,163,528,953	
合計			17,163,528,953	

（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<DC年金>2安定・成長型】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第18期 2021年2月25日現在	第19期 2022年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,081,369,703	1,196,254,900
親投資信託受益証券	32,399,235,856	35,799,789,823
未収入金	10,942,000	5,858,000
流動資産合計	33,491,547,559	37,001,902,723
資産合計		
33,491,547,559		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	38,137,895	32,646,103
未払受託者報酬	5,227,048	6,189,516
未払委託者報酬	45,301,585	53,642,777
その他未払費用	508,328	564,561
流動負債合計	89,174,856	93,042,957
負債合計		
89,174,856		
純資産の部		
元本等		
元本	15,437,389,171	16,810,432,066
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	17,964,983,532	20,098,427,700
(分配準備積立金)	7,432,506,962	7,067,176,512
元本等合計	33,402,372,703	36,908,859,766
純資産合計		
33,402,372,703		
負債純資産合計		
33,491,547,559		
37,001,902,723		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第18期		第19期	
	自	2020年2月26日 2021年2月25日	自	2021年2月26日 2022年2月25日
営業収益				
受取利息		971		3,649
有価証券売買等損益		2,613,017,057		547,831,967
営業収益合計		2,613,018,028		547,835,616
営業費用				
支払利息		382,573		252,995
受託者報酬		9,853,470		11,898,844
委託者報酬		85,397,438		103,123,957
その他費用		984,282		1,097,413
営業費用合計		96,617,763		116,373,209
営業利益又は営業損失()		2,516,400,265		431,462,407
経常利益又は経常損失()		2,516,400,265		431,462,407
当期純利益又は当期純損失()		2,516,400,265		431,462,407
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()		22,853,072		109,362,935
期首剰余金又は期首欠損金()		14,485,670,670		17,964,983,532
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,972,832,616		3,632,073,981
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		2,972,832,616		3,632,073,981
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,032,773,091		1,820,729,285
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,032,773,091		1,820,729,285
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()		17,964,983,532		20,098,427,700

(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19期	
	自 2021年2月26日	至 2022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18期	第19期
	2021年2月25日現在	2022年2月25日現在
1. 期首元本額	14,513,700,083円	15,437,389,171円
期中追加設定元本額	2,967,927,595円	2,931,027,984円
期中一部解約元本額	2,044,238,507円	1,557,985,089円
2. 受益権の総数	15,437,389,171口	16,810,432,066口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期	第19期
	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日	自 2021年2月26日 至 2022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(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(322,014,441円)、信託約款に規定される収益調整金(13,031,489,943円)及び分配準備積立金(6,745,162,071円)より分配対象収益は20,098,666,455円(1万口当たり11,956.06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18期	第19期
	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日	自 2021年2月26日 至 2022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。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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	2,566,865,500	408,293,540
合計	2,566,865,500	408,293,540

（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18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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）	2.1637円 (21,637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

2022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	3,522,012,608	10,949,232,795	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	12,473,804,373	16,050,044,086	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	785,786,577	4,325,676,527	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,226,508,317	4,474,836,415	
親投資信託受益証券	合計	19,008,111,875	35,799,789,823	
合計			35,799,789,823	

（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<DC年金>3成長型】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第18期 2021年2月25日現在	第19期 2022年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	873,169,163	982,856,485
親投資信託受益証券	25,468,006,753	28,862,511,470
未収入金	4,045,000	2,032,000
流動資産合計	26,345,220,916	29,847,399,955
資産合計	26,345,220,916	29,847,399,955
負債の部		
流動負債		
未払解約金	45,635,166	35,596,647
未払受託者報酬	4,045,565	5,013,973
未払委託者報酬	39,107,526	48,468,742
その他未払費用	438,002	494,811
流動負債合計	89,226,259	89,574,173
負債合計	89,226,259	89,574,173
純資産の部		
元本等		
元本	10,022,091,306	11,065,901,730
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	16,233,903,351	18,691,924,052
(分配準備積立金)	6,696,959,311	6,333,530,443
元本等合計	26,255,994,657	29,757,825,782
純資産合計	26,255,994,657	29,757,825,782
負債純資産合計	26,345,220,916	29,847,399,955

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第18期		第19期	
	自	2020年2月26日 2021年2月25日	自	2021年2月26日 2022年2月25日
営業収益				
受取利息		752		3,026
有価証券売買等損益		2,896,469,030		729,668,717
営業収益合計		2,896,469,782		729,671,743
営業費用				
支払利息		295,017		206,680
受託者報酬		7,549,258		9,530,435
委託者報酬		72,976,993		92,128,250
その他費用		845,241		956,891
営業費用合計		81,666,509		102,822,256
営業利益又は営業損失()		2,814,803,273		626,849,487
経常利益又は経常損失()		2,814,803,273		626,849,487
当期純利益又は当期純損失()		2,814,803,273		626,849,487
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()		16,386,624		157,733,201
期首剰余金又は期首欠損金()		12,802,868,378		16,233,903,351
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,863,361,105		4,259,073,895
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		2,863,361,105		4,259,073,895
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,263,516,029		2,270,169,480
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,263,516,029		2,270,169,480
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()		16,233,903,351		18,691,924,052

(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19期	
	自 2021年2月26日	至 2022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18期	第19期
	2021年2月25日現在	2022年2月25日現在
1. 期首元本額	9,588,307,375円	10,022,091,306円
期中追加設定元本額	2,137,759,735円	2,436,219,650円
期中一部解約元本額	1,703,975,804円	1,392,409,226円
2. 受益権の総数	10,022,091,306口	11,065,901,730口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期	第19期
	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日	自 2021年2月26日 至 2022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(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(469,071,293円)、信託約款に規定される収益調整金(12,358,585,343円)及び分配準備積立金(5,864,459,150円)より分配対象収益は18,692,115,786円(1万口当たり16,891.63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18期	第19期
	自 2020年2月26日 至 2021年2月25日	自 2021年2月26日 至 2022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。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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	2,854,366,011	642,377,490
合計	2,854,366,011	642,377,490

（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18期 2021年2月25日現在	第19期 2022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）	2.6198円 (26,198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

2022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	3,802,240,777	11,820,406,127	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,177,420,423	6,661,786,858	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,007,988,340	5,548,875,012	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,403,942,419	4,831,443,473	
親投資信託受益証券	合計	12,391,591,959	28,862,511,470	
合計			28,862,511,470	

（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)

2022年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,985,669,797
株式	372,548,605,270
派生商品評価勘定	15,307,890
未収入金	68,708,659
未収配当金	791,843,541
前払金	279,560,900
差入委託証拠金	375,300,000
流動資産合計	381,064,996,057
資産合計	
381,064,996,057	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	196,009,730
未払金	58,444,613
未払解約金	353,389,000
流動負債合計	607,843,343
負債合計	
607,843,343	
純資産の部	
元本等	
元本	122,380,637,954
剰余金	
剰余金又は欠損金()	258,076,514,760
元本等合計	380,457,152,714
純資産合計	
380,457,152,714	
負債純資産合計	
381,064,996,057	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月26日 至 2022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	2022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	101,185,876,143円
同期中追加設定元本額	181,098,586,120円
同期中一部解約元本額	159,903,824,309円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,713,178,919円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,047,963,552円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,461,029,446円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,706,418,103円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,972,016円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	25,176,657円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	85,336,874円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,541,870円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,103,225円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,896,115円
たわらノーロード TOPIX	1,328,200,736円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,072,353,146円
たわらノーロード バランス(堅実型)	41,527,117円
たわらノーロード バランス(標準型)	262,619,504円
たわらノーロード バランス(積極型)	399,559,935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)	3,610,424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)	174,201,589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)	435,456,944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)	287,635,626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)	413,402,567円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	713,893円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,006,805円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	39,050,530円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,158,211円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	18,314,906円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,847,223,374円
Oneグローバルバランス	4,707,794円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,068,061,226円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,522,012,608円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,802,240,777円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	340,892,143円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,109,141,568円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,117,065,799円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,620,397円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,059,266,348円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,529,124円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	306,888,223円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	306,629,755円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	547,738,135円
投資のソムリエ	13,334,781,624円
クルーズコントロール	128,837,057円
投資のソムリエ<DC年金>	804,116,864円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	335,710,500円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	543,006,508円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,731,404,289円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	42,422,634円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	20,515,309円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,497,140円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	146,712,017円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	350,731,897円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,995,711,927円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	288,069,427円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	42,977,458円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	17,916,384円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	15,589,856円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	110,855,331円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,040,728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)	45,001,246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)	46,083,482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)	21,508,092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)	27,984,535円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	44,396,084円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	105,515,597円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	44,812,800円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	84,110,969円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	75,254,390円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	51,059,977円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	40,193,567円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	53,123,012円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)	73,829,317円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	330,476,578円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	34,046,474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)	116,640,502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)	76,379,099円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)	8,434,265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)	55,682,414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)	99,919,195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)	4,809,401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)	26,203,697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)	5,554,467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)	1,306,539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)	6,845,367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)	30,343,125円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	540,306,081円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	619,074,780円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,768,399,970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)	30,192,938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)	28,201,111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)	292,016,916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)	72,631,575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)	1,378,207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)	341,553,342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)	19,878,257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)	71,169,795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)	168,087,578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)	228,109,549円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	37,351,911円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,981,306円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	11,891,269円

コア資産形成ファンド	8,200,998円
MHAMトピックスファンド	692,776,226円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	65,056,059円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,594,384,140円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,041,668,735円
計	122,380,637,954円
2. 受益権の総数	122,380,637,954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 2021年2月26日 至 2022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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022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	2022年2月25日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	10,753,799,824	
合計	10,753,799,824	

(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(2022年2月8日から2022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	2022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 先物取引 買建	7,850,967,200	-		180,567,200
合計	7,850,967,200	-		180,567,200

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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)

2022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)	3.1088円 (31,088円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

極洋	7,100	3,150.00	22,365,000
日本水産	197,300	532.00	104,963,600
マルハニチロ	31,000	2,453.00	76,043,000
ハウスイ	600	841.00	504,600
雪国まいたけ	14,600	1,170.00	17,082,000
カネコ種苗	4,900	1,578.00	7,732,200
サカタのタネ	23,700	3,350.00	79,395,000
ホクト	16,800	1,952.00	32,793,600
ホクリヨウ	3,400	683.00	2,322,200
ヒノキヤグループ	4,400	2,347.00	10,326,800
ショーボンドホールディングス	28,200	5,090.00	143,538,000
ミライト・ホールディングス	63,600	1,918.00	121,984,800
タマホーム	12,000	2,267.00	27,204,000
サンヨーホームズ	2,500	756.00	1,890,000
日本アクア	8,000	599.00	4,792,000
ファーストコーポレーション	6,300	738.00	4,649,400
ベステラ	4,000	1,234.00	4,936,000
Robot Home	32,900	204.00	6,711,600
キャンディル	3,700	492.00	1,820,400
住石ホールディングス	34,700	137.00	4,753,900
日鉄鉱業	4,500	6,350.00	28,575,000
三井松島ホールディングス	8,200	1,675.00	13,735,000
I N P E X	791,200	1,155.00	913,836,000
石油資源開発	23,200	2,685.00	62,292,000
K & O エナジーグループ	9,800	1,581.00	15,493,800
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,190.00	4,522,000
第一カッター興業	5,000	1,307.00	6,535,000
明豊ファシリティワークス	6,500	708.00	4,602,000
安藤・間	97,900	913.00	89,382,700
東急建設	57,800	697.00	40,286,600
コムシスホールディングス	63,600	2,723.00	173,182,800
ビーアールホールディングス	26,800	331.00	8,870,800
高松コンストラクショングループ	12,500	2,008.00	25,100,000
東建コーポレーション	5,500	9,000.00	49,500,000
ソネック	2,300	1,011.00	2,325,300
ヤマウラ	10,100	991.00	10,009,100
オリエンタル白石	67,000	245.00	16,415,000
大成建設	131,600	3,750.00	493,500,000
大林組	455,300	954.00	434,356,200
清水建設	426,500	753.00	321,154,500
飛島建設	12,100	1,114.00	13,479,400
長谷工コーポレーション	135,600	1,446.00	196,077,600
松井建設	18,200	700.00	12,740,000
銭高組	1,600	4,080.00	6,528,000
鹿島建設	333,800	1,528.00	510,046,400
不動テトラ	9,700	1,539.00	14,928,300
大末建設	4,900	1,298.00	6,360,200
鉄建建設	10,100	1,892.00	19,109,200
西松建設	27,600	3,795.00	104,742,000
三井住友建設	102,500	436.00	44,690,000

大豊建設	6,800	3,575.00	24,310,000
佐田建設	10,100	476.00	4,807,600
ナカノフドー建設	10,700	344.00	3,680,800
奥村組	26,800	3,185.00	85,358,000
東鉄工業	21,200	2,488.00	52,745,600
イチケン	3,500	1,920.00	6,720,000
富士ピー・エス	5,800	494.00	2,865,200
浅沼組	5,100	5,300.00	27,030,000
戸田建設	189,100	764.00	144,472,400
熊谷組	23,200	2,837.00	65,818,400
北野建設	2,900	2,126.00	6,165,400
植木組	4,100	1,505.00	6,170,500
矢作建設工業	20,300	777.00	15,773,100
ピーエス三菱	15,200	602.00	9,150,400
日本ハウスホールディングス	31,300	455.00	14,241,500
大東建託	46,600	12,580.00	586,228,000
新日本建設	19,700	750.00	14,775,000
東亜道路工業	2,600	4,925.00	12,805,000
日本道路	4,500	9,780.00	44,010,000
東亜建設工業	11,400	2,540.00	28,956,000
日本国土開発	45,000	532.00	23,940,000
若築建設	7,600	1,894.00	14,394,400
東洋建設	51,000	590.00	30,090,000
五洋建設	180,500	595.00	107,397,500
世紀東急工業	22,100	813.00	17,967,300
福田組	4,900	4,220.00	20,678,000
日本ドライケミカル	3,700	1,766.00	6,534,200
住友林業	116,500	2,185.00	254,552,500
日本基礎技術	12,600	678.00	8,542,800
巴コーポレーション	20,400	507.00	10,342,800
大和ハウス工業	420,500	3,224.00	1,355,692,000
ライト工業	28,700	1,910.00	54,817,000
積水ハウス	493,900	2,318.50	1,145,107,150
日特建設	9,700	734.00	7,119,800
北陸電気工事	9,700	826.00	8,012,200
ユアテック	26,200	715.00	18,733,000
日本リーテック	9,400	1,441.00	13,545,400
四電工	5,100	1,609.00	8,205,900
中電工	21,100	2,125.00	44,837,500
関電工	74,300	870.00	64,641,000
きんでん	101,900	1,603.00	163,345,700
東京エネシス	15,300	929.00	14,213,700
トーエネック	4,700	3,325.00	15,627,500
住友電設	11,400	2,234.00	25,467,600
日本電設工業	25,100	1,548.00	38,854,800
エクシオグループ	69,000	2,346.00	161,874,000
新日本空調	12,000	2,021.00	24,252,000
日本工営	8,200	3,060.00	25,092,000
九電工	35,200	3,000.00	105,600,000
三機工業	29,800	1,463.00	43,597,400

日揮ホールディングス	140,200	1,078.00	151,135,600
中外炉工業	4,700	1,571.00	7,383,700
ヤマト	13,600	712.00	9,683,200
太平電業	10,300	2,653.00	27,325,900
高砂熱学工業	41,200	1,899.00	78,238,800
三晃金属工業	1,600	2,524.00	4,038,400
NEC ネットエスアイ	47,200	1,753.00	82,741,600
朝日工業社	3,300	2,961.00	9,771,300
明星工業	29,500	714.00	21,063,000
大気社	22,400	2,984.00	66,841,600
ダイダン	10,100	2,274.00	22,967,400
日比谷総合設備	14,700	1,853.00	27,239,100
ニッポン	43,000	1,674.00	71,982,000
日清製粉グループ本社	165,000	1,589.00	262,185,000
日東富士製粉	1,600	4,385.00	7,016,000
昭和産業	14,100	2,690.00	37,929,000
鳥越製粉	13,500	654.00	8,829,000
中部飼料	16,500	1,017.00	16,780,500
フィード・ワン	19,900	677.00	13,472,300
東洋精糖	1,800	1,031.00	1,855,800
日本甜菜製糖	8,000	1,700.00	13,600,000
DM三井製糖ホールディングス	13,500	2,024.00	27,324,000
塩水港精糖	19,700	217.00	4,274,900
日新製糖	7,500	1,805.00	13,537,500
LIFULL	42,500	235.00	9,987,500
ミクシィ	31,700	2,236.00	70,881,200
ジェイエイシーリクルートメント	11,400	1,824.00	20,793,600
日本M&Aセンターホールディングス	227,700	1,702.00	387,545,400
メンバーズ	4,200	2,867.00	12,041,400
中広	1,200	394.00	472,800
UTグループ	20,000	3,465.00	69,300,000
アイティメディア	6,600	1,615.00	10,659,000
E・Jホールディングス	7,500	1,173.00	8,797,500
夢真ビーネックスグループ	45,100	1,608.00	72,520,800
コシダカホールディングス	37,100	642.00	23,818,200
アルトナー	3,600	888.00	3,196,800
パソナグループ	15,100	2,528.00	38,172,800
CDS	2,500	1,616.00	4,040,000
リンクアンドモチベーション	30,600	423.00	12,943,800
エス・エム・エス	47,200	3,120.00	147,264,000
サニーサイドアップグループ	5,000	748.00	3,740,000
パーソルホールディングス	138,800	2,590.00	359,492,000
リニカル	8,000	665.00	5,320,000
クックパッド	43,600	261.00	11,379,600
エスクリ	6,200	428.00	2,653,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,600	571.00	3,768,600
森永製菓	34,400	3,620.00	124,528,000
中村屋	2,600	3,340.00	8,684,000
江崎グリコ	40,200	3,865.00	155,373,000
名糖産業	6,800	1,674.00	11,383,200

井村屋グループ	8,500	2,275.00	19,337,500
不二家	8,400	2,470.00	20,748,000
山崎製パン	109,300	1,517.00	165,808,100
第一屋製パン	3,500	542.00	1,897,000
モロゾフ	3,600	2,712.00	9,763,200
亀田製菓	8,500	4,035.00	34,297,500
寿スピリッツ	14,100	5,910.00	83,331,000
カルビー	66,500	2,526.00	167,979,000
森永乳業	27,000	5,600.00	151,200,000
六甲バター	10,800	1,567.00	16,923,600
ヤクルト本社	108,000	6,090.00	657,720,000
明治ホールディングス	96,400	6,750.00	650,700,000
雪印メグミルク	35,200	1,976.00	69,555,200
プリマハム	18,400	2,364.00	43,497,600
日本ハム	55,800	4,260.00	237,708,000
林兼産業	3,700	499.00	1,846,300
丸大食品	14,600	1,500.00	21,900,000
S Foods	13,200	3,195.00	42,174,000
柿安本店	5,100	2,402.00	12,250,200
伊藤ハム米久ホールディングス	94,500	679.00	64,165,500
学情	5,500	1,048.00	5,764,000
スタジオアリス	6,300	2,168.00	13,658,400
クロスキャット	3,800	1,785.00	6,783,000
シミックホールディングス	7,900	1,531.00	12,094,900
エプコ	3,300	687.00	2,267,100
システナ	203,300	413.00	83,962,900
NJS	2,900	2,020.00	5,858,000
デジタルアーツ	7,800	6,270.00	48,906,000
日鉄ソリューションズ	20,600	3,565.00	73,439,000
総合警備保障	55,200	4,180.00	230,736,000
キューブシステム	7,500	914.00	6,855,000
いちご	159,800	261.00	41,707,800
WOW WORLD	2,200	1,097.00	2,413,400
日本駐車場開発	156,000	136.00	21,216,000
コア	6,300	1,580.00	9,954,000
カカクコム	101,900	2,572.00	262,086,800
アイロムグループ	4,900	1,899.00	9,305,100
セントケア・ホールディング	9,000	812.00	7,308,000
サイネックス	2,500	602.00	1,505,000
ルネサンス	9,700	1,050.00	10,185,000
ディップ	24,400	3,415.00	83,326,000
SBSホールディングス	10,800	3,225.00	34,830,000
デジタルホールディングス	9,400	1,499.00	14,090,600
新日本科学	16,900	1,455.00	24,589,500
キャリアデザインセンター	3,600	1,238.00	4,456,800
ベネフィット・ワン	50,600	2,724.00	137,834,400
エムスリー	244,800	4,260.00	1,042,848,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,400	327.00	2,746,800
プラス	2,200	661.00	1,454,200
アウトソーシング	79,500	1,457.00	115,831,500

ウェルネット	14,100	445.00	6,274,500
ワールドホールディングス	5,500	2,123.00	11,676,500
ディー・エヌ・エー	52,900	1,762.00	93,209,800
博報堂DYホールディングス	193,200	1,500.00	289,800,000
ぐるなび	22,600	421.00	9,514,600
タカミヤ	17,400	379.00	6,594,600
ジャパンベストレスキューシステム	9,300	1,041.00	9,681,300
ファンコミュニケーションズ	34,700	415.00	14,400,500
ライク	3,700	1,912.00	7,074,400
ビジネス・ブレークスルー	5,500	418.00	2,299,000
エスプール	39,200	1,031.00	40,415,200
WDBホールディングス	6,500	2,643.00	17,179,500
手間いらず	1,800	4,965.00	8,937,000
ティア	8,600	431.00	3,706,600
CDG	1,400	1,329.00	1,860,600
アドウェイズ	20,600	638.00	13,142,800
バリューコマース	11,100	3,410.00	37,851,000
インフォマート	152,100	645.00	98,104,500
サッポロホールディングス	49,800	2,237.00	111,402,600
アサヒグループホールディングス	343,000	4,670.00	1,601,810,000
麒麟ホールディングス	535,800	1,890.50	1,012,929,900
宝ホールディングス	99,200	1,109.00	110,012,800
オエノンホールディングス	42,500	351.00	14,917,500
養命酒製造	5,000	1,761.00	8,805,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	102,400	1,418.00	145,203,200
サントリー食品インターナショナル	97,500	4,520.00	440,700,000
ダイドーグループホールディングス	7,600	5,060.00	38,456,000
伊藤園	44,400	6,410.00	284,604,000
キーコーヒー	14,600	2,073.00	30,265,800
ユニカフェ	4,900	953.00	4,669,700
ジャパンフーズ	1,600	1,242.00	1,987,200
日清オイリオグループ	18,500	2,991.00	55,333,500
不二製油グループ本社	31,600	2,201.00	69,551,600
かどや製油	1,100	3,620.00	3,982,000
J-オイルミルズ	14,000	1,719.00	24,066,000
ローソン	31,700	4,760.00	150,892,000
サンエー	10,800	4,085.00	44,118,000
カワチ薬品	11,200	2,401.00	26,891,200
エービーシー・マート	22,400	4,930.00	110,432,000
ハードオフコーポレーション	6,800	804.00	5,467,200
高千穂交易	5,800	1,593.00	9,239,400
アスクル	32,300	1,651.00	53,327,300
ゲオホールディングス	19,100	1,492.00	28,497,200
アダストリア	15,300	1,672.00	25,581,600
ジーフット	9,900	302.00	2,989,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,300	384.00	883,200
オルパヘルスケアホールディングス	1,600	1,540.00	2,464,000
伊藤忠食品	2,900	5,040.00	14,616,000
くら寿司	14,900	3,820.00	56,918,000

キャンドウ	5,200	2,026.00	10,535,200
エレマテック	11,500	1,062.00	12,213,000
アイケイ	4,000	412.00	1,648,000
パルグループホールディングス	12,500	1,553.00	19,412,500
JALUX	4,100	2,558.00	10,487,800
エディオン	65,500	1,175.00	76,962,500
あらた	11,400	3,920.00	44,688,000
サーラコーポレーション	29,200	652.00	19,038,400
ワッツ	7,100	718.00	5,097,800
トーメンデバイス	2,300	6,360.00	14,628,000
ハローズ	6,600	2,777.00	18,328,200
J Pホールディングス	35,300	220.00	7,766,000
フジオフードグループ本社	12,100	1,318.00	15,947,800
あみやき亭	3,400	3,015.00	10,251,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	5,400.00	22,680,000
ひらまつ	30,400	209.00	6,353,600
フィールズ	12,500	654.00	8,175,000
双日	157,900	1,882.00	297,167,800
アルフレッサ ホールディングス	158,800	1,714.00	272,183,200
大黒天物産	4,700	4,695.00	22,066,500
ハニーズホールディングス	11,400	1,023.00	11,662,200
ファーマライズホールディングス	4,000	720.00	2,880,000
キッコーマン	105,000	8,350.00	876,750,000
味の素	322,000	3,258.00	1,049,076,000
ブルドックソース	6,300	1,987.00	12,518,100
キュービー	76,700	2,362.00	181,165,400
ハウス食品グループ本社	54,700	2,898.00	158,520,600
カゴメ	55,300	3,005.00	166,176,500
焼津水産化学工業	5,000	913.00	4,565,000
アリアケジャパン	13,300	5,720.00	76,076,000
ピエトロ	1,200	1,798.00	2,157,600
エバラ食品工業	2,500	2,863.00	7,157,500
やまみ	1,600	1,776.00	2,841,600
ニチレイ	66,500	2,505.00	166,582,500
横浜冷凍	40,900	852.00	34,846,800
東洋水産	70,200	4,765.00	334,503,000
イトアンドホールディングス	5,600	2,160.00	12,096,000
大冷	2,000	1,886.00	3,772,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,800	518.00	4,040,400
日清食品ホールディングス	57,200	8,980.00	513,656,000
永谷園ホールディングス	6,800	2,000.00	13,600,000
一正蒲鉾	6,200	795.00	4,929,000
フジッコ	13,600	1,961.00	26,669,600
ロック・フィールド	15,800	1,555.00	24,569,000
日本たばこ産業	781,800	2,199.50	1,719,569,100
ケンコーマヨネーズ	8,400	1,372.00	11,524,800
わらべや日洋ホールディングス	9,400	1,733.00	16,290,200
なとり	8,000	2,053.00	16,424,000
イフジ産業	2,500	957.00	2,392,500
ピックルスコーポレーション	7,100	1,425.00	10,117,500

ファーマフーズ	13,900	1,516.00	21,072,400
北の達人コーポレーション	50,800	221.00	11,226,800
ユーグレナ	74,100	730.00	54,093,000
紀文食品	8,500	1,196.00	10,166,000
スター・マイカ・ホールディングス	7,900	1,200.00	9,480,000
SREホールディングス	3,500	3,485.00	12,197,500
ADワークスグループ	29,600	139.00	4,114,400
片倉工業	13,600	2,320.00	31,552,000
グンゼ	9,400	3,880.00	36,472,000
ヒューリック	341,900	1,028.00	351,473,200
神栄	2,000	861.00	1,722,000
ラサ商事	8,100	997.00	8,075,700
アルペン	11,100	2,093.00	23,232,300
ハブ	4,800	576.00	2,764,800
ラクーンホールディングス	10,100	1,144.00	11,554,400
クオールホールディングス	17,600	1,257.00	22,123,200
アルコニックス	15,200	1,367.00	20,778,400
神戸物産	111,200	3,870.00	430,344,000
ソリトンシステムズ	7,200	1,533.00	11,037,600
ジーンズホールディングス	9,800	6,530.00	63,994,000
ビックカメラ	84,600	979.00	82,823,400
DCMホールディングス	88,200	1,084.00	95,608,800
ペッパーフードサービス	19,500	349.00	6,805,500
ハイパー	2,300	472.00	1,085,600
Monotaro	180,900	2,149.00	388,754,100
東京一番フーズ	4,000	598.00	2,392,000
DDホールディングス	7,600	491.00	3,731,600
あいホールディングス	20,400	1,726.00	35,210,400
ディービーエックス	4,800	1,055.00	5,064,000
きちりホールディングス	4,100	414.00	1,697,400
アークランドサービスホールディングス	10,700	2,230.00	23,861,000
J.フロントリテイリング	170,700	964.00	164,554,800
ドトール・日レスホールディングス	24,700	1,566.00	38,680,200
マツキヨココカラ&カンパニー	88,000	4,345.00	382,360,000
ブロンコビリー	8,200	2,236.00	18,335,200
ZOZO	98,600	3,230.00	318,478,000
トレジャー・ファクトリー	4,200	953.00	4,002,600
物語コーポレーション	7,100	6,520.00	46,292,000
三越伊勢丹ホールディングス	250,200	913.00	228,432,600
東洋紡	56,200	1,225.00	68,845,000
ユニチカ	38,700	297.00	11,493,900
富士紡ホールディングス	6,300	3,515.00	22,144,500
日清紡ホールディングス	88,700	1,007.00	89,320,900
倉敷紡績	12,100	1,881.00	22,760,100
ダイワボウホールディングス	69,600	1,732.00	120,547,200
シキボウ	7,800	900.00	7,020,000
日東紡績	21,700	3,070.00	66,619,000
トヨタ紡織	59,300	2,071.00	122,810,300
マクニカ・富士エレホールディングス	34,100	2,616.00	89,205,600

H a m e e	3,700	1,171.00	4,332,700	
マーケットエンタープライズ	1,100	705.00	775,500	
ラクト・ジャパン	4,900	1,977.00	9,687,300	
ウエルシアホールディングス	75,600	3,080.00	232,848,000	
クリエイトSDホールディングス	21,100	3,130.00	66,043,000	
グリムス	6,500	2,181.00	14,176,500	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	24,900	801.00	19,944,900	
八洲電機	10,800	999.00	10,789,200	
メディアスホールディングス	8,400	928.00	7,795,200	
レスターホールディングス	13,600	1,975.00	26,860,000	
ジューテックホールディングス	3,600	1,182.00	4,255,200	
丸善CHIホールディングス	18,600	370.00	6,882,000	
大光	6,800	700.00	4,760,000	
OCHIホールディングス	3,600	1,353.00	4,870,800	
TOKAIホールディングス	69,600	897.00	62,431,200	
黒谷	4,000	680.00	2,720,000	
ミサワ	2,900	641.00	1,858,900	
ティーライフ	2,000	1,345.00	2,690,000	
Cominix	1,800	731.00	1,315,800	
エー・ビーホールディングス	2,200	449.00	987,800	
三洋貿易	14,600	996.00	14,541,600	
チムニー	4,500	1,113.00	5,008,500	
シュッピン	11,900	1,176.00	13,994,400	
ビューティガレージ	2,500	3,295.00	8,237,500	
オイシックス・ラ・大地	20,500	2,535.00	51,967,500	
ウイン・パートナーズ	10,700	1,053.00	11,267,100	
ネクステージ	28,900	2,448.00	70,747,200	
ジョイフル本田	41,800	1,552.00	64,873,600	
鳥貴族ホールディングス	5,200	1,754.00	9,120,800	
ホットランド	10,800	1,313.00	14,180,400	
すかいらくホールディングス	184,600	1,496.00	276,161,600	
SFPホールディングス	7,100	1,357.00	9,634,700	
綿半ホールディングス	10,800	1,325.00	14,310,000	
日本毛織	42,900	887.00	38,052,300	
ダイトウボウ	23,500	90.00	2,115,000	
トーア紡コーポレーション	4,200	402.00	1,688,400	
ダイドーリミテッド	20,300	143.00	2,902,900	
ヨシックスホールディングス	2,900	2,114.00	6,130,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,800	1,022.00	42,719,600	
三栄建築設計	5,800	1,571.00	9,111,800	
野村不動産ホールディングス	74,100	2,789.00	206,664,900	
三重交通グループホールディングス	29,500	458.00	13,511,000	
サムティ	23,100	2,135.00	49,318,500	
ディア・ライフ	18,600	509.00	9,467,400	
コーセーアールイー	4,500	580.00	2,610,000	
地主	9,100	1,766.00	16,070,600	
プレサンスコーポレーション	18,600	1,818.00	33,814,800	
フィル・カンパニー	2,800	1,123.00	3,144,400	

THEグローバル社	9,000	175.00	1,575,000
ハウスコム	1,200	1,251.00	1,501,200
日本管理センター	6,900	1,015.00	7,003,500
サンセイランディック	4,500	803.00	3,613,500
エストラスト	1,400	569.00	796,600
フージャースホールディングス	18,500	675.00	12,487,500
オープンハウスグループ	45,600	5,220.00	238,032,000
東急不動産ホールディングス	421,700	634.00	267,357,800
飯田グループホールディングス	119,600	2,136.00	255,465,600
イーグランド	2,500	1,347.00	3,367,500
ムゲンエステート	9,300	472.00	4,389,600
帝国繊維	16,100	1,887.00	30,380,700
日本コークス工業	122,300	138.00	16,877,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,500	954.00	7,155,000
ミタチ産業	4,000	888.00	3,552,000
B E E N O S	7,500	1,493.00	11,197,500
あさひ	11,900	1,334.00	15,874,600
日本調剤	8,700	1,377.00	11,979,900
コスモス薬品	14,600	15,670.00	228,782,000
シップヘルスケアホールディングス	45,900	2,233.00	102,494,700
トーエル	6,800	888.00	6,038,400
ソフトクリエイトホールディングス	6,300	4,450.00	28,035,000
セブン&アイ・ホールディングス	559,700	5,504.00	3,080,588,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	76,200	706.00	53,797,200
明治電機工業	4,700	1,001.00	4,704,700
ツルハホールディングス	31,200	9,080.00	283,296,000
デリカフーズホールディングス	5,900	548.00	3,233,200
スターティアホールディングス	3,400	578.00	1,965,200
サンマルクホールディングス	11,400	1,601.00	18,251,400
フェリシモ	3,400	1,181.00	4,015,400
トリドールホールディングス	35,400	2,414.00	85,455,600
帝人	133,800	1,368.00	183,038,400
東レ	1,029,800	657.10	676,681,580
クラレ	207,900	1,073.00	223,076,700
旭化成	942,500	1,062.00	1,000,935,000
T O K Y O B A S E	13,100	439.00	5,750,900
稲葉製作所	8,200	1,287.00	10,553,400
宮地エンジニアリンググループ	4,500	3,455.00	15,547,500
トーカロ	37,200	1,301.00	48,397,200
アルファ	4,800	1,053.00	5,054,400
S U M C O	221,200	1,857.00	410,768,400
川田テクノロジーズ	2,900	3,710.00	10,759,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,700	5,430.00	25,521,000
ジェイテックコーポレーション	1,600	1,500.00	2,400,000
信和	9,000	812.00	7,308,000
ビーロッド	9,800	505.00	4,949,000
ファーストブラザーズ	3,500	808.00	2,828,000
A n d D o ホールディングス	7,100	904.00	6,418,400
シーアールイー	4,000	1,691.00	6,764,000

プロパティエージェント	1,600	1,435.00	2,296,000
ケイアイスター不動産	6,500	4,985.00	32,402,500
アグレ都市デザイン	2,500	1,377.00	3,442,500
グッドコムアセット	6,300	1,122.00	7,068,600
ジェイ・エス・ビー	2,900	3,125.00	9,062,500
テンポイノベーション	4,100	807.00	3,308,700
グローバル・リンク・マネジメント	2,700	849.00	2,292,300
フェイスネットワーク	1,400	1,325.00	1,855,000
住江織物	3,400	1,917.00	6,517,800
日本フェルト	5,800	449.00	2,604,200
イチカワ	1,400	1,377.00	1,927,800
エコナックホールディングス	25,600	86.00	2,201,600
日東製網	1,600	1,461.00	2,337,600
芦森工業	2,500	906.00	2,265,000
アツギ	11,400	608.00	6,931,200
ウイルプラスホールディングス	2,500	909.00	2,272,500
JMホールディングス	9,700	1,760.00	17,072,000
コメダホールディングス	31,200	2,076.00	64,771,200
サツドラホールディングス	7,300	646.00	4,715,800
アレンザホールディングス	11,100	978.00	10,855,800
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,973.00	7,497,400
パロックジャパンリミテッド	10,500	788.00	8,274,000
クスリのアオキホールディングス	14,200	6,730.00	95,566,000
ダイニック	3,700	751.00	2,778,700
共和レザー	9,100	674.00	6,133,400
ピーバンドットコム	2,300	593.00	1,363,900
力の源ホールディングス	7,600	565.00	4,294,000
FOOD & LIFE COMPANIES	83,700	3,860.00	323,082,000
アセンテック	4,900	711.00	3,483,900
セーレン	29,200	2,255.00	65,846,000
ソトー	6,200	835.00	5,177,000
東海染工	1,400	1,168.00	1,635,200
小松マテーレ	23,300	1,290.00	30,057,000
ワコールホールディングス	35,400	1,965.00	69,561,000
ホギメディカル	19,200	3,285.00	63,072,000
クラウドシアホールディングス	2,500	234.00	585,000
T S Iホールディングス	47,300	319.00	15,088,700
マツオカコーポレーション	4,500	1,210.00	5,445,000
ワールド	18,600	1,221.00	22,710,600
T I S	135,900	2,634.00	357,960,600
J N Sホールディングス	6,600	416.00	2,745,600
グリー	64,900	946.00	61,395,400
GMOペパボ	1,500	2,243.00	3,364,500
コーエーテックモホールディングス	45,600	4,035.00	183,996,000
三菱総合研究所	6,200	3,765.00	23,343,000
ボルテージ	4,000	353.00	1,412,000
電算	1,100	2,304.00	2,534,400
A G S	7,100	780.00	5,538,000
ファインデックス	12,000	704.00	8,448,000

ブレインパッド	11,200	1,109.00	12,420,800	
K L a b	26,000	391.00	10,166,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	20,600	1,040.00	21,424,000	
ネクソン	321,400	2,581.00	829,533,400	
アイスタイル	43,100	184.00	7,930,400	
エムアップホールディングス	16,200	944.00	15,292,800	
エイチーム	9,800	707.00	6,928,600	
エニグモ	15,300	695.00	10,633,500	
テクノスジャパン	11,100	439.00	4,872,900	
e n i s h	8,700	330.00	2,871,000	
コロプラ	46,700	642.00	29,981,400	
オルトプラス	11,100	299.00	3,318,900	
ブロードリーフ	70,600	345.00	24,357,000	
クロス・マーケティンググループ	5,400	819.00	4,422,600	
デジタルハーツホールディングス	6,600	1,545.00	10,197,000	
システム情報	10,700	1,029.00	11,010,300	
メディアドゥ	5,000	2,468.00	12,340,000	
じげん	40,100	290.00	11,629,000	
ブイキューブ	14,600	821.00	11,986,600	
エンカレッジ・テクノロジー	3,400	525.00	1,785,000	
サイバーリンクス	4,800	927.00	4,449,600	
ディー・エル・イー	9,400	221.00	2,077,400	
フィックスターズ	15,200	691.00	10,503,200	
C A R T A H O L D I N G S	5,600	2,282.00	12,779,200	
オブティム	9,900	906.00	8,969,400	
セレス	5,200	1,333.00	6,931,600	
S H I F T	7,200	21,760.00	156,672,000	
特種東海製紙	8,800	3,335.00	29,348,000	
ティーガイア	12,600	1,705.00	21,483,000	
セック	2,300	2,128.00	4,894,400	
テクマトリックス	24,000	1,714.00	41,136,000	
プロシップ	4,900	1,468.00	7,193,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37,100	2,729.00	101,245,900	
G M O ペイメントゲートウェイ	27,600	10,810.00	298,356,000	
ザッパラス	5,500	500.00	2,750,000	
システムリサーチ	4,000	1,853.00	7,412,000	
インターネットイニシアティブ	38,000	3,640.00	138,320,000	
さくらインターネット	15,200	511.00	7,767,200	
ヴィンクス	4,200	965.00	4,053,000	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	3,300	4,415.00	14,569,500	
S R A ホールディングス	7,100	2,856.00	20,277,600	
システムインテグレータ	4,800	526.00	2,524,800	
朝日ネット	13,200	600.00	7,920,000	
e B A S E	17,000	616.00	10,472,000	
アバント	15,300	1,070.00	16,371,000	
アドソル日進	5,000	1,636.00	8,180,000	
O D K ソリューションズ	2,900	620.00	1,798,000	

フリービット	8,500	900.00	7,650,000
コムチュア	16,000	2,883.00	46,128,000
サイバーコム	2,300	979.00	2,251,700
アステリア	10,300	779.00	8,023,700
アイル	7,900	1,306.00	10,317,400
王子ホールディングス	595,000	575.00	342,125,000
日本製紙	68,200	1,076.00	73,383,200
三菱製紙	21,100	310.00	6,541,000
北越コーポレーション	93,600	699.00	65,426,400
中越パルプ工業	5,500	976.00	5,368,000
巴川製紙所	4,500	882.00	3,969,000
大王製紙	68,800	1,665.00	114,552,000
阿波製紙	4,000	327.00	1,308,000
マークライNZ	7,300	2,631.00	19,206,300
メディカル・データ・ビジョン	18,100	1,045.00	18,914,500
g u m i	19,800	528.00	10,454,400
ショーケース	3,400	436.00	1,482,400
モバイルファクトリー	3,300	936.00	3,088,800
テラスカイ	5,100	1,482.00	7,558,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,300	1,263.00	7,956,900
P C Iホールディングス	6,500	972.00	6,318,000
パイブドHD	2,800	2,663.00	7,456,400
アイピーシー	2,600	525.00	1,365,000
ネオジャパン	4,000	1,140.00	4,560,000
P R T I M E S	3,100	2,922.00	9,058,200
ラクス	49,000	1,868.00	91,532,000
ランドコンピュータ	2,500	849.00	2,122,500
ダブルスタンダード	4,400	1,897.00	8,346,800
オーブンドア	8,500	1,827.00	15,529,500
マイネット	5,000	483.00	2,415,000
アカツキ	6,300	2,844.00	17,917,200
ベネフィットジャパン	1,100	2,002.00	2,202,200
U b i c o mホールディングス	3,800	2,181.00	8,287,800
カナミックネットワーク	15,200	456.00	6,931,200
ノムラシステムコーポレーション	7,500	223.00	1,672,500
レンゴー	134,600	832.00	111,987,200
トーモク	8,900	1,703.00	15,156,700
ザ・パック	10,800	2,655.00	28,674,000
チェンジ	26,200	1,680.00	44,016,000
シンクロ・フード	7,500	262.00	1,965,000
オークネット	7,600	1,559.00	11,848,400
キャピタル・アセット・プランニング	2,900	783.00	2,270,700
セグエグループ	3,700	532.00	1,968,400
エイトレッド	2,200	1,943.00	4,274,600
マクロミル	29,100	1,112.00	32,359,200
ビーグリー	3,400	1,229.00	4,178,600
オロ	4,500	2,325.00	10,462,500
ユーザーローカル	4,400	1,492.00	6,564,800
テモナ	3,300	376.00	1,240,800

ニーズウェル	3,400	612.00	2,080,800	
マネーフォワード	21,700	4,935.00	107,089,500	
サインポスト	4,500	881.00	3,964,500	
昭和電工	123,300	2,077.00	256,094,100	
住友化学	1,044,800	550.00	574,640,000	
住友精化	6,300	3,215.00	20,254,500	
日産化学	77,500	6,340.00	491,350,000	
ラサ工業	4,900	1,600.00	7,840,000	
クレハ	11,400	9,070.00	103,398,000	
多木化学	5,500	4,755.00	26,152,500	
テイカ	10,700	1,318.00	14,102,600	
石原産業	23,500	1,046.00	24,581,000	
片倉コープアグリ	2,500	1,158.00	2,895,000	
日本曹達	18,200	3,305.00	60,151,000	
東ソー	205,200	1,763.00	361,767,600	
トクヤマ	45,400	1,741.00	79,041,400	
セントラル硝子	23,200	2,052.00	47,606,400	
東亜合成	79,100	1,072.00	84,795,200	
大阪ソーダ	13,300	3,070.00	40,831,000	
関東電化工業	31,200	1,155.00	36,036,000	
デンカ	51,700	3,490.00	180,433,000	
イビデン	76,200	5,510.00	419,862,000	
信越化学工業	244,400	17,555.00	4,290,442,000	
日本カーバイド工業	5,100	1,419.00	7,236,900	
電算システムホールディングス	5,900	2,693.00	15,888,700	
堺化学工業	9,900	1,951.00	19,314,900	
第一稀元素化学工業	13,300	1,020.00	13,566,000	
エア・ウォーター	134,600	1,634.00	219,936,400	
日本酸素ホールディングス	136,800	2,224.00	304,243,200	
日本化学工業	4,500	2,347.00	10,561,500	
東邦アセチレン	2,600	1,150.00	2,990,000	
日本パーカライジング	71,700	969.00	69,477,300	
高圧ガス工業	22,800	693.00	15,800,400	
チタン工業	1,600	1,694.00	2,710,400	
四国化成工業	18,800	1,425.00	26,790,000	
戸田工業	3,100	2,544.00	7,886,400	
ステラ ケミファ	7,100	2,365.00	16,791,500	
保土谷化学工業	4,500	4,180.00	18,810,000	
日本触媒	23,900	5,440.00	130,016,000	
大日精化工業	11,900	2,201.00	26,191,900	
カネカ	36,800	3,690.00	135,792,000	
協和キリン	170,600	2,921.00	498,322,600	
三菱瓦斯化学	132,200	1,962.00	259,376,400	
三井化学	129,200	2,893.00	373,775,600	
J S R	132,700	3,610.00	479,047,000	
東京応化工業	23,000	7,250.00	166,750,000	
大阪有機化学工業	12,000	2,960.00	35,520,000	
三菱ケミカルホールディングス	950,900	808.00	768,327,200	
K Hネオケム	23,400	2,739.00	64,092,600	
ダイセル	204,600	869.00	177,797,400	

住友ベークライト	22,500	4,790.00	107,775,000
積水化学工業	297,600	1,882.00	560,083,200
日本ゼオン	128,200	1,314.00	168,454,800
アイカ工業	39,600	3,155.00	124,938,000
宇部興産	67,000	2,081.00	139,427,000
積水樹脂	21,700	1,868.00	40,535,600
タキロンシーアイ	31,000	552.00	17,112,000
旭有機材	8,000	1,986.00	15,888,000
ニチパン	8,500	1,782.00	15,147,000
リケンテクノス	35,000	462.00	16,170,000
大倉工業	7,500	1,855.00	13,912,500
積水化成成品工業	19,300	456.00	8,800,800
群栄化学工業	3,500	3,530.00	12,355,000
タイガースポリマー	8,400	449.00	3,771,600
ミライアル	4,700	1,498.00	7,040,600
ダイキアクシス	5,500	721.00	3,965,500
ダイキョーニシカワ	30,300	556.00	16,846,800
竹本容器	5,200	808.00	4,201,600
森六ホールディングス	7,800	1,879.00	14,656,200
恵和	3,600	4,425.00	15,930,000
日本化薬	112,000	1,114.00	124,768,000
カーリットホールディングス	14,100	681.00	9,602,100
ソルクシーズ	12,000	399.00	4,788,000
CLホールディングス	2,900	1,054.00	3,056,600
プレステージ・インターナショナル	51,700	693.00	35,828,100
フェイス	4,000	681.00	2,724,000
プロトコーポレーション	15,200	1,168.00	17,753,600
ハイマックス	4,000	1,236.00	4,944,000
アミューズ	7,600	2,070.00	15,732,000
野村総合研究所	275,500	3,915.00	1,078,582,500
ドリームインキュベータ	3,800	2,380.00	9,044,000
サイバネットシステム	10,100	659.00	6,655,900
クイック	9,400	1,606.00	15,096,400
TAC	8,500	223.00	1,895,500
CEホールディングス	7,500	472.00	3,540,000
日本システム技術	2,900	2,152.00	6,240,800
電通グループ	143,000	4,580.00	654,940,000
インテージホールディングス	16,400	1,728.00	28,339,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,600	1,188.00	7,840,800
東邦システムサイエンス	4,100	917.00	3,759,700
ぴあ	4,900	3,200.00	15,680,000
イオンファンタジー	5,400	1,935.00	10,449,000
ソースネクスト	60,900	154.00	9,378,600
シーティーエス	15,800	829.00	13,098,200
ネクシィーズグループ	4,900	557.00	2,729,300
インフォコム	15,700	2,015.00	31,635,500
メディカルシステムネットワーク	14,000	509.00	7,126,000
日本精化	11,400	2,111.00	24,065,400
扶桑化学工業	12,700	4,565.00	57,975,500
トリケミカル研究所	14,700	2,665.00	39,175,500

シンプレクス・ホールディングス	16,600	1,581.00	26,244,600	
HEROZ	4,000	942.00	3,768,000	
ラクスル	15,700	3,020.00	47,414,000	
I P S	4,000	2,018.00	8,072,000	
F I G	15,800	277.00	4,376,600	
システムサポート	4,200	1,054.00	4,426,800	
A D E K A	65,500	2,637.00	172,723,500	
日油	48,600	4,845.00	235,467,000	
ミヨシ油脂	6,200	1,135.00	7,037,000	
新日本理化	23,300	233.00	5,428,900	
ハリマ化成グループ	10,800	811.00	8,758,800	
イーソル	8,600	503.00	4,325,800	
アルテリア・ネットワークス	18,100	1,323.00	23,946,300	
東海ソフト	2,300	918.00	2,111,400	
ウイングアーク1st	8,100	1,228.00	9,946,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,400	1,663.00	5,654,200	
サーバーワークス	2,600	2,315.00	6,019,000	
東名	1,500	978.00	1,467,000	
ヴィッツ	1,200	1,249.00	1,498,800	
トピラシステムズ	2,900	801.00	2,322,900	
S a n s a n	50,700	983.00	49,838,100	
L i n k - U	2,700	741.00	2,000,700	
ギフトィ	12,500	836.00	10,450,000	
花王	321,400	5,280.00	1,696,992,000	
第一工業製薬	5,400	2,650.00	14,310,000	
石原ケミカル	7,500	1,338.00	10,035,000	
日華化学	4,900	735.00	3,601,500	
ニイタカ	2,900	2,413.00	6,997,700	
三洋化成工業	8,500	5,000.00	42,500,000	
ベース	2,600	5,000.00	13,000,000	
J M D C	13,300	6,460.00	85,918,000	
武田薬品工業	1,141,500	3,434.00	3,919,911,000	
アステラス製薬	1,259,200	1,922.50	2,420,812,000	
大日本住友製薬	89,800	1,231.00	110,543,800	
塩野義製薬	182,600	7,613.00	1,390,133,800	
わかもと製薬	17,400	287.00	4,993,800	
日本新薬	38,000	7,360.00	279,680,000	
中外製薬	454,400	3,853.00	1,750,803,200	
科研製薬	22,800	4,105.00	93,594,000	
エーザイ	174,000	5,696.00	991,104,000	
理研ビタミン	15,200	1,723.00	26,189,600	
ロート製薬	74,600	3,750.00	279,750,000	
小野薬品工業	333,500	2,806.00	935,801,000	
久光製薬	38,300	3,540.00	135,582,000	
有機合成薬品工業	10,100	264.00	2,666,400	
持田製薬	18,500	3,735.00	69,097,500	
参天製薬	270,800	1,267.00	343,103,600	
扶桑薬品工業	5,100	2,291.00	11,684,100	
日本ケミファ	1,200	2,037.00	2,444,400	

ツムラ	45,100	3,085.00	139,133,500
日医工	45,100	824.00	37,162,400
テルモ	410,900	3,661.00	1,504,304,900
H.U.グループホールディングス	36,200	2,987.00	108,129,400
キッセイ薬品工業	25,900	2,369.00	61,357,100
生化学工業	25,600	892.00	22,835,200
栄研化学	25,600	1,710.00	43,776,000
日水製薬	5,800	990.00	5,742,000
鳥居薬品	7,900	2,900.00	22,910,000
JCRファーマ	41,000	2,165.00	88,765,000
東和薬品	20,900	2,934.00	61,320,600
富士製薬工業	9,000	995.00	8,955,000
ゼリア新薬工業	26,600	1,980.00	52,668,000
第一三共	1,141,300	2,807.50	3,204,199,750
キョーリン製薬ホールディングス	29,200	1,835.00	53,582,000
大幸薬品	22,000	571.00	12,562,000
ダイト	9,300	2,995.00	27,853,500
大塚ホールディングス	301,800	3,932.00	1,186,677,600
大正製薬ホールディングス	34,600	5,630.00	194,798,000
ペプチドリーム	76,200	1,948.00	148,437,600
大日本塗料	17,600	803.00	14,132,800
日本ペイントホールディングス	534,700	1,055.00	564,108,500
関西ペイント	147,500	2,281.00	336,447,500
神東塗料	9,900	154.00	1,524,600
中国塗料	33,600	905.00	30,408,000
日本特殊塗料	10,700	862.00	9,223,400
藤倉化成	18,100	460.00	8,326,000
太陽ホールディングス	21,000	3,075.00	64,575,000
DIC	60,100	2,597.00	156,079,700
サカタインクス	28,300	940.00	26,602,000
東洋インキSCホールディングス	30,200	1,867.00	56,383,400
T&K TOKA	11,500	947.00	10,890,500
アルプス技研	12,500	1,912.00	23,900,000
サニックス	24,100	203.00	4,892,300
ダイオーズ	3,500	1,000.00	3,500,000
日本空調サービス	14,800	784.00	11,603,200
オリエンタルランド	164,100	20,895.00	3,428,869,500
フォーカスシステムズ	9,400	900.00	8,460,000
ダスキン	32,200	2,752.00	88,614,400
パーク24	76,900	1,709.00	131,422,100
明光ネットワークジャパン	16,300	556.00	9,062,800
ファルコホールディングス	6,800	1,997.00	13,579,600
クレスコ	10,600	1,871.00	19,832,600
フジ・メディア・ホールディングス	137,300	1,225.00	168,192,500
秀英予備校	3,600	431.00	1,551,600
田谷	1,800	564.00	1,015,200
ラウンドワン	38,700	1,332.00	51,548,400
リゾートトラスト	63,600	1,933.00	122,938,800
オービック	45,100	18,130.00	817,663,000
ジャストシステム	20,300	5,440.00	110,432,000

TDCソフト	12,500	1,098.00	13,725,000
Zホールディングス	2,071,400	562.20	1,164,541,080
ビー・エム・エル	18,000	3,145.00	56,610,000
トレンドマイクロ	76,200	6,330.00	482,346,000
りらいあコミュニケーションズ	21,100	1,046.00	22,070,600
IDホールディングス	9,300	860.00	7,998,000
リソー教育	63,500	373.00	23,685,500
日本オラクル	23,100	8,170.00	188,727,000
早稲田アカデミー	7,900	1,012.00	7,994,800
アルファシステムズ	3,300	3,750.00	12,375,000
フューチャー	30,200	1,418.00	42,823,600
CAC Holdings	8,500	1,289.00	10,956,500
SBテクノロジー	6,300	2,544.00	16,027,200
トーセ	4,400	711.00	3,128,400
ユー・エス・エス	155,300	1,899.00	294,914,700
オービックビジネスコンサルタント	13,700	4,185.00	57,334,500
伊藤忠テクノソリューションズ	64,900	2,921.00	189,572,900
アイティフォー	17,200	783.00	13,467,600
東京個別指導学院	12,100	591.00	7,151,100
東計電算	1,600	4,950.00	7,920,000
サイバーエージェント	342,000	1,474.00	504,108,000
楽天グループ	712,600	957.00	681,958,200
エクスネット	2,500	989.00	2,472,500
クリーク・アンド・リバー社	7,500	1,676.00	12,570,000
モーニングスター	24,400	584.00	14,249,600
テー・オー・ダブリュー	24,500	299.00	7,325,500
大塚商会	77,000	4,410.00	339,570,000
サイボウズ	19,100	1,386.00	26,472,600
山田コンサルティンググループ	7,500	1,151.00	8,632,500
セントラルスポーツ	5,100	2,406.00	12,270,600
パラカ	4,000	1,689.00	6,756,000
電通国際情報サービス	20,500	3,685.00	75,542,500
ACCESS	16,200	592.00	9,590,400
デジタルガレージ	23,500	3,970.00	93,295,000
イーエムシステムズ	23,700	716.00	16,969,200
ウェザーニューズ	4,400	7,780.00	34,232,000
C I J	9,700	808.00	7,837,600
ビジネスエンジニアリング	1,600	3,835.00	6,136,000
日本エンタープライズ	14,700	168.00	2,469,600
WOWOW	6,900	1,732.00	11,950,800
スカラ	12,600	692.00	8,719,200
インテリジェント ウェイブ	8,600	574.00	4,936,400
フルキャストホールディングス	11,900	2,376.00	28,274,400
エン・ジャパン	22,600	3,030.00	68,478,000
あすか製薬ホールディングス	16,600	1,112.00	18,459,200
サワイグループホールディングス	31,800	4,420.00	140,556,000
富士フイルムホールディングス	255,300	7,310.00	1,866,243,000
コニカミノルタ	317,000	481.00	152,477,000
資生堂	270,600	6,543.00	1,770,535,800
ライオン	175,400	1,472.00	258,188,800

高砂香料工業	10,100	2,672.00	26,987,200
マンダム	30,500	1,346.00	41,053,000
ミルボン	18,100	5,880.00	106,428,000
ファンケル	58,900	3,215.00	189,363,500
コーセー	27,400	13,090.00	358,666,000
コタ	9,300	1,582.00	14,712,600
シーボン	1,400	1,844.00	2,581,600
ポーラ・オルビスホールディングス	62,000	1,788.00	110,856,000
ノエビアホールディングス	12,500	5,060.00	63,250,000
アジュバンホールディングス	3,500	1,146.00	4,011,000
新日本製薬	4,000	1,331.00	5,324,000
エステー	9,400	1,533.00	14,410,200
アグロ カネショウ	4,900	1,171.00	5,737,900
コニシ	23,800	1,551.00	36,913,800
長谷川香料	25,200	2,372.00	59,774,400
星光PMC	8,500	588.00	4,998,000
小林製薬	40,800	9,680.00	394,944,000
荒川化学工業	12,100	1,129.00	13,660,900
メック	10,800	3,040.00	32,832,000
日本高純度化学	4,100	2,512.00	10,299,200
タカラバイオ	38,000	2,373.00	90,174,000
JCU	16,400	4,770.00	78,228,000
新田ゼラチン	9,200	652.00	5,998,400
OATアグリオ	6,200	902.00	5,592,400
デクセリアルズ	37,800	3,185.00	120,393,000
アース製薬	12,000	5,620.00	67,440,000
北興化学工業	13,600	849.00	11,546,400
大成ラミック	4,500	2,750.00	12,375,000
クミアイ化学工業	54,200	794.00	43,034,800
日本農薬	26,100	544.00	14,198,400
富士興産	3,700	945.00	3,496,500
ニチレキ	18,600	1,262.00	23,473,200
ユシロ化学工業	7,800	1,030.00	8,034,000
ビービー・カストロール	5,500	1,290.00	7,095,000
富士石油	38,900	266.00	10,347,400
MORESCO	5,000	1,095.00	5,475,000
出光興産	161,300	3,055.00	492,771,500
ENEOSホールディングス	2,184,000	445.50	972,972,000
コスモエネルギーホールディングス	42,100	2,531.00	106,555,100
テスホールディングス	8,400	1,250.00	10,500,000
インフロニア・ホールディングス	194,100	1,020.00	197,982,000
横浜ゴム	84,000	1,598.00	134,232,000
TOYO TIRE	76,600	1,498.00	114,746,800
ブリヂストン	418,500	4,680.00	1,958,580,000
住友ゴム工業	130,500	1,092.00	142,506,000
藤倉コンポジット	11,800	675.00	7,965,000
オカモト	8,700	3,960.00	34,452,000
アキレス	9,300	1,294.00	12,034,200
フコク	6,500	970.00	6,305,000
ニッタ	15,100	2,712.00	40,951,200

クリエートメディック	4,200	974.00	4,090,800
住友理工	28,300	617.00	17,461,100
三ツ星ベルト	17,700	2,117.00	37,470,900
バンドー化学	23,700	845.00	20,026,500
A G C	133,400	5,200.00	693,680,000
日本板硝子	69,700	468.00	32,619,600
石塚硝子	2,500	2,057.00	5,142,500
有沢製作所	21,200	989.00	20,966,800
日本山村硝子	5,600	795.00	4,452,000
日本電気硝子	58,400	2,758.00	161,067,200
オハラ	5,800	1,122.00	6,507,600
住友大阪セメント	26,900	3,355.00	90,249,500
太平洋セメント	82,500	2,156.00	177,870,000
リソルホールディングス	1,600	4,350.00	6,960,000
日本ヒューム	15,200	700.00	10,640,000
日本コンクリート工業	28,800	299.00	8,611,200
三谷セキサン	6,800	6,050.00	41,140,000
アジアパイルホールディングス	23,000	427.00	9,821,000
東海カーボン	121,700	1,071.00	130,340,700
日本カーボン	7,500	4,040.00	30,300,000
東洋炭素	9,400	3,070.00	28,858,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	4,420.00	35,802,000
T O T O	103,700	4,810.00	498,797,000
日本碍子	157,300	1,756.00	276,218,800
日本特殊陶業	110,600	2,043.00	225,955,800
ダントーホールディングス	9,400	294.00	2,763,600
M A R U W A	5,000	14,990.00	74,950,000
品川リフラクトリーズ	3,500	3,825.00	13,387,500
黒崎播磨	2,700	4,250.00	11,475,000
ヨータイ	9,300	1,259.00	11,708,700
東京窯業	19,100	298.00	5,691,800
ニッカトー	6,800	522.00	3,549,600
フジインコーポレーテッド	11,800	6,640.00	78,352,000
クニミネ工業	4,900	991.00	4,855,900
エーアンドエーマテリアル	3,100	901.00	2,793,100
ニチアス	33,800	2,571.00	86,899,800
日本製鉄	642,700	2,039.00	1,310,465,300
神戸製鋼所	267,900	597.00	159,936,300
中山製鋼所	22,800	446.00	10,168,800
合同製鉄	7,800	1,295.00	10,101,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	387,800	1,661.00	644,135,800
東京製鉄	49,000	1,070.00	52,430,000
共英製鋼	16,300	1,558.00	25,395,400
大和工業	27,600	3,565.00	98,394,000
東京製鋼	6,300	1,336.00	8,416,800
大阪製鉄	7,800	1,213.00	9,461,400
淀川製鋼所	19,100	2,705.00	51,665,500
丸一鋼管	50,900	2,819.00	143,487,100
モリ工業	4,400	2,475.00	10,890,000

大同特殊鋼	23,500	4,040.00	94,940,000
日本高周波鋼業	4,200	338.00	1,419,600
日本冶金工業	10,700	2,771.00	29,649,700
山陽特殊製鋼	14,800	2,046.00	30,280,800
愛知製鋼	8,100	2,578.00	20,881,800
日立金属	154,800	2,058.00	318,578,400
日本金属	3,600	1,511.00	5,439,600
大太平洋金属	8,800	3,260.00	28,688,000
新日本電工	92,400	324.00	29,937,600
栗本鐵工所	6,800	1,510.00	10,268,000
虹 技	2,300	938.00	2,157,400
日本鑄鉄管	1,600	998.00	1,596,800
日本製鋼所	43,600	3,645.00	158,922,000
三菱製鋼	9,100	1,251.00	11,384,100
日亜鋼業	19,200	276.00	5,299,200
日本精線	2,500	4,385.00	10,962,500
エンビプロ・ホールディングス	4,800	1,338.00	6,422,400
大紀アルミニウム工業所	21,700	1,672.00	36,282,400
日本軽金属ホールディングス	36,200	1,788.00	64,725,600
三井金属鉱業	38,900	3,305.00	128,564,500
東邦亜鉛	8,000	2,580.00	20,640,000
三菱マテリアル	94,700	2,018.00	191,104,600
住友金属鉱山	183,500	5,512.00	1,011,452,000
DOWAホールディングス	39,200	4,970.00	194,824,000
古河機械金属	23,800	1,279.00	30,440,200
エス・サイエンス	68,200	25.00	1,705,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,500	1,062.00	17,523,000
東邦チタニウム	25,900	1,016.00	26,314,400
UACJ	21,900	2,296.00	50,282,400
CKサンエツ	3,100	4,030.00	12,493,000
古河電気工業	44,600	2,285.00	101,911,000
住友電気工業	537,000	1,511.00	811,407,000
フジクラ	160,000	612.00	97,920,000
昭和電線ホールディングス	12,500	1,862.00	23,275,000
東京特殊電線	1,600	2,863.00	4,580,800
タツタ電線	25,400	451.00	11,455,400
カナレ電気	2,800	1,523.00	4,264,400
平河ヒューテック	8,100	1,178.00	9,541,800
リョービ	17,700	1,067.00	18,885,900
アーレスティ	15,200	367.00	5,578,400
アサヒホールディングス	57,600	2,130.00	122,688,000
東洋製罐グループホールディングス	91,500	1,518.00	138,897,000
ホッカンホールディングス	8,100	1,390.00	11,259,000
コロナ	8,500	883.00	7,505,500
横河ブリッジホールディングス	24,700	2,041.00	50,412,700
駒井ハルテック	2,900	1,979.00	5,739,100
高田機工	700	2,867.00	2,006,900
三和ホールディングス	135,400	1,266.00	171,416,400
文化シャッター	45,800	1,051.00	48,135,800
三協立山	18,600	622.00	11,569,200

アルインコ	10,700	907.00	9,704,900
東洋シャッター	2,500	575.00	1,437,500
L I X I L	226,100	2,564.00	579,720,400
日本ファイルコン	10,700	513.00	5,489,100
ノーリツ	27,600	1,489.00	41,096,400
長府製作所	14,700	1,979.00	29,091,300
リンナイ	27,000	9,320.00	251,640,000
ユニプレス	21,700	765.00	16,600,500
ダイニチ工業	7,100	693.00	4,920,300
日東精工	18,200	500.00	9,100,000
三洋工業	1,400	1,842.00	2,578,800
岡部	27,500	709.00	19,497,500
ジーテクト	18,000	1,413.00	25,434,000
東ブレ	26,800	1,167.00	31,275,600
高周波熱錬	25,600	587.00	15,027,200
東京製網	8,800	852.00	7,497,600
サンコール	12,700	494.00	6,273,800
モリテックスチール	11,300	308.00	3,480,400
パイオラックス	21,300	1,697.00	36,146,100
エイチワン	14,200	644.00	9,144,800
日本発条	132,000	897.00	118,404,000
中央発條	7,100	789.00	5,601,900
アドバネクス	2,200	1,672.00	3,678,400
三浦工業	62,200	3,120.00	194,064,000
タクマ	48,600	1,410.00	68,526,000
テクノプロ・ホールディングス	83,100	3,310.00	275,061,000
アトラグループ	2,600	253.00	657,800
インターワークス	4,400	367.00	1,614,800
アイ・アールジャパンホールディングス	6,500	3,900.00	25,350,000
K e e P e r 技研	8,900	2,046.00	18,209,400
ファーストロジック	2,900	801.00	2,322,900
三機サービス	2,900	1,025.00	2,972,500
G u n o s y	8,700	748.00	6,507,600
デザインワン・ジャパン	3,600	180.00	648,000
イー・ガーディアン	5,500	2,574.00	14,157,000
リブセンス	8,600	171.00	1,470,600
ジャパンマテリアル	42,700	1,743.00	74,426,100
ベクトル	19,500	1,071.00	20,884,500
ウチヤマホールディングス	7,300	327.00	2,387,100
チャーム・ケア・コーポレーション	10,500	1,202.00	12,621,000
キャリアリンク	5,000	1,421.00	7,105,000
I B J	11,400	759.00	8,652,600
アサンテ	6,300	1,565.00	9,859,500
バリューHR	5,500	2,429.00	13,359,500
M & A キャピタルパートナーズ	11,400	5,060.00	57,684,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	1,376.00	7,430,400
E R I ホールディングス	4,000	1,160.00	4,640,000
アピスト	2,200	2,946.00	6,481,200

シグマクシス・ホールディングス	8,500	2,133.00	18,130,500
ウィルグループ	10,300	1,265.00	13,029,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,600	170.00	3,162,000
メドピア	10,700	3,120.00	33,384,000
レアジョブ	2,800	826.00	2,312,800
リクルートホールディングス	1,070,500	4,914.00	5,260,437,000
エラン	19,100	945.00	18,049,500
ツガミ	31,500	1,202.00	37,863,000
オークマ	16,700	4,600.00	76,820,000
芝浦機械	16,300	3,010.00	49,063,000
アマダ	226,700	997.00	226,019,900
アイダエンジニアリング	37,800	976.00	36,892,800
滝澤鉄工所	4,800	1,189.00	5,707,200
F U J I	66,200	2,308.00	152,789,600
牧野フライス製作所	15,800	3,650.00	57,670,000
オーエスジー	66,500	1,884.00	125,286,000
ダイジェット工業	1,100	998.00	1,097,800
旭ダイヤモンド工業	37,900	567.00	21,489,300
D M G 森精機	85,300	1,594.00	135,968,200
ソディック	31,800	757.00	24,072,600
ディスコ	21,200	32,350.00	685,820,000
日東工器	8,000	1,568.00	12,544,000
日進工具	11,400	1,463.00	16,678,200
パンチ工業	12,000	489.00	5,868,000
富士ダイス	6,800	648.00	4,406,400
土木管理総合試験所	6,800	322.00	2,189,600
ネットマーケティング	6,800	414.00	2,815,200
日本郵政	1,812,000	931.90	1,688,602,800
ベルシステム24ホールディングス	19,800	1,343.00	26,591,400
鎌倉新書	15,800	478.00	7,552,400
S M N	3,400	610.00	2,074,000
一蔵	2,300	369.00	848,700
グローバルキッズCOMPANY	2,700	774.00	2,089,800
エアトリ	8,900	2,960.00	26,344,000
アトラエ	9,700	1,912.00	18,546,400
ストライク	5,200	4,455.00	23,166,000
ソラスト	34,100	1,009.00	34,406,900
セラク	4,500	1,219.00	5,485,500
インソース	13,500	1,950.00	26,325,000
豊田自動織機	117,700	8,890.00	1,046,353,000
豊和工業	7,800	816.00	6,364,800
O K K	5,500	745.00	4,097,500
石川製作所	3,800	1,532.00	5,821,600
東洋機械金属	9,800	568.00	5,566,400
津田駒工業	3,400	598.00	2,033,200
エンシュウ	3,500	633.00	2,215,500
島精機製作所	21,000	1,829.00	38,409,000
オプトラ	18,100	1,790.00	32,399,000
N C ホールディングス	4,100	1,882.00	7,716,200
イワキ	9,300	1,018.00	9,467,400

フリー	12,600	1,012.00	12,751,200
ヤマシンフィルタ	28,900	359.00	10,375,100
日阪製作所	18,100	811.00	14,679,100
やまびこ	28,000	1,332.00	37,296,000
野村マイクロ・サイエンス	3,800	3,540.00	13,452,000
平田機工	6,800	5,260.00	35,768,000
ペガサスミシン製造	14,800	525.00	7,770,000
マルマエ	5,900	2,401.00	14,165,900
タツモ	6,800	1,630.00	11,084,000
ナプテスコ	81,900	3,115.00	255,118,500
三井海洋開発	15,300	1,178.00	18,023,400
レオン自動機	15,400	1,024.00	15,769,600
S M C	42,500	68,120.00	2,895,100,000
ホソカワミクロン	10,100	2,638.00	26,643,800
ユニオンツール	5,500	3,680.00	20,240,000
オイレス工業	20,300	1,580.00	32,074,000
日精エー・エス・ビー機械	4,900	2,949.00	14,450,100
サトーホールディングス	19,100	2,018.00	38,543,800
技研製作所	12,600	3,555.00	44,793,000
日本エアテック	6,800	1,018.00	6,922,400
カワタ	4,700	990.00	4,653,000
日精樹脂工業	10,300	1,005.00	10,351,500
オカダアイヨン	4,700	1,416.00	6,655,200
ワイエイシーホールディングス	5,600	1,094.00	6,126,400
小松製作所	658,000	2,681.00	1,764,098,000
住友重機械工業	83,100	2,757.00	229,106,700
日立建機	58,200	2,797.00	162,785,400
日工	20,200	615.00	12,423,000
巴工業	5,800	2,284.00	13,247,200
井関農機	13,500	1,185.00	15,997,500
T O W A	12,500	2,317.00	28,962,500
丸山製作所	3,100	1,512.00	4,687,200
北川鉄工所	6,800	1,295.00	8,806,000
シンニッタン	17,800	222.00	3,951,600
ローツェ	7,300	10,590.00	77,307,000
タカキタ	4,900	618.00	3,028,200
クボタ	704,000	2,059.00	1,449,536,000
荏原実業	6,800	2,182.00	14,837,600
東洋エンジニアリング	19,100	532.00	10,161,200
三菱化工機	4,700	1,953.00	9,179,100
月島機械	26,900	1,040.00	27,976,000
帝国電機製作所	10,500	1,405.00	14,752,500
新東工業	32,200	682.00	21,960,400
澁谷工業	12,600	2,424.00	30,542,400
アイチコーポレーション	21,400	865.00	18,511,000
小森コーポレーション	37,100	737.00	27,342,700
鶴見製作所	11,400	1,762.00	20,086,800
住友精密工業	2,300	1,925.00	4,427,500
日本ギア工業	5,900	269.00	1,587,100
酒井重工業	2,700	2,976.00	8,035,200

荏原製作所	58,100	5,820.00	338,142,000	
石井鐵工所	1,200	3,005.00	3,606,000	
西島製作所	13,300	954.00	12,688,200	
北越工業	13,900	861.00	11,967,900	
ダイキン工業	185,200	20,915.00	3,873,458,000	
オルガノ	4,200	7,880.00	33,096,000	
トーヨーカネツ	5,500	2,400.00	13,200,000	
栗田工業	78,800	4,670.00	367,996,000	
椿本チエイン	19,100	3,250.00	62,075,000	
大同工業	6,600	922.00	6,085,200	
日機装	43,600	777.00	33,877,200	
木村化工機	12,000	817.00	9,804,000	
レイズネクスト	22,400	1,102.00	24,684,800	
アネスト岩田	22,700	813.00	18,455,100	
ダイフク	80,100	8,260.00	661,626,000	
サムコ	3,600	2,320.00	8,352,000	
加藤製作所	6,800	812.00	5,521,600	
油研工業	1,800	1,738.00	3,128,400	
タダノ	76,100	970.00	73,817,000	
フジテック	54,000	2,700.00	145,800,000	
C K D	42,900	1,953.00	83,783,700	
キトー	12,500	1,654.00	20,675,000	
平和	40,600	1,904.00	77,302,400	
理想科学工業	12,100	2,241.00	27,116,100	
SANKYO	31,500	3,185.00	100,327,500	
日本金銭機械	14,800	644.00	9,531,200	
マースグループホールディングス	9,300	1,652.00	15,363,600	
フクシマガリレイ	10,100	3,930.00	39,693,000	
オーイズミ	5,400	390.00	2,106,000	
ダイコク電機	6,800	1,247.00	8,479,600	
竹内製作所	22,100	2,499.00	55,227,900	
アマノ	38,000	2,236.00	84,968,000	
JUKI	20,300	656.00	13,316,800	
サンデン	20,200	200.00	4,040,000	
ジャノメ	12,400	720.00	8,928,000	
ブラザー工業	177,400	2,105.00	373,427,000	
マックス	19,500	1,719.00	33,520,500	
モリタホールディングス	23,300	1,211.00	28,216,300	
グローリー	37,300	2,051.00	76,502,300	
新晃工業	13,600	1,719.00	23,378,400	
大和冷機工業	21,000	1,080.00	22,680,000	
セガサミーホールディングス	144,100	2,090.00	301,169,000	
日本ピストンリング	5,400	1,352.00	7,300,800	
リケン	6,300	2,463.00	15,516,900	
T P R	19,700	1,367.00	26,929,900	
ツバキ・ナカシマ	31,800	947.00	30,114,600	
ホシザキ	42,500	7,940.00	337,450,000	
大豊工業	11,900	699.00	8,318,100	
日本精工	273,300	731.00	199,782,300	
N T N	311,000	213.00	66,243,000	

ジェイテクト	139,100	984.00	136,874,400
不二越	12,500	4,195.00	52,437,500
ミネベアミツミ	250,300	2,502.00	626,250,600
日本トムソン	39,700	529.00	21,001,300
THK	82,000	2,557.00	209,674,000
ユーシン精機	11,500	682.00	7,843,000
前澤給装工業	11,300	974.00	11,006,200
イーグル工業	18,100	1,046.00	18,932,600
前澤工業	8,800	635.00	5,588,000
日本ピラー工業	14,700	2,832.00	41,630,400
キッツ	49,100	651.00	31,964,100
日立製作所	698,600	5,661.00	3,954,774,600
東芝	253,800	4,560.00	1,157,328,000
三菱電機	1,452,300	1,380.50	2,004,900,150
富士電機	87,500	5,850.00	511,875,000
東洋電機製造	5,800	941.00	5,457,800
安川電機	156,500	4,615.00	722,247,500
シンフォニアテクノロジー	17,500	1,281.00	22,417,500
明電舎	24,600	2,252.00	55,399,200
オリジン	4,000	1,222.00	4,888,000
山洋電気	6,500	5,010.00	32,565,000
デンヨー	12,500	1,700.00	21,250,000
PHCホールディングス	16,700	1,542.00	25,751,400
ベイカレント・コンサルティング	9,800	45,650.00	447,370,000
Orchestra Holdings	2,800	2,658.00	7,442,400
アイモバイル	4,000	1,205.00	4,820,000
キャリアインデックス	4,800	714.00	3,427,200
MS-Japan	5,600	814.00	4,558,400
船場	1,600	738.00	1,180,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	43,900	1,459.00	64,050,100
フルテック	2,200	1,344.00	2,956,800
グリーンズ	5,200	505.00	2,626,000
ツナググループ・ホールディングス	3,400	272.00	924,800
GAMewith	4,200	434.00	1,822,800
ソウルドアウト	3,500	1,806.00	6,321,000
MS&Consulting	2,300	706.00	1,623,800
ウェルビー	9,000	1,168.00	10,512,000
エル・ティー・エス	1,800	2,044.00	3,679,200
ミダックホールディングス	6,200	2,327.00	14,427,400
日総工産	10,800	864.00	9,331,200
キュービーネットホールディングス	6,500	1,721.00	11,186,500
RPAホールディングス	19,500	325.00	6,337,500
三櫻工業	19,900	686.00	13,651,400
マキタ	176,800	4,047.00	715,509,600
東芝テック	15,800	4,850.00	76,630,000
芝浦メカトロニクス	2,700	7,690.00	20,763,000
マブチモーター	33,700	3,915.00	131,935,500
日本電産	376,500	9,917.00	3,733,750,500

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,500	386.00	2,509,000	
トレックス・セミコンダクター	7,500	2,467.00	18,502,500	
東光高岳	8,100	1,427.00	11,558,700	
ダブル・スコープ	41,800	973.00	40,671,400	
宮越ホールディングス	5,500	854.00	4,697,000	
ダイヘン	15,900	4,235.00	67,336,500	
ヤーマン	23,700	919.00	21,780,300	
JVCケンウッド	118,000	181.00	21,358,000	
ミマキエンジニアリング	13,200	741.00	9,781,200	
I - P E X	6,800	1,464.00	9,955,200	
日新電機	34,300	1,423.00	48,808,900	
大崎電気工業	26,500	482.00	12,773,000	
オムロン	121,000	7,751.00	937,871,000	
日東工業	19,300	1,582.00	30,532,600	
I D E C	18,100	2,445.00	44,254,500	
正興電機製作所	4,500	1,112.00	5,004,000	
不二電機工業	3,400	1,086.00	3,692,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47,300	2,402.00	113,614,600	
サクサホールディングス	2,900	1,439.00	4,173,100	
メルコホールディングス	3,300	3,705.00	12,226,500	
テクノメディカ	3,500	1,560.00	5,460,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,100	964.00	3,952,400	
日本電気	184,600	4,905.00	905,463,000	
富士通	130,800	16,690.00	2,183,052,000	
沖電気工業	59,100	847.00	50,057,700	
岩崎通信機	6,200	823.00	5,102,600	
電気興業	7,800	2,359.00	18,400,200	
サンケン電気	13,600	5,190.00	70,584,000	
ナカヨ	2,200	1,125.00	2,475,000	
アイホン	8,400	2,095.00	17,598,000	
ルネサスエレクトロニクス	787,000	1,356.00	1,067,172,000	
セイコーエプソン	180,200	1,745.00	314,449,000	
ワコム	112,600	852.00	95,935,200	
アルバック	28,900	5,680.00	164,152,000	
アクセル	6,200	1,080.00	6,696,000	
E I Z O	11,400	3,600.00	41,040,000	
ジャパンディスプレイ	493,900	42.00	20,743,800	
日本信号	37,100	866.00	32,128,600	
京三製作所	31,200	423.00	13,197,600	
能美防災	19,200	1,968.00	37,785,600	
ホーチキ	10,700	1,198.00	12,818,600	
星和電機	7,100	484.00	3,436,400	
エレコム	33,300	1,542.00	51,348,600	
パナソニック	1,549,100	1,177.00	1,823,290,700	
シャープ	165,600	1,072.00	177,523,200	
アンリツ	93,500	1,608.00	150,348,000	
富士通ゼネラル	39,400	2,480.00	97,712,000	
ソニーグループ	909,900	11,810.00	10,745,919,000	
T D K	210,500	4,645.00	977,772,500	

帝国通信工業	6,600	1,375.00	9,075,000
タムラ製作所	56,100	600.00	33,660,000
アルプスアルパイン	128,300	1,152.00	147,801,600
池上通信機	4,900	649.00	3,180,100
日本電波工業	13,200	1,142.00	15,074,400
鈴木	6,800	820.00	5,576,000
メイコー	11,900	3,930.00	46,767,000
日本トリム	2,900	2,742.00	7,951,800
ローランド ディー.ジー.	8,600	2,893.00	24,879,800
フォスター電機	14,600	767.00	11,198,200
SMK	3,500	2,138.00	7,483,000
ヨコオ	10,700	2,665.00	28,515,500
ティアック	23,200	116.00	2,691,200
ホシデン	35,000	1,184.00	41,440,000
ヒロセ電機	22,500	17,230.00	387,675,000
日本航空電子工業	33,300	1,812.00	60,339,600
TOA	15,800	770.00	12,166,000
マクセル	28,900	1,173.00	33,899,700
古野電気	17,200	1,049.00	18,042,800
ユニデンホールディングス	3,300	3,560.00	11,748,000
スミダコーポレーション	13,700	885.00	12,124,500
アイコム	5,500	2,390.00	13,145,000
リオン	5,500	2,101.00	11,555,500
本多通信工業	11,800	493.00	5,817,400
横河電機	145,400	1,840.00	267,536,000
新電元工業	5,500	2,879.00	15,834,500
アズビル	85,200	4,300.00	366,360,000
東亜ディーケーケー	7,500	903.00	6,772,500
日本光電工業	60,100	3,085.00	185,408,500
チノー	4,800	1,534.00	7,363,200
共和電業	14,700	376.00	5,527,200
日本電子材料	7,100	1,951.00	13,852,100
堀場製作所	26,900	6,720.00	180,768,000
アドバンテスト	108,000	9,220.00	995,760,000
小野測器	6,800	487.00	3,311,600
エスペック	11,900	2,036.00	24,228,400
キーエンス	131,600	54,480.00	7,169,568,000
日置電機	6,900	6,690.00	46,161,000
シスメックス	122,900	8,824.00	1,084,469,600
日本マイクロニクス	25,300	1,630.00	41,239,000
メガチップス	13,600	3,595.00	48,892,000
OBARA GROUP	6,800	3,080.00	20,944,000
IMAGICA GROUP	12,000	626.00	7,512,000
澤藤電機	1,800	1,480.00	2,664,000
デンソー	319,800	8,119.00	2,596,456,200
原田工業	7,500	991.00	7,432,500
コーセル	16,100	815.00	13,121,500
イリソ電子工業	12,100	3,945.00	47,734,500
オブテックスグループ	23,700	1,647.00	39,033,900
千代田インテグレ	6,300	1,923.00	12,114,900

アイ・オー・データ機器	5,500	1,296.00	7,128,000	
レーザーテック	63,700	20,880.00	1,330,056,000	
スタンレー電気	101,500	2,724.00	276,486,000	
岩崎電気	5,400	2,235.00	12,069,000	
ウシオ電機	74,400	1,846.00	137,342,400	
岡谷電機産業	9,200	305.00	2,806,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	12,700	289.00	3,670,300	
エノモト	4,000	1,437.00	5,748,000	
日本セラミック	13,600	2,481.00	33,741,600	
遠藤照明	6,800	999.00	6,793,200	
古河電池	10,600	1,264.00	13,398,400	
双信電機	6,300	551.00	3,471,300	
山一電機	10,700	1,898.00	20,308,600	
図研	9,400	3,215.00	30,221,000	
日本電子	30,400	6,690.00	203,376,000	
カシオ計算機	105,200	1,337.00	140,652,400	
ファナック	127,500	21,075.00	2,687,062,500	
日本シイエムケイ	28,600	619.00	17,703,400	
エンプラス	3,600	2,615.00	9,414,000	
大真空	19,700	1,061.00	20,901,700	
ローム	65,000	9,020.00	586,300,000	
浜松ホトニクス	104,200	5,670.00	590,814,000	
三井ハイテック	14,400	8,260.00	118,944,000	
新光電気工業	42,700	4,680.00	199,836,000	
京セラ	204,400	6,590.00	1,346,996,000	
協栄産業	1,600	1,545.00	2,472,000	
太陽誘電	70,400	5,110.00	359,744,000	
村田製作所	426,600	7,842.00	3,345,397,200	
双葉電子工業	24,800	667.00	16,541,600	
日東電工	87,900	8,310.00	730,449,000	
北陸電気工業	5,500	1,277.00	7,023,500	
東海理化電機製作所	38,300	1,515.00	58,024,500	
ニチコン	45,700	1,208.00	55,205,600	
日本ケミコン	13,900	1,800.00	25,020,000	
K O A	22,000	1,423.00	31,306,000	
三井E & Sホールディングス	52,300	339.00	17,729,700	
日立造船	122,800	760.00	93,328,000	
三菱重工業	228,200	3,321.00	757,852,200	
川崎重工業	106,000	2,058.00	218,148,000	
I H I	90,700	2,576.00	233,643,200	
名村造船所	43,100	265.00	11,421,500	
サノヤスホールディングス	16,800	127.00	2,133,600	
スプリックス	4,000	1,392.00	5,568,000	
マネジメントソリューションズ	6,800	3,150.00	21,420,000	
プロレド・パートナーズ	2,900	795.00	2,305,500	
and factory	3,300	390.00	1,287,000	
テノ・ホールディングス	2,000	587.00	1,174,000	
フロンティア・マネジメント	3,600	888.00	3,196,800	
ピアラ	2,300	517.00	1,189,100	
コプロ・ホールディングス	2,900	1,033.00	2,995,700	

ギークス	2,600	1,088.00	2,828,800	
カーブスホールディングス	38,200	697.00	26,625,400	
フォーラムエンジニアリング	9,800	842.00	8,251,600	
FAST FITNESS JAPAN	2,000	1,777.00	3,554,000	
日本車輛製造	5,500	2,062.00	11,341,000	
三菱ロジスネクスト	19,200	926.00	17,779,200	
近畿車輛	1,600	1,098.00	1,756,800	
一家ホールディングス	2,700	528.00	1,425,600	
フルサト・マルカホールディングス	13,900	2,345.00	32,595,500	
ヤマエグループホールディングス	9,700	1,092.00	10,592,400	
藤久ホールディングス	3,500	647.00	2,264,500	
F P G	48,200	858.00	41,355,600	
島根銀行	4,400	541.00	2,380,400	
じもとホールディングス	10,700	674.00	7,211,800	
全国保証	34,300	4,780.00	163,954,000	
めぶきフィナンシャルグループ	742,600	266.00	197,531,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,200	1,154.00	12,924,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,100	1,915.00	34,661,500	
九州フィナンシャルグループ	292,700	402.00	117,665,400	
かんぼ生命保険	144,100	1,932.00	278,401,200	
ゆうちょ銀行	338,600	1,002.00	339,277,200	
あんしん保証	4,900	285.00	1,396,500	
富山第一銀行	35,300	319.00	11,260,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	818,000	469.00	383,642,000	
ジェイリース	4,900	1,603.00	7,854,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,500	797.00	74,519,500	
イントラスト	6,200	602.00	3,732,400	
日本モーゲージサービス	8,100	1,037.00	8,399,700	
C A S A	5,000	827.00	4,135,000	
アルヒ	21,100	1,000.00	21,100,000	
プレミアグループ	7,500	4,130.00	30,975,000	
日産自動車	1,712,800	564.90	967,560,720	
いすゞ自動車	455,800	1,534.00	699,197,200	
トヨタ自動車	7,360,200	2,104.00	15,485,860,800	
日野自動車	181,300	1,073.00	194,534,900	
三菱自動車工業	537,500	306.00	164,475,000	
エフテック	10,100	513.00	5,181,300	
レシップホールディングス	5,600	552.00	3,091,200	
G M B	2,800	745.00	2,086,000	
ファルテック	2,900	680.00	1,972,000	
武蔵精密工業	32,300	1,782.00	57,558,600	
日産車体	21,400	663.00	14,188,200	
新明和工業	41,200	909.00	37,450,800	
極東開発工業	26,900	1,422.00	38,251,800	
トピー工業	12,000	1,090.00	13,080,000	
ティラド	4,200	2,472.00	10,382,400	

曙ブレーキ工業	79,600	161.00	12,815,600
タチエス	25,400	1,094.00	27,787,600
NOK	70,400	1,190.00	83,776,000
フタバ産業	36,400	384.00	13,977,600
KYB	15,200	3,005.00	45,676,000
市光工業	17,500	493.00	8,627,500
大同メタル工業	28,200	621.00	17,512,200
プレス工業	72,100	372.00	26,821,200
ミクニ	19,300	398.00	7,681,400
太平洋工業	30,400	1,003.00	30,491,200
河西工業	17,500	285.00	4,987,500
アイシン	106,400	4,195.00	446,348,000
マツダ	455,800	868.00	395,634,400
今仙電機製作所	9,400	589.00	5,536,600
本田技研工業	1,143,400	3,532.00	4,038,488,800
スズキ	332,100	4,628.00	1,536,958,800
SUBARU	416,100	1,880.00	782,268,000
安永	7,100	814.00	5,779,400
ヤマハ発動機	189,600	2,531.00	479,877,600
小糸製作所	79,700	5,900.00	470,230,000
TBK	16,700	397.00	6,629,900
エクセディ	22,000	1,646.00	36,212,000
ミツバ	26,700	377.00	10,065,900
豊田合成	46,800	2,135.00	99,918,000
愛三工業	22,800	726.00	16,552,800
盟和産業	1,600	1,012.00	1,619,200
日本プラスト	11,400	532.00	6,064,800
ヨロズ	13,700	914.00	12,521,800
エフ・シー・シー	23,700	1,397.00	33,108,900
新家工業	3,700	1,701.00	6,293,700
シマノ	58,100	26,130.00	1,518,153,000
テイ・エス テック	61,300	1,538.00	94,279,400
三十三フィナンシャルグループ	13,500	1,469.00	19,831,500
第四北越フィナンシャルグループ	23,300	2,587.00	60,277,100
ひろぎんホールディングス	211,700	662.00	140,145,400
マーキュリアホールディングス	5,000	513.00	2,565,000
おきなわフィナンシャルグループ	12,900	2,369.00	30,560,100
ダイレクトマーケティングミックス	15,000	1,593.00	23,895,000
ポピンズホールディングス	3,400	2,203.00	7,490,200
LITALICO	11,400	2,859.00	32,592,600
十六フィナンシャルグループ	19,200	2,392.00	45,926,400
北國フィナンシャルホールディングス	13,300	3,005.00	39,966,500
ネットプロテクションズホールディングス	32,600	569.00	18,549,400
ジャムコ	8,500	778.00	6,613,000
小野建	14,100	1,566.00	22,080,600
はるやまホールディングス	6,800	566.00	3,848,800
南陽	2,300	1,917.00	4,409,100
ノジマ	23,100	2,513.00	58,050,300
佐島電機	9,000	895.00	8,055,000

カッパ・クリエイト	20,200	1,385.00	27,977,000
エコートレーディング	2,900	585.00	1,696,500
伯東	8,600	2,456.00	21,121,600
コンドーテック	11,400	991.00	11,297,400
中山福	7,500	406.00	3,045,000
ライトオン	11,100	709.00	7,869,900
ナガイレーベン	19,100	2,166.00	41,370,600
三菱食品	14,000	3,055.00	42,770,000
良品計画	164,700	1,711.00	281,801,700
三城ホールディングス	15,500	257.00	3,983,500
松田産業	10,600	2,338.00	24,782,800
第一興商	27,200	3,510.00	95,472,000
メディバルホールディングス	154,300	2,044.00	315,389,200
アドヴァングループ	14,700	940.00	13,818,000
S P K	5,900	1,309.00	7,723,100
萩原電気ホールディングス	5,400	2,132.00	11,512,800
アルビス	4,800	2,201.00	10,564,800
アズワン	20,900	6,800.00	142,120,000
スズデン	5,200	2,110.00	10,972,000
尾家産業	3,100	988.00	3,062,800
シモジマ	8,900	1,035.00	9,211,500
ドウシシャ	13,600	1,524.00	20,726,400
小津産業	2,500	2,021.00	5,052,500
コナカ	16,700	345.00	5,761,500
高速	8,700	1,533.00	13,337,100
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,707.00	2,048,400
G - 7ホールディングス	16,000	1,659.00	26,544,000
たけびし	5,500	1,438.00	7,909,000
イオン北海道	25,400	1,116.00	28,346,400
コジマ	24,500	537.00	13,156,500
ヒマラヤ	5,000	959.00	4,795,000
コーナン商事	20,400	3,450.00	70,380,000
ネットワンシステムズ	54,300	2,740.00	148,782,000
エコス	5,400	1,994.00	10,767,600
ワタミ	17,400	937.00	16,303,800
マルシェ	4,000	472.00	1,888,000
リックス	2,500	1,624.00	4,060,000
システムソフト	30,400	93.00	2,827,200
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	286,000	1,863.00	532,818,000
丸文	12,600	698.00	8,794,800
西松屋チェーン	31,300	1,418.00	44,383,400
ゼンショーホールディングス	69,900	2,734.00	191,106,600
ハビネット	12,000	1,567.00	18,804,000
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,425.00	12,967,500
ハークスレイ	6,200	455.00	2,821,000
橋本総業ホールディングス	2,900	1,977.00	5,733,300
日本ライフライン	42,400	1,035.00	43,884,000
サイゼリヤ	21,200	2,928.00	62,073,600
タカショー	10,800	669.00	7,225,200

VTホールディングス	54,000	482.00	26,028,000
アルゴグラフィックス	11,300	3,235.00	36,555,500
魚力	3,800	2,076.00	7,888,800
IDOM	43,400	656.00	28,470,400
日本エム・ディ・エム	8,500	1,586.00	13,481,000
ポブラ	4,500	147.00	661,500
フジ・コーポレーション	7,800	1,182.00	9,219,600
ユナイテッドアローズ	14,900	1,719.00	25,613,100
進和	8,600	1,895.00	16,297,000
エスケイジャパン	3,300	415.00	1,369,500
ダイترون	6,200	1,758.00	10,899,600
ハイデイ日高	20,600	1,703.00	35,081,800
シークス	20,400	1,100.00	22,440,000
YU-WA CREATION HOLDINGS	8,500	200.00	1,700,000
コロワイド	58,700	1,711.00	100,435,700
ピーシーデポコーポレーション	16,700	284.00	4,742,800
田中商事	3,300	644.00	2,125,200
オーハシテクニカ	8,100	1,326.00	10,740,600
壱番屋	10,100	4,590.00	46,359,000
白銅	4,700	2,569.00	12,074,300
トップカルチャー	5,500	288.00	1,584,000
PLANT	3,600	654.00	2,354,400
スギホールディングス	28,600	6,420.00	183,612,000
ダイコー通産	1,600	1,198.00	1,916,800
薬王堂ホールディングス	7,200	2,350.00	16,920,000
島津製作所	187,000	4,035.00	754,545,000
JMS	12,100	589.00	7,126,900
クボテック	3,300	252.00	831,600
長野計器	10,700	1,288.00	13,781,600
ブイ・テクノロジー	6,300	3,420.00	21,546,000
スター精密	22,500	1,478.00	33,255,000
東京計器	9,300	1,031.00	9,588,300
愛知時計電機	3,600	1,892.00	6,811,200
インターアクション	7,500	2,099.00	15,742,500
オーバル	13,200	274.00	3,616,800
東京精密	24,500	4,660.00	114,170,000
マニー	57,900	1,593.00	92,234,700
ニコン	221,800	1,193.00	264,607,400
トプコン	68,300	1,508.00	102,996,400
オリンパス	761,800	2,343.50	1,785,278,300
理研計器	11,900	4,725.00	56,227,500
SCREENホールディングス	25,300	10,940.00	276,782,000
キャノン電子	13,500	1,593.00	21,505,500
タムロン	11,400	2,291.00	26,117,400
HOYA	283,500	14,820.00	4,201,470,000
シード	6,800	511.00	3,474,800
ノーリツ鋼機	13,100	2,180.00	28,558,000
エー・アンド・デイ	13,300	892.00	11,863,600
朝日インテック	159,200	2,366.00	376,667,200

キヤノン	721,600	2,706.00	1,952,649,600	
リコー	403,100	975.00	393,022,500	
シチズン時計	170,000	490.00	83,300,000	
リズム	4,500	1,412.00	6,354,000	
大研医器	11,900	530.00	6,307,000	
メニコン	48,200	2,960.00	142,672,000	
シンシア	1,800	487.00	876,600	
中本パックス	4,200	1,619.00	6,799,800	
スノーピーク	22,000	2,857.00	62,854,000	
パラマウントベッドホールディングス	27,900	1,981.00	55,269,900	
トランザクション	8,000	966.00	7,728,000	
粧美堂	4,900	396.00	1,940,400	
ニホンフラッシュ	12,500	1,025.00	12,812,500	
前田工織	16,100	3,250.00	52,325,000	
永大産業	20,300	293.00	5,947,900	
アートネイチャー	12,600	732.00	9,223,200	
バンダイナムコホールディングス	130,200	8,439.00	1,098,757,800	
アイフィスジャパン	4,200	660.00	2,772,000	
共立印刷	24,800	151.00	3,744,800	
SHOEI	13,700	4,485.00	61,444,500	
フランスベッドホールディングス	19,100	919.00	17,552,900	
マーベラス	22,500	720.00	16,200,000	
パイロットコーポレーション	24,600	4,520.00	111,192,000	
萩原工業	9,400	1,205.00	11,327,000	
エイベックス	24,600	1,368.00	33,652,800	
フジシールインターナショナル	35,300	1,793.00	63,292,900	
タカラトミー	60,700	1,230.00	74,661,000	
広済堂ホールディングス	8,900	867.00	7,716,300	
エステールホールディングス	4,000	652.00	2,608,000	
レック	18,900	941.00	17,784,900	
タカノ	5,400	698.00	3,769,200	
三光合成	15,300	345.00	5,278,500	
プロネクサス	11,400	1,100.00	12,540,000	
ホクシン	10,800	143.00	1,544,400	
ウッドワン	4,500	997.00	4,486,500	
大建工業	8,600	2,143.00	18,429,800	
きもと	22,600	211.00	4,768,600	
凸版印刷	220,800	2,195.00	484,656,000	
大日本印刷	171,700	2,916.00	500,677,200	
共同印刷	4,500	2,741.00	12,334,500	
N I S S H A	29,800	1,286.00	38,322,800	
光村印刷	700	1,553.00	1,087,100	
藤森工業	13,100	4,010.00	52,531,000	
ヴィア・ホールディングス	19,100	154.00	2,941,400	
TAKARA & COMPANY	7,300	1,838.00	13,417,400	
前澤化成工業	9,400	1,254.00	11,787,600	
未来工業	5,500	1,518.00	8,349,000	
アシックス	128,300	2,300.00	295,090,000	
ツツミ	3,700	1,873.00	6,930,100	
ウェーブロックホールディングス	5,500	712.00	3,916,000	

JSP	8,600	1,568.00	13,484,800
ニチハ	20,300	2,528.00	51,318,400
ローランド	10,100	3,960.00	39,996,000
エフピコ	26,700	3,155.00	84,238,500
小松ウオール工業	4,200	1,849.00	7,765,800
ヤマハ	84,500	5,340.00	451,230,000
河合楽器製作所	4,100	3,030.00	12,423,000
クリナップ	13,900	544.00	7,561,600
ビジョン	87,900	2,106.00	185,117,400
天馬	11,400	2,580.00	29,412,000
兼松サステック	600	1,631.00	978,600
キングジム	12,100	883.00	10,684,300
象印マホービン	39,300	1,430.00	56,199,000
リンテック	31,200	2,547.00	79,466,400
信越ポリマー	26,100	1,080.00	28,188,000
東リ	38,300	224.00	8,579,200
イトーキ	26,500	356.00	9,434,000
任天堂	82,000	56,900.00	4,665,800,000
三菱鉛筆	23,900	1,241.00	29,659,900
松風	6,300	1,700.00	10,710,000
タカラスタANDARD	30,200	1,318.00	39,803,600
コクヨ	69,700	1,588.00	110,683,600
ナカバヤシ	13,900	509.00	7,075,100
ニフコ	48,500	3,325.00	161,262,500
立川ブラインド工業	6,600	1,059.00	6,989,400
グロープライド	13,100	2,860.00	37,466,000
オカムラ	50,000	1,157.00	57,850,000
バルカー	11,900	2,659.00	31,642,100
MUTOHホールディングス	1,200	2,081.00	2,497,200
伊藤忠商事	1,000,500	3,756.00	3,757,878,000
丸紅	1,411,000	1,202.00	1,696,022,000
スクロール	22,000	902.00	19,844,000
高島	2,300	2,324.00	5,345,200
ヨンドシーホールディングス	13,200	1,650.00	21,780,000
三陽商会	6,800	821.00	5,582,800
長瀬産業	78,700	1,808.00	142,289,600
ナイガイ	4,100	278.00	1,139,800
蝶理	8,100	1,779.00	14,409,900
豊田通商	143,600	4,785.00	687,126,000
オンワードホールディングス	85,300	264.00	22,519,200
三共生興	19,300	568.00	10,962,400
兼松	53,300	1,384.00	73,767,200
美津濃	14,600	2,227.00	32,514,200
ツカモトコーポレーション	1,800	1,336.00	2,404,800
ルックホールディングス	4,500	1,569.00	7,060,500
三井物産	1,110,700	2,994.50	3,325,991,150
日本紙パルプ商事	7,600	4,085.00	31,046,000
東京エレクトロン	92,200	56,600.00	5,218,520,000
カメイ	16,900	1,038.00	17,542,200
東都水産	600	3,915.00	2,349,000

OUGホールディングス	2,300	2,778.00	6,389,400	
スターゼン	10,700	2,076.00	22,213,200	
セイコーホールディングス	20,400	2,362.00	48,184,800	
山善	60,100	1,006.00	60,460,600	
椿本興業	2,300	4,075.00	9,372,500	
住友商事	902,800	1,876.00	1,693,652,800	
日本ユニシス	44,500	3,105.00	138,172,500	
内田洋行	6,200	4,680.00	29,016,000	
三菱商事	1,071,900	3,943.00	4,226,501,700	
第一実業	6,600	4,275.00	28,215,000	
キヤノンマーケティングジャパン	35,400	2,407.00	85,207,800	
西華産業	7,800	1,556.00	12,136,800	
佐藤商事	12,000	1,217.00	14,604,000	
菱洋エレクトロ	8,500	2,104.00	17,884,000	
東京産業	13,100	694.00	9,091,400	
ユアサ商事	13,600	2,931.00	39,861,600	
神鋼商事	3,400	3,835.00	13,039,000	
トルク	5,900	216.00	1,274,400	
阪和興業	28,600	3,245.00	92,807,000	
正栄食品工業	9,300	4,205.00	39,106,500	
カナデン	11,900	1,010.00	12,019,000	
菱電商事	11,400	1,765.00	20,121,000	
ニプロ	108,300	1,074.00	116,314,200	
岩谷産業	34,400	5,470.00	188,168,000	
ナイス	5,000	1,818.00	9,090,000	
ニチモウ	2,300	2,682.00	6,168,600	
極東貿易	4,100	2,208.00	9,052,800	
アステナホールディングス	20,000	418.00	8,360,000	
兼松エレクトロニクス	7,900	3,880.00	30,652,000	
三愛石油	35,200	938.00	33,017,600	
稲畑産業	31,500	2,468.00	77,742,000	
G S Iクレオス	6,800	1,137.00	7,731,600	
明和産業	13,200	1,095.00	14,454,000	
クワザワホールディングス	4,500	600.00	2,700,000	
キムラタン	78,900	18.00	1,420,200	
ゴールドウイン	25,600	6,060.00	155,136,000	
ユニ・チャーム	279,900	4,281.00	1,198,251,900	
デサント	27,700	2,883.00	79,859,100	
キング	6,600	517.00	3,412,200	
ワキタ	30,600	970.00	29,682,000	
ヤマトインターナショナル	13,200	292.00	3,854,400	
東邦ホールディングス	45,900	1,837.00	84,318,300	
サンゲツ	37,900	1,585.00	60,071,500	
ミツウロコグループホールディングス	21,100	1,071.00	22,598,100	
シナネンホールディングス	5,400	3,340.00	18,036,000	
伊藤忠エネクス	31,700	1,029.00	32,619,300	
サンリオ	44,400	2,355.00	104,562,000	
サンワテクノス	8,700	1,316.00	11,449,200	
リョーサン	15,800	2,299.00	36,324,200	
新光商事	21,700	921.00	19,985,700	

トーヨー	6,800	1,015.00	6,902,000
三信電気	6,800	1,657.00	11,267,600
東陽テクニカ	14,100	1,080.00	15,228,000
モスフードサービス	18,900	3,015.00	56,983,500
加賀電子	12,900	3,005.00	38,764,500
三益半導体工業	11,400	2,358.00	26,881,200
都築電気	7,500	1,417.00	10,627,500
ソーダニッカ	14,900	723.00	10,772,700
立花エレテック	11,500	1,593.00	18,319,500
木曽路	19,100	2,127.00	40,625,700
SRSホールディングス	19,800	830.00	16,434,000
千趣会	26,100	368.00	9,604,800
タカキュー	12,700	112.00	1,422,400
リテールパートナーズ	17,400	1,230.00	21,402,000
ケーヨー	26,600	871.00	23,168,600
上新電機	16,400	2,058.00	33,751,200
日本瓦斯	69,600	1,706.00	118,737,600
ロイヤルホールディングス	24,600	1,941.00	47,748,600
東天紅	600	913.00	547,800
いなげや	17,800	1,397.00	24,866,600
チヨダ	13,900	711.00	9,882,900
ライフコーポレーション	13,300	2,917.00	38,796,100
リンガーハット	17,700	2,178.00	38,550,600
MrMaxHD	18,000	562.00	10,116,000
テナアライド	15,100	319.00	4,816,900
AOKIホールディングス	27,600	589.00	16,256,400
オークワ	22,500	951.00	21,397,500
コメリ	22,100	2,770.00	61,217,000
青山商事	29,400	678.00	19,933,200
しまむら	16,600	10,470.00	173,802,000
はせがわ	7,900	287.00	2,267,300
高島屋	104,100	1,099.00	114,405,900
松屋	28,800	684.00	19,699,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,700	836.00	56,597,200
近鉄百貨店	5,500	2,481.00	13,645,500
丸井グループ	112,900	2,221.00	250,750,900
クレディセゾン	91,800	1,279.00	117,412,200
アクシアル リテイリング	11,300	3,230.00	36,499,000
井筒屋	6,800	381.00	2,590,800
イオン	550,400	2,537.00	1,396,364,800
イズミ	26,000	3,095.00	80,470,000
フォーバル	6,500	823.00	5,349,500
平和堂	26,500	1,962.00	51,993,000
フジ	39,200	2,877.00	112,778,400
ヤオコー	16,300	6,430.00	104,809,000
ゼビオホールディングス	19,500	929.00	18,115,500
ケーズホールディングス	131,800	1,224.00	161,323,200
PALTAC	20,000	4,355.00	87,100,000
三谷産業	16,900	340.00	5,746,000
Olympicグループ	7,800	693.00	5,405,400

日産東京販売ホールディングス	22,500	232.00	5,220,000	
新生銀行	93,500	2,158.00	201,773,000	
あおぞら銀行	80,100	2,585.00	207,058,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,982,900	707.40	6,354,503,460	
りそなホールディングス	1,624,800	518.00	841,646,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	270,800	4,118.00	1,115,154,400	
三井住友フィナンシャルグループ	991,400	4,114.00	4,078,619,600	
千葉銀行	477,900	724.00	345,999,600	
群馬銀行	274,600	377.00	103,524,200	
武蔵野銀行	21,300	1,861.00	39,639,300	
千葉興業銀行	34,100	266.00	9,070,600	
筑波銀行	56,200	208.00	11,689,600	
七十七銀行	45,000	1,504.00	67,680,000	
青森銀行	11,200	1,876.00	21,011,200	
秋田銀行	9,300	1,699.00	15,800,700	
山形銀行	16,100	967.00	15,568,700	
岩手銀行	9,300	1,902.00	17,688,600	
東邦銀行	119,900	208.00	24,939,200	
東北銀行	7,500	1,010.00	7,575,000	
みちのく銀行	9,400	879.00	8,262,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	120,500	2,239.00	269,799,500	
静岡銀行	348,900	846.00	295,169,400	
スルガ銀行	125,500	447.00	56,098,500	
八十二銀行	322,000	421.00	135,562,000	
山梨中央銀行	15,800	972.00	15,357,600	
大垣共立銀行	28,400	1,976.00	56,118,400	
福井銀行	12,400	1,458.00	18,079,200	
清水銀行	6,200	1,607.00	9,963,400	
富山銀行	2,200	2,096.00	4,611,200	
滋賀銀行	26,900	2,169.00	58,346,100	
南都銀行	22,500	2,063.00	46,417,500	
百五銀行	138,300	348.00	48,128,400	
京都銀行	51,300	5,150.00	264,195,000	
紀陽銀行	48,600	1,483.00	72,073,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	89,400	910.00	81,354,000	
山陰合同銀行	85,300	663.00	56,553,900	
中国銀行	114,600	886.00	101,535,600	
鳥取銀行	4,200	1,268.00	5,325,600	
伊予銀行	190,000	604.00	114,760,000	
百十四銀行	15,200	1,702.00	25,870,400	
四国銀行	22,000	783.00	17,226,000	
阿波銀行	22,000	2,263.00	49,786,000	
大分銀行	8,500	2,009.00	17,076,500	
宮崎銀行	9,000	2,129.00	19,161,000	
佐賀銀行	8,500	1,496.00	12,716,000	
琉球銀行	31,200	819.00	25,552,800	
セブン銀行	425,100	241.00	102,449,100	
みずほフィナンシャルグループ	1,831,900	1,541.00	2,822,957,900	
高知銀行	4,200	760.00	3,192,000	
山口フィナンシャルグループ	166,600	697.00	116,120,200	

芙蓉総合リース	15,100	7,370.00	111,287,000
みずほリース	22,400	3,055.00	68,432,000
東京センチュリー	27,700	4,995.00	138,361,500
SBIホールディングス	176,700	2,984.00	527,272,800
日本証券金融	56,400	896.00	50,534,400
アイフル	240,100	368.00	88,356,800
日本アジア投資	11,400	174.00	1,983,600
長野銀行	4,900	1,230.00	6,027,000
名古屋銀行	10,700	2,877.00	30,783,900
北洋銀行	216,200	247.00	53,401,400
愛知銀行	5,200	4,770.00	24,804,000
中京銀行	5,200	1,622.00	8,434,400
大光銀行	3,600	1,435.00	5,166,000
愛媛銀行	20,300	938.00	19,041,400
トマト銀行	5,600	1,055.00	5,908,000
京葉銀行	61,800	502.00	31,023,600
栃木銀行	69,700	222.00	15,473,400
北日本銀行	4,700	1,675.00	7,872,500
東和銀行	25,600	573.00	14,668,800
福島銀行	16,600	238.00	3,950,800
大東銀行	7,300	736.00	5,372,800
リコーリース	12,600	3,685.00	46,431,000
イオンフィナンシャルサービス	77,800	1,171.00	91,103,800
アコム	282,500	317.00	89,552,500
ジャックス	15,900	3,195.00	50,800,500
オリエントコーポレーション	386,800	122.00	47,189,600
オリックス	851,500	2,224.50	1,894,161,750
三菱HCキャピタル	529,200	588.00	311,169,600
ジャフコグループ	55,000	1,712.00	94,160,000
九州リースサービス	7,800	591.00	4,609,800
トモニホールディングス	110,900	339.00	37,595,100
大和証券グループ本社	1,072,800	667.10	715,664,880
野村ホールディングス	2,187,200	525.00	1,148,280,000
岡三証券グループ	112,500	385.00	43,312,500
丸三証券	42,400	529.00	22,429,600
東洋証券	46,300	157.00	7,269,100
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	163,700	412.00	67,444,400
光世証券	2,900	474.00	1,374,600
水戸証券	38,200	280.00	10,696,000
いちよし証券	26,900	649.00	17,458,100
松井証券	70,400	805.00	56,672,000
SOMPOホールディングス	235,200	4,884.00	1,148,716,800
日本取引所グループ	362,700	2,174.00	788,509,800
マネックスグループ	116,500	510.00	59,415,000
極東証券	19,200	750.00	14,400,000
岩井コスモホールディングス	13,500	1,391.00	18,778,500
アイザワ証券グループ	23,700	893.00	21,164,100
フィデアホールディングス	13,100	1,378.00	18,051,800
池田泉州ホールディングス	163,800	181.00	29,647,800

アニコム ホールディングス	43,800	710.00	31,098,000	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	321,300	3,813.00	1,225,116,900	
マネーパートナーズグループ	15,200	247.00	3,754,400	
スパークス・グループ	65,800	257.00	16,910,600	
小林洋行	3,100	243.00	753,300	
第一生命ホールディングス	705,000	2,405.50	1,695,877,500	
東京海上ホールディングス	471,800	6,566.00	3,097,838,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,100	599.00	4,252,900	
イー・ギャランティ	21,000	2,042.00	42,882,000	
アサックス	8,400	681.00	5,720,400	
NECキャピタルソリューション	6,200	2,084.00	12,920,800	
T & Dホールディングス	371,700	1,658.00	616,278,600	
アドバンスクリエイト	6,900	993.00	6,851,700	
三井不動産	652,800	2,519.50	1,644,729,600	
三菱地所	941,200	1,745.00	1,642,394,000	
平和不動産	24,600	3,985.00	98,031,000	
東京建物	141,400	1,718.00	242,925,200	
京阪神ビルディング	22,400	1,462.00	32,748,800	
住友不動産	300,600	3,360.00	1,010,016,000	
太平洋興発	5,500	639.00	3,514,500	
テオオーシー	25,900	686.00	17,767,400	
東京楽天地	2,300	3,905.00	8,981,500	
レオパレス21	148,400	201.00	29,828,400	
スターツコーポレーション	19,700	2,490.00	49,053,000	
フジ住宅	17,000	652.00	11,084,000	
空港施設	14,800	553.00	8,184,400	
明和地所	6,900	609.00	4,202,100	
ゴールドクレスト	11,400	1,819.00	20,736,600	
リログループ	76,000	1,719.00	130,644,000	
エスリード	5,600	1,769.00	9,906,400	
日神グループホールディングス	23,300	494.00	11,510,200	
日本エスコン	26,900	748.00	20,121,200	
タカラレーベン	60,200	309.00	18,601,800	
A V A N T I A	7,600	792.00	6,019,200	
イオンモール	71,800	1,579.00	113,372,200	
毎日コムネット	5,400	681.00	3,677,400	
ファースト住建	5,500	1,180.00	6,490,000	
ランド	777,700	10.00	7,777,000	
カチタス	35,400	3,485.00	123,369,000	
東祥	10,500	1,697.00	17,818,500	
トーセイ	19,800	1,076.00	21,304,800	
穴吹興産	3,400	1,969.00	6,694,600	
サンフロンティア不動産	19,800	1,050.00	20,790,000	
FJネクストホールディングス	14,400	989.00	14,241,600	
インテリックス	3,500	636.00	2,226,000	
ランドビジネス	5,900	239.00	1,410,100	
サンネクスタグループ	4,900	1,092.00	5,350,800	
グランディハウス	10,100	575.00	5,807,500	
東武鉄道	141,800	2,819.00	399,734,200	

相鉄ホールディングス	46,400	2,170.00	100,688,000	
東急	366,300	1,520.00	556,776,000	
京浜急行電鉄	186,400	1,204.00	224,425,600	
小田急電鉄	216,100	1,929.00	416,856,900	
京王電鉄	75,400	4,770.00	359,658,000	
京成電鉄	101,300	3,240.00	328,212,000	
富士急行	17,400	3,900.00	67,860,000	
新京成電鉄	3,400	2,040.00	6,936,000	
東日本旅客鉄道	255,700	6,901.00	1,764,585,700	
西日本旅客鉄道	176,200	4,940.00	870,428,000	
東海旅客鉄道	120,600	15,460.00	1,864,476,000	
西武ホールディングス	189,500	1,186.00	224,747,000	
鴻池運輸	23,200	1,185.00	27,492,000	
西日本鉄道	40,200	2,581.00	103,756,200	
ハマキョウレックス	10,500	2,864.00	30,072,000	
サカイ引越センター	6,800	4,330.00	29,444,000	
近鉄グループホールディングス	137,600	3,470.00	477,472,000	
阪急阪神ホールディングス	172,000	3,430.00	589,960,000	
南海電気鉄道	61,500	2,320.00	142,680,000	
京阪ホールディングス	61,300	3,075.00	188,497,500	
神戸電鉄	3,300	3,420.00	11,286,000	
名古屋鉄道	113,100	2,088.00	236,152,800	
山陽電気鉄道	10,800	2,027.00	21,891,600	
アルプス物流	9,800	1,080.00	10,584,000	
トランコム	4,000	7,080.00	28,320,000	
ヤマトホールディングス	192,900	2,217.00	427,659,300	
山九	36,100	3,960.00	142,956,000	
日新	11,200	1,696.00	18,995,200	
丸運	8,200	244.00	2,000,800	
丸全昭和運輸	11,400	3,160.00	36,024,000	
センコーグループホールディングス	69,100	931.00	64,332,100	
トナミホールディングス	3,400	3,695.00	12,563,000	
ニッコンホールディングス	46,300	2,131.00	98,665,300	
日本石油輸送	1,100	2,623.00	2,885,300	
福山通運	22,700	3,965.00	90,005,500	
セイノーホールディングス	93,700	1,189.00	111,409,300	
エスライン	3,100	910.00	2,821,000	
神奈川中央交通	3,400	3,615.00	12,291,000	
日立物流	26,600	5,960.00	158,536,000	
丸和運輸機関	29,100	1,046.00	30,438,600	
C & F ロジホールディングス	14,100	1,230.00	17,343,000	
日本郵船	115,000	10,200.00	1,173,000,000	
商船三井	76,200	9,180.00	699,516,000	
川崎汽船	42,400	7,720.00	327,328,000	
N S ユナイテッド海運	7,600	4,040.00	30,704,000	
明治海運	16,300	825.00	13,447,500	
飯野海運	63,700	862.00	54,909,400	
共栄タンカー	2,500	973.00	2,432,500	
九州旅客鉄道	106,500	2,521.00	268,486,500	
S Gホールディングス	260,100	2,426.00	631,002,600	

NIPPON EXPRESSホールディングス	47,700	6,910.00	329,607,000	
日本航空	315,300	2,242.00	706,902,600	
ANAホールディングス	349,500	2,488.00	869,556,000	
パスコ	2,800	1,345.00	3,766,000	
TREホールディングス	19,100	1,599.00	30,540,900	
人・夢・技術グループ	5,500	1,919.00	10,554,500	
西本Wismettacホールディングス	3,400	3,025.00	10,285,000	
シルバーライフ	2,900	1,158.00	3,358,200	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,999.00	2,398,800	
Genky DrugStores	6,300	3,840.00	24,192,000	
コア商事ホールディングス	10,700	721.00	7,714,700	
国際紙パルプ商事	29,600	336.00	9,945,600	
ナルミヤ・インターナショナル	1,200	994.00	1,192,800	
ブックオフグループホールディングス	8,700	1,049.00	9,126,300	
ギフト	2,300	2,232.00	5,133,600	
三菱倉庫	43,600	2,694.00	117,458,400	
三井倉庫ホールディングス	14,700	2,320.00	34,104,000	
住友倉庫	48,600	2,110.00	102,546,000	
澁澤倉庫	8,400	2,205.00	18,522,000	
ヤマタネ	6,800	1,612.00	10,961,600	
東陽倉庫	22,500	321.00	7,222,500	
乾汽船	9,300	2,288.00	21,278,400	
日本トランスシティ	30,400	599.00	18,209,600	
ケイヒン	2,800	1,380.00	3,864,000	
中央倉庫	8,700	966.00	8,404,200	
川西倉庫	2,900	1,154.00	3,346,600	
安田倉庫	11,900	966.00	11,495,400	
ファイズホールディングス	2,900	656.00	1,902,400	
東洋埠頭	3,100	1,495.00	4,634,500	
上組	75,800	2,189.00	165,926,200	
サンリツ	4,000	815.00	3,260,000	
キムラユニティー	4,000	1,374.00	5,496,000	
キューソー流通システム	7,200	922.00	6,638,400	
近鉄エクスプレス	26,000	2,911.00	75,686,000	
東海運	8,500	304.00	2,584,000	
エーアイティー	8,700	1,368.00	11,901,600	
内外トランスライン	5,400	1,840.00	9,936,000	
ショーエイコーポレーション	4,000	645.00	2,580,000	
日本コンセプト	4,500	1,406.00	6,327,000	
TBSホールディングス	86,600	1,826.00	158,131,600	
日本テレビホールディングス	119,000	1,291.00	153,629,000	
朝日放送グループホールディングス	14,700	730.00	10,731,000	
テレビ朝日ホールディングス	34,300	1,529.00	52,444,700	
スカパーJ S A Tホールディングス	120,500	426.00	51,333,000	
テレビ東京ホールディングス	10,500	2,076.00	21,798,000	
日本BS放送	5,200	1,051.00	5,465,200	
ビジョン	24,300	1,129.00	27,434,700	
スマートバリュー	3,600	435.00	1,566,000	

USEN - NEXT HOLDING S	13,600	2,356.00	32,041,600	
ワイヤレスゲート	5,500	292.00	1,606,000	
コネクシオ	10,300	1,380.00	14,214,000	
日本通信	118,400	177.00	20,956,800	
クロップス	2,900	920.00	2,668,000	
日本電信電話	1,490,800	3,260.00	4,860,008,000	
KDDI	1,039,000	3,691.00	3,834,949,000	
ソフトバンク	2,158,600	1,446.00	3,121,335,600	
光通信	16,400	14,220.00	233,208,000	
エムティーアイ	14,000	457.00	6,398,000	
GMOインターネット	50,500	2,572.00	129,886,000	
ファイバーゲート	4,700	1,283.00	6,030,100	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,500	287.00	1,004,500	
KADOKAWA	77,700	2,753.00	213,908,100	
学研ホールディングス	19,900	1,000.00	19,900,000	
ゼンリン	23,100	1,084.00	25,040,400	
昭文社ホールディングス	4,500	445.00	2,002,500	
インプレスホールディングス	11,500	201.00	2,311,500	
東京電力ホールディングス	1,086,800	354.00	384,727,200	
中部電力	444,300	1,123.00	498,948,900	
関西電力	550,300	1,149.00	632,294,700	
中国電力	227,000	872.00	197,944,000	
北陸電力	133,000	555.00	73,815,000	
東北電力	339,600	731.00	248,247,600	
四国電力	130,900	870.00	113,883,000	
九州電力	299,300	851.00	254,704,300	
北海道電力	126,200	498.00	62,847,600	
沖縄電力	31,000	1,432.00	44,392,000	
電源開発	123,600	1,780.00	220,008,000	
エフオン	8,800	532.00	4,681,600	
イーレックス	21,400	1,775.00	37,985,000	
レノバ	28,300	1,378.00	38,997,400	
東京瓦斯	278,400	2,293.00	638,371,200	
大阪瓦斯	262,900	2,081.00	547,094,900	
東邦瓦斯	66,700	2,911.00	194,163,700	
北海道瓦斯	7,500	1,508.00	11,310,000	
広島ガス	28,800	347.00	9,993,600	
西部ガスホールディングス	16,400	2,236.00	36,670,400	
静岡ガス	37,900	841.00	31,873,900	
メタウォーター	15,100	2,048.00	30,924,800	
アイネット	7,500	1,278.00	9,585,000	
松竹	9,400	11,530.00	108,382,000	
東宝	84,100	4,810.00	404,521,000	
エイチ・アイ・エス	30,900	1,959.00	60,533,100	
東映	4,700	17,330.00	81,451,000	
ラックランド	4,100	2,849.00	11,680,900	
エヌ・ティ・ティ・データ	379,600	2,165.00	821,834,000	
共立メンテナンス	24,700	4,280.00	105,716,000	

イチネンホールディングス	14,400	1,282.00	18,460,800
建設技術研究所	8,400	2,245.00	18,858,000
スペース	10,300	918.00	9,455,400
アインホールディングス	19,100	6,380.00	121,858,000
燦ホールディングス	6,200	1,588.00	9,845,600
ピー・シー・エー	8,500	1,530.00	13,005,000
スバル興業	700	8,010.00	5,607,000
東京テアトル	5,400	1,234.00	6,663,600
タナベ経営	4,800	643.00	3,086,400
ビジネスブレイン太田昭和	5,000	1,568.00	7,840,000
ナガワ	4,500	9,470.00	42,615,000
東京都競馬	10,600	4,055.00	42,983,000
常盤興産	5,400	1,366.00	7,376,400
カナモト	24,500	2,236.00	54,782,000
D T S	27,400	2,738.00	75,021,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	66,300	5,600.00	371,280,000
シーイーシー	15,200	1,108.00	16,841,600
カブコン	134,500	2,782.00	374,179,000
西尾レントオール	12,700	2,832.00	35,966,400
アイ・エス・ビー	6,800	998.00	6,786,400
アゴーラ ホスピタリティグループ	74,300	21.00	1,560,300
日本空港ビルデング	54,700	5,290.00	289,363,000
トランス・コスモス	17,700	3,175.00	56,197,500
乃村工藝社	59,400	896.00	53,222,400
ジャステック	8,500	1,045.00	8,882,500
S C S K	98,800	1,936.00	191,276,800
藤田観光	6,200	2,304.00	14,284,800
K N T - C Tホールディングス	8,600	1,511.00	12,994,600
日本管財	14,900	2,799.00	41,705,100
トーカイ	12,400	1,876.00	23,262,400
白洋舎	1,600	1,165.00	1,864,000
セコム	136,800	8,529.00	1,166,767,200
日本システムウエア	5,400	2,173.00	11,734,200
セントラル警備保障	6,800	2,282.00	15,517,600
アイネス	13,100	1,546.00	20,252,600
丹青社	28,300	723.00	20,460,900
メイテック	16,800	6,870.00	115,416,000
T K C	24,100	3,085.00	74,348,500
富士ソフト	15,200	5,630.00	85,576,000
応用地質	15,800	2,078.00	32,832,400
船井総研ホールディングス	28,400	2,194.00	62,309,600
N S D	45,900	2,144.00	98,409,600
進学会ホールディングス	5,000	351.00	1,755,000
丸紅建材リース	1,100	1,768.00	1,944,800
オオバ	10,100	670.00	6,767,000
コナミホールディングス	51,700	6,620.00	342,254,000
いであ	3,800	1,817.00	6,904,600
学究社	4,700	1,643.00	7,722,100

ベネッセホールディングス	46,300	2,327.00	107,740,100	
イオンディライト	17,100	2,882.00	49,282,200	
ナック	7,300	965.00	7,044,500	
福井コンピュータホールディングス	6,600	3,150.00	20,790,000	
ダイセキ	25,600	4,575.00	117,120,000	
ステップ	5,200	1,849.00	9,614,800	
日鉄物産	10,300	5,300.00	54,590,000	
泉州電業	4,100	6,160.00	25,256,000	
元気寿司	4,100	2,483.00	10,180,300	
トラスコ中山	29,800	2,531.00	75,423,800	
ヤマダホールディングス	522,400	395.00	206,348,000	
オートバックスセブン	48,200	1,416.00	68,251,200	
モリト	10,700	709.00	7,586,300	
アーランドサカモト	22,500	1,539.00	34,627,500	
ニトリホールディングス	56,900	17,055.00	970,429,500	
グルメ杵屋	11,900	1,049.00	12,483,100	
愛眼	8,000	188.00	1,504,000	
ケーユーホールディングス	7,800	1,088.00	8,486,400	
吉野家ホールディングス	50,000	2,325.00	116,250,000	
加藤産業	20,700	3,075.00	63,652,500	
北恵	4,000	943.00	3,772,000	
イノテック	8,600	1,409.00	12,117,400	
イエローハット	24,800	1,605.00	39,804,000	
松屋フーズホールディングス	6,900	3,610.00	24,909,000	
JBCホールディングス	9,700	1,467.00	14,229,900	
JKホールディングス	11,500	1,045.00	12,017,500	
サガミホールディングス	22,000	1,181.00	25,982,000	
日伝	12,000	2,277.00	27,324,000	
関西フードマーケット	10,800	1,113.00	12,020,400	
ミロク情報サービス	12,600	1,509.00	19,013,400	
北沢産業	7,500	229.00	1,717,500	
杉本商事	6,500	2,214.00	14,391,000	
因幡電機産業	38,200	2,617.00	99,969,400	
王将フードサービス	9,400	6,050.00	56,870,000	
プレナス	16,200	1,955.00	31,671,000	
ミニストップ	11,100	1,413.00	15,684,300	
アークス	27,400	2,095.00	57,403,000	
バローホールディングス	31,700	2,163.00	68,567,100	
東テク	4,500	2,412.00	10,854,000	
ミスミグループ本社	179,500	3,690.00	662,355,000	
アルテック	10,100	284.00	2,868,400	
ベルク	6,300	5,290.00	33,327,000	
大庄	7,900	995.00	7,860,500	
タキヒヨー	4,100	1,213.00	4,973,300	
ファーストリテイリング	19,100	61,750.00	1,179,425,000	
ソフトバンクグループ	854,500	5,069.00	4,331,460,500	
蔵王産業	2,200	1,897.00	4,173,400	
スズケン	55,900	3,605.00	201,519,500	
サンドラッグ	53,800	3,105.00	167,049,000	
サクスパー ホールディングス	13,600	510.00	6,936,000	

ジェコス	10,700	813.00	8,699,100	
ヤマザワ	2,900	1,605.00	4,654,500	
やまや	2,900	2,545.00	7,380,500	
グローセル	16,900	432.00	7,300,800	
ペルーナ	30,800	733.00	22,576,400	
合計	159,667,900		372,548,605,270	

(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)

2022年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,655,426,819
コール・ローン	712,160,458
株式	578,920,878,786
投資信託受益証券	1,055,341,518
投資証券	12,632,224,635
派生商品評価勘定	9,792,996
未収入金	2,276,342
未収配当金	795,090,644
差入委託証拠金	4,304,322,185
流動資産合計	608,087,514,383
資産合計	608,087,514,383
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	669,134,440
未払解約金	92,741,000
流動負債合計	761,875,440
負債合計	761,875,440
純資産の部	
元本等	
元本	110,324,823,154
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	497,000,815,789
元本等合計	607,325,638,943
純資産合計	607,325,638,943
負債純資産合計	608,087,514,383

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月26日 至 2022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	2022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	101,336,457,716円
同期中追加設定元本額	93,873,963,738円
同期中一部解約元本額	84,885,598,300円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,316,969,398円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,512,255円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	13,612,045円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	58,879,183円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	19,548,752円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	11,721,611円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,183,927円
たわらノーロード 先進国株式	29,600,479,046円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	384,719,280円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,802,431,857円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	598,593,771円
たわらノーロード バランス(堅実型)	67,491,775円
たわらノーロード バランス(標準型)	559,561,803円
たわらノーロード バランス(積極型)	684,109,163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)	881,601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)	148,165,312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)	441,158,177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)	333,896,117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)	495,118,570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)	1,247,088円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	18,974,947円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,407,249円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,583,135円
たわらノーロード 全世界株式	233,333,374円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,131,983,972円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,234,017,111円
Oneグローバルバランス	2,563,543円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	156,996,113円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	785,786,577円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,007,988,340円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	94,718,081円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	265,893,447円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	249,398,623円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,707,695円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	688,599,498円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	133,496,490円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,284,428円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	172,035,194円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	307,636,538円
投資のソムリエ	2,468,054,457円
クルーズコントロール	36,245,544円
投資のソムリエ<DC年金>	148,814,807円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	186,462,788円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	143,212,873円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	82,175,983円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	564,411,044円
ワールドアセットバランス(基本コース)	203,026,933円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	389,849,781円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	26,770,363円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,968,412円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	680,218円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	39,369,147円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	96,848,190円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	336,734,395円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	160,497,543円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	25,023,763円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,301,608円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,910,600円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	31,242,842円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	662,362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)	126,295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)	83,555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)	1,732,862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)	13,744円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	111,606円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	557,287円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	57,490,733円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	75,883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)	975,536,818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)	63,345,876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)	1,191,657,593円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,189,679,751円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,052,388,165円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	61,175,894円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	8,226,089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)	206,917円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,571,443円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	31,546,987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)	56,354,600円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,722,727円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,177,017円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,568,925円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	489,870円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,793,341円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,245,317円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	203,881,770円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	306,059,524円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	997,459,097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)	84,271,865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)	47,629,463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)	331,441,957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)	13,689,728円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,498,399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)	128,366,149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)	11,208,160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)	40,074,203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)	62,951,756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)	128,461,602円
計	110,324,823,154円
2. 受益権の総数	110,324,823,154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 2021年2月26日 至 2022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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022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	2022年2月25日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	19,043,092,927	
投資信託受益証券	3,458,828	
投資証券	127,049,514	
合計	19,173,601,269	

(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(2022年2月16日から2022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	2022年2月25日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	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	931,320,442	-	931,326,302	5,860	
イギリス・ポンド	696,942,360	-	696,950,803	8,443	
オーストラリア・ドル	37,114,320	-	37,115,304	984	
カナダ・ドル	29,476,776	-	29,476,454	322	
ユーロ	30,852,162	-	30,849,870	2,292	
買建	136,934,824	-	136,933,871	953	
アメリカ・ドル	492,713,394	-	494,468,348	1,754,954	
イギリス・ポンド	372,980,300	-	375,003,882	2,023,582	
オーストラリア・ドル	20,224,360	-	20,104,552	119,808	
カナダ・ドル	6,463,158	-	6,440,296	22,862	
ユーロ	19,655,752	-	19,664,842	9,090	
合計	73,389,824	-	73,254,776	135,048	
合計	1,424,033,836	-	1,425,794,650	1,749,094	

(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ではありません。

株式関連

種類	2022年2月25日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	14,155,272,874	-	13,494,182,336	661,090,538
合計	14,155,272,874	-	13,494,182,336	661,090,538

(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ではありません。

(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)

2022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)	5.5049円 (55,049円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022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	44,406	3,027.160	134,424,066.960	
	ABBOTT LABORATORIES	172,720	118.720	20,505,318.400	
	AES CORP	65,452	20.920	1,369,255.840	
	ABIOMED INC	4,271	306.920	1,310,855.320	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	87,309	121.970	10,649,078.730	
	ADVANCED MICRO DEVICES	165,940	116.610	19,350,263.400	
	ADOBE INC	46,419	463.820	21,530,060.580	
	CHUBB LTD	42,930	199.030	8,544,357.900	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	21,651	235.130	5,090,799.630	
	ALLEGHANY CORP	1,256	662.920	832,627.520	
	ALLSTATE CORP	30,580	120.820	3,694,675.600	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,478	182.340	12,303,938.520	
AMGEN INC	55,291	219.270	12,123,657.570	
HESS CORP	26,932	95.260	2,565,542.320	
AMERICAN EXPRESS CO	65,569	188.350	12,349,921.150	
AMERICAN ELECTRIC POWER	48,416	86.560	4,190,888.960	
AFLAC INC	62,414	59.620	3,721,122.680	
AMERICAN INTL GROUP	83,045	60.380	5,014,257.100	
AMERCO	929	578.450	537,380.050	
ANALOG DEVICES	51,867	159.790	8,287,827.930	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,642	63.810	4,443,856.020	
VALERO ENERGY CORP	42,288	83.840	3,545,425.920	
ANSYS INC	8,394	316.490	2,656,617.060	
APPLE INC	1,610,699	162.740	262,125,155.260	
APPLIED MATERIALS INC	88,106	133.420	11,755,102.520	
ALBEMARLE CORP	11,180	184.200	2,059,356.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,475	75.850	4,131,928.750	
AMEREN CORP	25,436	83.250	2,117,547.000	
ARROW ELECTRONICS INC	6,295	120.710	759,869.450	
AUTODESK INC	21,423	218.180	4,674,070.140	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	41,390	200.220	8,287,105.800	
AUTOZONE INC	2,086	1,794.770	3,743,890.220	
AVERY DENNISON CORP	8,095	174.280	1,410,796.600	
BALL CORP	31,598	87.850	2,775,884.300	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	129,271	308.280	39,851,663.880	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,462	52.500	4,171,755.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	48,418	84.650	4,098,583.700	
BECTON DICKINSON & CO	28,024	266.290	7,462,510.960	
AMETEK INC	22,636	127.610	2,888,579.960	
VERIZON COMM INC	404,808	52.590	21,288,852.720	
WR BERKLEY CORP	12,804	87.650	1,122,270.600	
BEST BUY CO INC	21,238	91.580	1,944,976.040	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,324	598.430	1,390,751.320	
YUM! BRANDS INC	28,666	121.360	3,478,905.760	
FIRSTENERGY CORP	51,827	39.850	2,065,305.950	
BOEING CO	54,208	198.430	10,756,493.440	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	116.880	1,313,497.440	
BORGWARNER INC	20,923	41.100	859,935.300	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	138,796	43.950	6,100,084.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,382	96.200	1,191,148.400	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,792	163.380	1,763,196.960	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,229	1,412.370	3,148,172.730	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	215,751	67.100	14,476,892.100	
ONEOK INC	42,020	61.530	2,585,490.600	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	130.620	972,335.280	
UNITED RENTALS INC	6,935	308.320	2,138,199.200	
SEMPRA ENERGY	31,048	134.230	4,167,573.040	
FEDEX CORP	24,748	215.920	5,343,588.160	
VERISIGN INC	10,340	209.820	2,169,538.800	
AMPHENOL CORP	58,123	75.110	4,365,618.530	
BROWN-FORMAN CORP	29,733	64.580	1,920,157.140	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.060	588,644.160	
CSX CORP	220,361	33.600	7,404,129.600	
COTERRA ENERGY INC	78,516	22.240	1,746,195.840	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	43.540	885,342.360	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,421	215.010	3,530,679.210	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	52.480	1,522,182.400	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	76,302	20.630	1,574,110.260	
CATERPILLAR INC	53,289	184.690	9,841,945.410	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,258	138.210	1,417,758.180	
CITRIX SYSTEMS INC	11,530	102.210	1,178,481.300	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	9.730	896,989.240	
CERNER CORP	28,528	93.110	2,656,242.080	
JPMORGAN CHASE & CO	291,379	144.550	42,118,834.450	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,563	95.060	2,334,958.780	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,465	119.420	1,727,410.300	
CINTAS CORP	8,931	374.020	3,340,372.620	
CISCO SYSTEMS INC	410,704	54.730	22,477,829.920	
CLOROX COMPANY	11,455	143.240	1,640,814.200	
COCA-COLA CO/THE	400,562	60.510	24,238,006.620	
COPART INC	20,322	121.600	2,471,155.200	
COGNEX CORP	16,262	66.250	1,077,357.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	78,414	75.580	5,926,530.120	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	26,514	168.750	4,474,237.500	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,504	307.530	1,692,645.120	
NRG ENERGY, INC.	22,763	38.180	869,091.340	
COMCAST CORP-CL A	446,029	46.010	20,521,794.290	
CONAGRA BRANDS INC	45,472	34.310	1,560,144.320	
CONSOLIDATED EDISON INC	34,089	83.310	2,839,954.590	
CMS ENERGY CORP	27,238	61.970	1,687,938.860	
COOPER COS INC	4,732	399.660	1,891,191.120	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,984	49.420	839,349.280	
CORNING INC	83,866	40.510	3,397,411.660	
SEALED AIR CORP	13,382	66.760	893,382.320	

HEICO CORP-CL A	7,477	115.840	866,135.680	
CUMMINS INC	13,926	203.270	2,830,738.020	
DR HORTON INC	32,787	82.310	2,698,697.970	
DANAHER CORP	62,565	271.560	16,990,151.400	
MOODY'S CORP	16,335	322.000	5,259,870.000	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	51,262	86.080	4,412,632.960	
TARGET CORP	47,494	191.550	9,097,475.700	
DEERE & CO	28,689	342.760	9,833,441.640	
MORGAN STANLEY	133,094	91.810	12,219,360.140	
REPUBLIC SERVICES INC	21,552	117.470	2,531,713.440	
COSTAR GROUP INC	41,201	60.600	2,496,780.600	
THE WALT DISNEY CO	176,779	149.400	26,410,782.600	
DOLLAR TREE INC	23,167	136.130	3,153,723.710	
DOVER CORP	14,172	155.360	2,201,761.920	
OMNICOM GROUP	20,313	82.130	1,668,306.690	
DTE ENERGY CO	18,419	117.740	2,168,653.060	
DUKE ENERGY CORP	75,303	97.040	7,307,403.120	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,337	141.570	1,888,119.090	
EBAY INC	62,816	55.440	3,482,519.040	
BANK OF AMERICA CORP	738,433	43.600	32,195,678.800	
CITIGROUP INC	197,943	60.670	12,009,201.810	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,326	117.770	1,569,403.020	
EATON CORP PLC	39,025	150.310	5,865,847.750	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,813	149.040	3,996,209.520	
DISH NETWORK CORP	22,645	29.460	667,121.700	
ECOLAB INC	25,297	175.940	4,450,754.180	
PERKINELMER INC	11,835	177.980	2,106,393.300	
ELECTRONIC ARTS INC	27,561	127.500	3,514,027.500	
SALESFORCE.COM INC	95,348	204.290	19,478,642.920	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	180.910	405,781.130	
EMERSON ELECTRIC CO	58,388	90.000	5,254,920.000	
ATMOS ENERGY CORP	12,429	104.750	1,301,937.750	
ENTERGY CORP	18,813	102.320	1,924,946.160	
EOG RESOURCES INC	56,751	110.100	6,248,285.100	
EQUIFAX INC	11,663	215.920	2,518,274.960	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	22,664	293.130	6,643,498.320	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	16,366	105.030	1,718,920.980	
EXXON MOBIL CORP	412,707	75.800	31,283,190.600	
FMC CORP	12,183	114.900	1,399,826.700	
NEXTERA ENERGY INC	191,183	75.440	14,422,845.520	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,874	392.820	1,521,784.680	
FAIR ISAAC CORP	2,810	472.450	1,327,584.500	
ASSURANT INC	5,523	163.500	903,010.500	
FASTENAL CO	54,913	50.460	2,770,909.980	
FIFTH THIRD BANCORP	66,681	45.760	3,051,322.560	
M&T BANK CORP	12,175	174.470	2,124,172.250	
FISERV INC	57,652	95.560	5,509,225.120	

FORD MOTOR CO	380,563	17.150	6,526,655.450	
FRANKLIN RESOURCES INC	27,605	28.960	799,440.800	
FREEPORT-MCMORAN INC	142,579	43.720	6,233,553.880	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,192	743.300	886,013.600	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,001	154.420	3,088,554.420	
DENTSPLY SIRONA INC	20,222	56.280	1,138,094.160	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,198	218.530	5,069,458.940	
GENERAL MILLS INC	58,818	65.560	3,856,108.080	
GENUINE PARTS CO	13,611	120.860	1,645,025.460	
GILEAD SCIENCES INC	121,849	60.610	7,385,267.890	
GARTNER INC	8,855	281.390	2,491,708.450	
MCKESSON CORP	15,001	266.600	3,999,266.600	
NVIDIA CORP	243,372	237.480	57,795,982.560	
GENERAL ELECTRIC CO	107,026	92.540	9,904,186.040	
VW GRAINGER INC	4,148	466.280	1,934,129.440	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,923	55.220	1,707,568.060	
HALLIBURTON CO	83,843	31.470	2,638,539.210	
MONSTER BEVERAGE CORP	38,622	80.350	3,103,277.700	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,990	340.190	11,222,868.100	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,375	228.470	4,426,606.250	
HASBRO INC	12,184	93.180	1,135,305.120	
HENRY SCHEIN INC	14,358	83.980	1,205,784.840	
HEICO CORP	3,596	141.190	507,719.240	
HERSHEY FOODS CORP	15,245	196.810	3,000,368.450	
HP INC	116,273	34.530	4,014,906.690	
F5 INC	5,557	198.430	1,102,675.510	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,336	117.990	1,455,524.640	
JUNIPER NETWORKS INC	35,290	33.670	1,188,214.300	
HOLOGIC INC	24,310	71.110	1,728,684.100	
HOME DEPOT INC	102,830	313.240	32,210,469.200	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,815	77.350	1,532,690.250	
HORMEL FOODS CORP	29,021	47.030	1,364,857.630	
CENTERPOINT ENERGY INC	61,105	26.550	1,622,337.750	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	255.820	875,160.220	
HUMANA INC	12,574	421.300	5,297,426.200	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,752	188.910	1,653,340.320	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	141,920	14.960	2,123,123.200	
BIOGEN INC	14,344	203.120	2,913,553.280	
IDEX CORP	7,332	188.990	1,385,674.680	
ILLINOIS TOOL WORKS	30,786	214.140	6,592,514.040	
INTUIT INC	26,620	497.130	13,233,600.600	
IDEXX LABORATORIES INC	8,225	509.770	4,192,858.250	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,051	151.230	3,486,002.730	

INTEL CORP	394,783	46.720	18,444,261.760	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	23,991	135.680	3,255,098.880	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,388	44.190	1,519,605.720	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,948	36.180	1,336,778.640	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	13,148	119.410	1,570,002.680	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,748	170.070	1,317,702.360	
INCYTE CORP	17,958	67.840	1,218,270.720	
JOHNSON & JOHNSON	256,927	158.140	40,630,435.780	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	32,800	67.480	2,213,344.000	
KLA CORPORATION	14,787	357.890	5,292,119.430	
DEVON ENERGY CORP	62,462	52.750	3,294,870.500	
KELLOGG CO	26,578	63.790	1,695,410.620	
KEYCORP	91,612	24.130	2,210,597.560	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,670	128.570	4,200,381.900	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,789	731.790	10,822,442.310	
KROGER CO	68,481	44.440	3,043,295.640	
LAM RESEARCH CORP	13,876	562.880	7,810,522.880	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,417	418.080	1,846,659.360	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,555	145.990	1,540,924.450	
AKAMA I TECHNOLOGIES	15,264	103.940	1,586,540.160	
PLUG POWER INC	52,624	21.870	1,150,886.880	
LENNAR CORP	26,483	87.740	2,323,618.420	
ELI LILLY & CO	79,198	243.080	19,251,449.840	
BATH & BODY WORKS INC	26,967	53.140	1,433,026.380	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,002	66.180	1,125,192.360	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	70,953	207.190	14,700,752.070	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,204	128.150	3,742,492.600	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,424	395.710	9,664,821.040	
LOEWS CORP	22,394	59.000	1,321,246.000	
LOWE'S COS INC	67,434	213.410	14,391,089.940	
DOMINION ENERGY INC	78,703	77.160	6,072,723.480	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,700	43.510	1,683,837.000	
MCCORMICK & CO INC	24,905	94.120	2,344,058.600	
MCDONALD'S CORPORATION	72,778	245.030	17,832,793.340	
S&P GLOBAL INC	23,363	381.680	8,917,189.840	
EVEREST RE GROUP LTD	4,282	291.500	1,248,203.000	
MARKEL CORPORATION	1,447	1,212.630	1,754,675.610	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	60,591	109.640	6,643,197.240	
MARSH & MCLENNAN COS	49,558	151.780	7,521,913.240	

MASCO CORP	23,233	55.350	1,285,946.550	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,893	369.070	2,174,929.510	
METLIFE INC	71,443	66.220	4,730,955.460	
MEDTRONIC PLC	131,385	103.330	13,576,012.050	
ACTIVISION BLIZZARD INC	75,657	81.010	6,128,973.570	
CVS HEALTH CORP	128,735	100.770	12,972,625.950	
MERCK & CO. INC.	246,591	73.510	18,126,904.410	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	41,360	61.080	2,526,268.800	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,282	271.710	2,522,012.220	
MICROSOFT CORP	695,786	294.590	204,971,597.740	
MICRON TECH INC	109,085	88.830	9,690,020.550	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	53,322	71.260	3,799,725.720	
3M CO	56,666	143.700	8,142,904.200	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	139.210	830,109.230	
ENTEGRIS INC	13,639	132.190	1,802,939.410	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,458	290.030	1,582,983.740	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,301	217.300	3,542,207.300	
ILLUMINA INC	14,246	323.910	4,614,421.860	
XCEL ENERGY INC	51,615	64.830	3,346,200.450	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	87.130	846,293.690	
NETAPP INC	21,220	79.290	1,682,533.800	
NEWELL BRANDS INC	40,489	23.880	966,877.320	
NEWMONT CORP	77,443	66.720	5,166,996.960	
NOVAVAX INC	7,886	79.950	630,485.700	
NVR INC	338	4,775.440	1,614,098.720	
NIKE INC-CL B	124,517	137.170	17,079,996.890	
NORDSON CORP	4,787	221.660	1,061,086.420	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,235	254.040	6,156,659.400	
EVERSOURCE ENERGY	32,872	79.720	2,620,555.840	
NISOURCE INC	42,035	28.330	1,190,851.550	
NORTHERN TRUST CORP	20,011	112.960	2,260,442.560	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,860	395.490	5,876,981.400	
WELLS FARGO & CO	400,170	52.710	21,092,960.700	
NUCOR CORP	28,285	120.900	3,419,656.500	
CHENIERE ENERGY INC	23,120	128.000	2,959,360.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,060	147.770	6,362,976.200	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	90,266	38.920	3,513,152.720	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,578	294.650	2,822,157.700	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,672	637.160	4,251,131.520	
ORACLE CORP	163,221	74.810	12,210,563.010	
PACCAR INC	35,938	91.950	3,304,499.100	

PTC INC	11,092	109.850	1,218,456.200	
EXELON CORP	95,645	41.300	3,950,138.500	
PARKER HANNIFIN CORP	12,593	289.190	3,641,769.670	
PAYCHEX INC	31,387	115.790	3,634,300.730	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,303	509.150	3,718,322.450	
PPL CORPORATION	73,482	25.940	1,906,123.080	
PEPSICO INC	134,924	163.790	22,099,201.960	
PENTAIR PLC	16,339	57.510	939,655.890	
PFIZER INC	546,072	45.960	25,097,469.120	
ESSENTIAL UTILITIES INC	21,543	46.650	1,004,980.950	
CONOCOPHILLIPS	130,612	87.730	11,458,590.760	
PG&E CORP	152,496	11.080	1,689,655.680	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22,238	225.900	5,023,564.200	
ALTRIA GROUP INC	179,613	49.570	8,903,416.410	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,517	195.610	8,121,140.370	
BROWN & BROWN INC	21,793	66.150	1,441,606.950	
GARMIN LTD	14,529	110.410	1,604,146.890	
PPG INDUSTRIES INC	23,064	137.710	3,176,143.440	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	133.620	448,027.860	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,990	505.580	21,734,884.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	21,851	142.740	3,119,011.740	
QUEST DIAGNOSTICS	12,493	129.510	1,617,968.430	
PROCTER & GAMBLE CO	236,930	151.760	35,956,496.800	
PROGRESSIVE CORP	56,936	102.880	5,857,575.680	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,059	62.320	3,057,356.880	
PULTE GROUP INC	23,814	46.620	1,110,208.680	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,331	135.470	3,838,000.570	
QUALCOMM INC	109,616	167.980	18,413,295.680	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,729	107.170	2,114,356.930	
EXACT SCIENCES CORP	17,982	75.560	1,358,719.920	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,193	609.780	6,215,487.540	
RESMED INC	14,092	237.780	3,350,795.760	
US BANCORP	137,988	55.330	7,634,876.040	
SEAGEN INC	12,863	126.270	1,624,211.010	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,032	45.930	1,700,879.760	
ROSS STORES INC	34,298	90.640	3,108,770.720	
ROLLINS INC	19,156	31.600	605,329.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,318	444.060	4,581,811.080	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,167	266.060	2,971,092.020	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,292	81.380	1,732,742.960	
RPM INTERNATIONAL INC	12,897	82.390	1,062,583.830	
ACCENTURE PLC-CL A	61,855	316.170	19,556,695.350	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	136,494	64.650	8,824,337.100	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,453	219.810	2,737,293.930	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	24,152	166.500	4,021,308.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	59,927	95.780	5,739,808.060	
BOOKING HOLDINGS INC	3,984	2,295.000	9,143,280.000	
SCHLUMBERGER LTD	136,554	38.320	5,232,749.280	
SCHWAB (CHARLES) CORP	140,674	82.270	11,573,249.980	
POOL CORP	4,336	436.070	1,890,799.520	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	20,070	123.480	2,478,243.600	
BUNGE LTD	13,581	101.910	1,384,039.710	
SEI INVESTMENTS CO	10,294	57.220	589,022.680	
ANTHEM INC	23,809	441.810	10,519,054.290	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,922	137.860	2,057,146.920	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,742	68.500	1,763,327.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,375	258.940	6,311,662.500	
CENTENE CORP	56,386	80.840	4,558,244.240	
SVB FINANCIAL GROUP	5,617	584.270	3,281,844.590	
SMITH (A.O.) CORP	14,037	67.770	951,287.490	
SNAP-ON INC	5,783	204.950	1,185,225.850	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,564	108.950	4,092,597.800	
ADVANCE AUTO PARTS	5,694	200.810	1,143,412.140	
EDISON INTERNATIONAL	36,240	59.160	2,143,958.400	
SOUTHERN CO	103,527	62.880	6,509,777.760	
TRUIST FINANCIAL CORP	129,144	59.210	7,646,616.240	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	44.340	586,174.800	
AT&T INC	696,038	23.230	16,168,962.740	
CHEVRON CORP	188,645	134.850	25,438,778.250	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,385	156.340	2,405,290.900	
STATE STREET CORP	35,158	85.480	3,005,305.840	
STARBUCKS CORP	114,457	91.010	10,416,731.570	
STEEL DYNAMICS INC	21,929	63.260	1,387,228.540	
STRYKER CORP	33,130	257.700	8,537,601.000	
NETFLIX INC	43,024	390.030	16,780,650.720	
NORTONLIFELOCK INC	55,231	27.260	1,505,597.060	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	52.520	834,385.240	
SYNOPSIS INC	14,752	307.800	4,540,665.600	
SYSCO CORP	49,662	84.960	4,219,283.520	
INTUITIVE SURGICAL INC	34,696	288.380	10,005,632.480	
TELEFLEX INC	4,466	338.060	1,509,775.960	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	7.930	838,653.010	

TERADYNE INC	15,454	117.390	1,814,145.060	
TEXAS INSTRUMENTS INC	89,592	169.590	15,193,907.280	
TEXTRON INC	20,683	69.500	1,437,468.500	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,278	540.170	20,676,627.260	
GLOBE LIFE INC	9,168	100.100	917,716.800	
DAVITA INC	6,497	111.890	726,949.330	
TRACTOR SUPPLY CO	10,961	195.380	2,141,560.180	
BIO-TECHNE CORP	4,220	412.900	1,742,438.000	
TRIMBLE INC	26,037	67.570	1,759,320.090	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,935	425.290	1,673,516.150	
TYSON FOODS INC	27,788	90.330	2,510,090.040	
UGI CORP	18,469	37.350	689,817.150	
UNION PACIFIC CORP	63,738	242.090	15,430,332.420	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	147,236	94.250	13,876,993.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,002	455.890	41,942,791.780	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	136.390	1,055,249.430	
VF CORP	35,687	57.640	2,056,998.680	
PARAMOUNT GLOBAL	57,034	29.050	1,656,837.700	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,092	230.250	5,777,433.000	
VULCAN MATERIALS CO	12,676	177.150	2,245,553.400	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70,444	45.270	3,188,999.880	
WALMART INC	150,263	134.530	20,214,881.390	
WASTE MANAGEMENT INC	40,653	141.910	5,769,067.230	
WATERS CORP	5,750	312.440	1,796,530.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	20,418	56.580	1,155,250.440	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,103	378.380	2,687,633.140	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,944	133.770	1,330,208.880	
VAIL RESORTS INC	4,180	262.480	1,097,166.400	
WESTERN DIGITAL CORP	29,301	51.830	1,518,670.830	
WABTEC CORP	17,097	92.980	1,589,679.060	
WHIRLPOOL CORP	5,737	198.180	1,136,958.660	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,924	138.830	2,210,728.920	
WYNN RESORTS LTD	12,004	86.480	1,038,105.920	
NASDAQ INC	11,034	170.190	1,877,876.460	
CME GROUP INC	34,892	237.260	8,278,475.920	
WILLIAMS COS INC	116,301	29.960	3,484,377.960	
LKQ CORP	28,785	45.930	1,322,095.050	
ALLIANT ENERGY CORP	23,872	55.930	1,335,160.960	
WEC ENERGY GROUP INC	30,523	88.680	2,706,779.640	
CARMAX INC	15,287	105.150	1,607,428.050	
TJX COMPANIES INC	116,823	64.690	7,557,279.870	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,609	415.330	2,329,585.970	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	5.570	605,459.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,400	58.460	1,192,584.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,882	152.890	1,663,748.980	
SIGNATURE BANK	5,610	325.700	1,827,177.000	
CBRE GROUP INC	32,338	93.840	3,034,597.920	
LIBERTY GLOBAL PLC	14,597	26.020	379,813.940	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,423	23.080	2,248,522.840	
DOMINO'S PIZZA INC	3,808	417.410	1,589,497.280	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,044	455.140	1,840,586.160	
T-MOBILE US INC	60,701	123.660	7,506,285.660	
LAS VEGAS SANDS CORP	36,769	43.580	1,602,393.020	
MOSAIC CO/THE	38,515	45.350	1,746,655.250	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,959	377.000	1,492,543.000	
CELANESE CORP	10,917	137.210	1,497,921.570	
DEXCOM INC	9,350	408.720	3,821,532.000	
DISCOVERY INC-A	13,068	27.730	362,375.640	
EXPEDIA GROUP INC	13,645	193.740	2,643,582.300	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,205	78.560	1,587,304.800	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,896	289.360	3,152,866.560	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	26.020	885,278.460	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	55,166	127.920	7,056,834.720	
LIVE NATION	15,312	124.390	1,904,659.680	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,713	1,484.610	4,027,746.930	
TRANSDIGM GROUP INC	5,093	649.180	3,306,273.740	
MASTERCARD INC	85,846	369.380	31,709,795.480	
WESTERN UNION CO	44,868	18.620	835,442.160	
OWENS CORNING	9,740	90.640	882,833.600	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,303	95.480	1,174,690.440	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	10.100	175,235.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11,780	145.290	1,711,516.200	
DELTA AIR LINES INC	14,723	40.330	593,778.590	
INSULET CORP	6,481	255.370	1,655,052.970	
DISCOVER FINANCIAL	28,645	118.270	3,387,844.150	
TE CONNECTIVITY LTD	31,846	141.440	4,504,298.240	
MASIMO CORP	5,404	154.010	832,270.040	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,458	310.360	3,556,104.880	
VMWARE INC	21,320	118.120	2,518,318.400	
MERCADOLIBRE INC	4,313	1,033.590	4,457,873.670	
ULTA BEAUTY INC	5,274	373.090	1,967,676.660	

INVESCO LTD	36,904	21.020	775,722.080	
MSCI INC	7,974	508.470	4,054,539.780	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	152,060	102.790	15,630,247.400	
VISA INC	164,441	217.300	35,733,029.300	
KEURIG DR PEPPER INC	70,952	36.650	2,600,390.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,337	148.600	2,576,278.200	
DISCOVERY INC-C	30,388	27.670	840,835.960	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,896	74.460	4,608,776.160	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,787	85.050	1,087,534.350	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	196,057	16.670	3,268,270.190	
XYLEM INC	17,083	87.700	1,498,179.100	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	26,191	94.460	2,474,001.860	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,482	191.990	668,509.180	
SPLUNK INC	15,699	121.340	1,904,916.660	
EPAM SYSTEMS INC	5,399	382.280	2,063,929.720	
ZILLOW GROUP INC	7,658	57.520	440,488.160	
HCA HEALTHCARE INC	25,049	243.560	6,100,934.440	
VERISK ANALYTICS INC	14,624	179.220	2,620,913.280	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	134.610	828,120.720	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,399	235.580	1,743,056.420	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,947	166.090	2,814,727.230	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,851	191.420	4,948,398.420	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	75.140	1,028,441.180	
LEAR CORP	5,216	162.400	847,078.400	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	117.270	1,234,501.290	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	21,554	74.090	1,596,935.860	
DOLLAR GENERAL CORP	22,566	190.800	4,305,592.800	
FORTINET INC	13,408	316.450	4,242,961.600	
HORIZON PHARMA PLC	20,415	92.820	1,894,920.300	
TESLA INC	81,966	800.770	65,635,913.820	
GENERAC HOLDINGS INC	5,993	301.350	1,805,990.550	
ENPHASE ENERGY INC	12,217	147.350	1,800,174.950	
GENERAL MOTORS CO	126,727	46.350	5,873,796.450	
ALLY FINANCIAL INC	37,466	48.280	1,808,858.480	
APTIV PLC	26,018	134.220	3,492,135.960	
PHILLIPS 66	42,428	83.480	3,541,889.440	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	8,628	88.060	759,781.680	
META PLATFORMS INC	232,143	207.600	48,192,886.800	
IQVIA HOLDINGS INC	18,572	228.470	4,243,144.840	

DIAMONDBACK ENERGY INC	15,727	127.890	2,011,326.030	
SERVICENOW INC	19,263	573.950	11,055,998.850	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,441	539.940	5,097,573.540	
WORKDAY INC	18,602	222.360	4,136,340.720	
ABBVIE INC	172,156	145.270	25,009,102.120	
ZOETIS INC	46,053	190.950	8,793,820.350	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	21.570	827,684.040	
CDW CORP	12,943	171.300	2,217,135.900	
HOWMET AEROSPACE INC	40,434	34.380	1,390,120.920	
TWILIO INC	15,835	165.020	2,613,091.700	
COUPA SOFTWARE INC	7,732	114.940	888,716.080	
SNAP INC	102,774	38.830	3,990,714.420	
TRADE DESK INC A	41,852	82.820	3,466,182.640	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,157	62.810	1,391,681.170	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	50.220	418,031.280	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,346	50.240	720,743.040	
OKTA INC	11,692	173.560	2,029,263.520	
BLACK KNIGHT INC	16,775	55.380	928,999.500	
BAKER HUGHES CO	77,909	28.720	2,237,546.480	
BROADCOM INC	39,894	580.000	23,138,520.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,305	130.320	951,987.600	
MONGODB INC	6,101	375.360	2,290,071.360	
BURLINGTON STORES INC	6,861	218.370	1,498,236.570	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	27.890	1,128,122.610	
VEEVA SYSTEMS INC	13,296	224.150	2,980,298.400	
TWITTER INC	82,981	34.980	2,902,675.380	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	57.410	917,698.850	
EVERGY INC	22,398	60.590	1,357,094.820	
ALLEGION PLC	8,924	111.700	996,810.800	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	70.830	946,288.800	
STERIS PLC	9,649	229.210	2,211,647.290	
DOCUSIGN INC	18,520	113.560	2,103,131.200	
WIX.COM LTD	5,567	88.190	490,953.730	
DROPBOX INC	28,170	21.340	601,147.800	
KKR & CO INC	50,337	58.760	2,957,802.120	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	40.780	194,031.240	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	20,900	126.970	2,653,673.000	
MODERNA INC	33,413	156.230	5,220,112.990	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,616	146.090	3,888,331.440	
ARAMARK	21,387	36.680	784,475.160	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	57,124	17.680	1,009,952.320	
CIGNA CORP	33,111	224.430	7,431,101.730	
DELL TECHNOLOGIES INC	27,783	55.840	1,551,402.720	
DOW INC	72,256	58.720	4,242,872.320	

AMCOR PLC	161,822	11.480	1,857,716.560	
PINTEREST INC	52,177	25.340	1,322,165.180	
PELTON INTERACTIVE INC	25,418	28.300	719,329.400	
FOX CORP-A	34,681	40.870	1,417,412.470	
FOX CORP-B	15,080	37.260	561,880.800	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	40,846	15.820	646,183.720	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	18,231	182.880	3,334,085.280	
CHEWY INC	9,068	40.590	368,070.120	
AVANTOR INC	48,639	34.420	1,674,154.380	
LYFT INC	24,589	38.770	953,315.530	
DYNATRACE INC	19,417	43.050	835,901.850	
CLOUDFLARE INC	22,554	108.380	2,444,402.520	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	80.990	800,667.140	
CARRIER GLOBAL CORP	79,871	44.710	3,571,032.410	
OTIS WORLDWIDE CORP	42,226	76.590	3,234,089.340	
INMODE LTD	5,511	41.050	226,226.550	
UBER TECHNOLOGIES INC	119,109	34.870	4,153,330.830	
CORTEVA INC	71,705	50.050	3,588,835.250	
MATCH GROUP INC	25,322	113.040	2,862,398.880	
BILL.COM HOLDINGS INC	7,830	227.290	1,779,680.700	
BLACKSTONE INC	66,578	121.280	8,074,579.840	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	3,202	73.850	236,467.700	
CARLYLE GROUP INC	17,020	45.340	771,686.800	
10X GENOMICS INC	7,667	77.240	592,199.080	
DATADOG INC	18,367	159.860	2,936,148.620	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	20,924	103.160	2,158,519.840	
UPSTART HOLDINGS INC	2,080	131.550	273,624.000	
INGERSOLL RAND INC	40,529	50.330	2,039,824.570	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,250	324.500	1,703,625.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	17,712	63.710	1,128,431.520	
ASANA INC	7,134	54.350	387,732.900	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	103.180	553,767.060	
AON PLC	22,029	288.130	6,347,215.770	
SOFI TECHNOLOGIES INC	54,734	10.330	565,402.220	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	38.120	609,996.240	
COINBASE GLOBAL INC	3,976	179.560	713,930.560	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,204	38.710	356,286.840	
IAC/INTERACTIVECORP	7,250	110.050	797,862.500	
AIRBNB INC	22,711	158.260	3,594,242.860	
ZENDESK INC	11,915	115.060	1,370,939.900	
CONSTELLATION ENERGY CORP	31,881	44.320	1,412,965.920	
ROYALTY PHARMA PLC	35,564	37.880	1,347,164.320	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	23,577	54.580	1,286,832.660	
VIATRIS INC	124,858	13.930	1,739,271.940	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,814	84.650	1,846,555.100	

DRAFTKINGS INC	33,459	21.830	730,409.970	
SNOWFLAKE INC	20,394	269.870	5,503,728.780	
DOORDASH INC	10,922	100.420	1,096,787.240	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	15.000	137,160.000	
ARISTA NETWORKS INC	21,859	120.860	2,641,878.740	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	37,177	62.160	2,310,922.320	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	153,271	11.830	1,813,195.930	
IHS MARKIT LTD	36,714	107.810	3,958,136.340	
FNF GROUP	25,451	45.380	1,154,966.380	
MARVELL TECHNOLOGY INC	79,417	67.790	5,383,678.430	
ROBINHOOD MARKETS INC	19,872	11.510	228,726.720	
LUCID GROUP INC	42,136	25.280	1,065,198.080	
CATALENT INC	17,439	99.080	1,727,856.120	
SYNCHRONY FINANCIAL	59,985	41.240	2,473,781.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	43,554	50.480	2,198,605.920	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	154.490	534,071.930	
WAYFAIR INC	6,959	127.070	884,280.130	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,412	158.500	2,759,802.000	
HUBSPOT INC	4,307	525.000	2,261,175.000	
QORVO INC	11,107	136.900	1,520,548.300	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	141.460	343,040.500	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,520	143.880	2,089,137.600	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,959	271.190	1,344,831.210	
GODADDY INC	16,574	82.920	1,374,316.080	
KORNIT DIGITAL LTD	4,978	90.010	448,069.780	
ETSY INC	11,713	128.160	1,501,138.080	
TRANSUNION	18,990	88.090	1,672,829.100	
BLOCK INC	48,939	94.990	4,648,715.610	
DUPONT DE NEMOURS INC	50,680	75.570	3,829,887.600	
CARVANA CO	7,735	126.050	974,996.750	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	21,537	51.600	1,111,309.200	
TELADOC HEALTH INC	14,790	68.940	1,019,622.600	
WESTROCK CO	26,297	44.510	1,170,479.470	
KRAFT HEINZ CO	64,001	38.980	2,494,758.980	
NOVOCURE LTD	9,772	77.890	761,141.080	
FORTIVE CORP	32,964	64.370	2,121,892.680	
WASTE CONNECTIONS INC	26,186	121.540	3,182,646.440	
ALPHABET INC-CL A	29,314	2,653.820	77,794,079.480	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	123,101	16.250	2,000,391.250	
PAYPAL HOLDINGS INC	108,655	105.020	11,410,948.100	

	SEA LTD ADR	13,232	122.750	1,624,228.000	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	34,346	31.910	1,095,980.860	
	SUNRUN INC	16,213	24.380	395,272.940	
	ZILLOW GROUP INC-C	15,665	57.710	904,027.150	
	ALPHABET INC-CL C	28,094	2,653.470	74,546,586.180	
	ZSCALER INC	7,759	263.380	2,043,565.420	
	CABLE ONE INC	542	1,421.600	770,507.200	
	LINDE PLC	50,398	285.250	14,376,029.500	
	ROKU INC	11,901	135.100	1,607,825.100	
	AVALARA INC	7,824	101.110	791,084.640	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,476	586.590	7,318,296.840	
	VISTRA CORP	39,758	21.680	861,953.440	
アメリカ・ドル	小計	30,927,986		3,667,315,748.660 (423,831,681,075)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	13.705	483,252.000	
	ASHTAD GROUP	43,003	46.000	1,978,138.000	
	SEVERN TRENT PLC	29,458	27.200	801,257.600	
	BARCLAYS PLC	1,651,219	1.794	2,962,286.880	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	92,235	5.580	514,671.300	
	BT GROUP PLC	850,262	1.878	1,596,792.030	
	BUNZL PLC	35,508	27.150	964,042.200	
	AVIVA PLC	381,543	4.083	1,557,840.060	
	CRODA INTERNATIONAL	13,693	70.940	971,381.420	
	DIAGEO PLC	227,784	35.250	8,029,386.000	
	SCHRODERS PLC	11,354	29.620	336,305.480	
	DCC PLC	10,684	56.920	608,133.280	
	NATIONAL GRID PLC	352,237	10.526	3,707,646.660	
	KINGFISHER PLC	211,460	2.940	621,692.400	
	BAE SYSTEMS PLC	309,699	6.318	1,956,678.280	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	212,707	32.295	6,869,372.560	
	HALMA PLC	34,201	22.550	771,232.550	
	NEXT PLC	13,197	67.520	891,061.440	
	IMPERIAL BRANDS PLC	89,652	16.215	1,453,707.180	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	17.210	328,831.470	
	ANGLO AMERICAN PLC	125,520	35.950	4,512,444.000	
	COMPASS GROUP PLC	172,199	16.340	2,813,731.660	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,990,553	5.137	10,225,470.760	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	573,320	2.659	1,524,457.880	
	UNILEVER PLC	252,812	36.340	9,187,188.080	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	10.130	685,942.820	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	32,209	18.875	607,944.870	
	PEARSON PLC	63,746	6.000	382,476.000	
	PERSIMMON PLC	33,688	22.740	766,065.120	

PRUDENTIAL PLC	254,460	11.155	2,838,501.300	
RIO TINTO PLC	109,155	54.670	5,967,503.850	
VODAFONE GROUP PLC	2,706,774	1.301	3,521,512.970	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	69,296	61.490	4,261,011.040	
RELX PLC	189,262	22.040	4,171,334.480	
RENTOKIL INITIAL PLC	193,406	4.856	939,179.530	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	795,864	1.023	814,168.870	
NATWEST GROUP PLC	572,346	2.259	1,292,929.610	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,393	13.390	647,982.270	
SSE PLC	99,967	15.840	1,583,477.280	
BP PLC	1,956,809	3.653	7,148,223.270	
SAGE GROUP PLC(THE)	92,478	6.758	624,966.320	
SMITHS GROUP PLC	35,400	14.580	516,132.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,648	113.800	870,342.400	
STANDARD CHARTERED PLC	242,725	5.148	1,249,548.300	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,918,954	0.465	3,217,313.610	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.410	488,979.540	
TESCO PLC	809,805	2.796	2,264,214.780	
3I GROUP PLC	101,975	12.455	1,270,098.620	
SMITH & NEPHEW PLC	88,029	12.395	1,091,119.450	
GLAXOSMITHKLINE PLC	489,601	15.054	7,370,453.450	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	31,795	63.820	2,029,156.900	
WPP PLC	113,403	10.340	1,172,587.020	
ASTRAZENECA PLC	150,840	85.820	12,945,088.800	
WHITBREAD PLC	18,744	28.340	531,204.960	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	50.960	822,443.440	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	19.040	738,066.560	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,286	49.120	799,968.320	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.660	486,412.920	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	28.710	576,697.770	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,559	37.570	396,701.630	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	18.335	330,653.390	
AVEVA GROUP PLC	10,408	24.660	256,661.280	
ABRDN PLC	206,313	2.028	418,402.760	
EXPERIAN PLC	89,361	27.980	2,500,320.780	
MONDI PLC	45,875	16.840	772,535.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	10.760	379,957.120	
OCADO GROUP PLC	44,909	13.245	594,819.700	
INFORMA PLC	151,566	5.758	872,717.020	
GLENCORE PLC	968,128	4.222	4,087,436.410	
ENTAIN PLC	58,126	15.900	924,203.400	
COCA-COLA HBC AG	20,233	20.430	413,360.190	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	56,561	5.890	333,144.290	

	FERGUSON PLC	21,607	110.950	2,397,296.650	
	M&G PLC	259,117	2.013	521,602.520	
	JD SPORTS FASHION PLC	235,490	1.535	361,477.150	
	SHELL PLC	750,311	19.528	14,652,073.200	
	AUTO TRADER GROUP PLC	104,624	6.314	660,595.930	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	470,129	1.410	662,881.890	
イギリス・ポンド 小計		28,210,749		171,896,889.920 (26,585,572,995)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	107,744	33.460	3,605,114.240	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	143,645	34.090	4,896,858.050	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,198	558.000	1,226,484.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	106,143	21.010	2,230,064.430	
	ICL GROUP LTD	68,048	34.740	2,363,987.520	
	NICE LTD	6,129	725.800	4,448,428.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,784	122.900	2,062,753.600	
	AZRIELI GROUP	4,414	271.200	1,197,076.800	
イスラエル・シュケル 小計		455,105		22,030,766.840 (784,077,195)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	17,134	64.660	1,107,884.440	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	275,753	26.680	7,357,090.040	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	356,597	23.130	8,248,088.610	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	162,222	18.550	3,009,218.100	
	TELSTRA CORP LTD	389,681	3.950	1,539,239.950	
	ASX LTD	18,926	82.410	1,559,691.660	
	BHP GROUP LTD	512,484	44.770	22,943,908.680	
	AMPOL LTD	20,946	29.980	627,961.080	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	21.350	1,101,745.400	
	CSL LIMITED	46,424	264.790	12,292,610.960	
	REA GROUP LTD	5,828	131.560	766,731.680	
	TRANSURBAN GROUP	293,786	12.600	3,701,703.600	
	COCHLEAR LTD	5,875	214.900	1,262,537.500	
	ORIGIN ENERGY LTD	146,360	5.690	832,788.400	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	172,888	94.710	16,374,222.480	
	RIO TINTO LIMITED	35,915	115.350	4,142,795.250	
	APA GROUP	118,205	10.040	1,186,778.200	
	ARISTOCRAT LEISU	62,013	36.700	2,275,877.100	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	269,430	4.850	1,306,735.500	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,246	43.600	2,016,325.600	
ORICA LTD	41,311	14.490	598,596.390		
LEND LEASE CORP LTD	62,116	10.530	654,081.480		
BLUESCOPE STEEL LTD	46,946	19.090	896,199.140		

SYDNEY AIRPORT	142,258	8.720	1,240,489.760		
MACQUARIE GROUP LTD	33,736	177.400	5,984,766.400		
SUNCORP GROUP LTD	120,290	11.420	1,373,711.800		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	318,861	29.380	9,368,136.180		
NEWCREST MINING LTD	86,879	25.600	2,224,102.400		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	107,483	5.080	546,013.640		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	133,624	11.820	1,579,435.680		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	96,692	10.590	1,023,968.280		
REECE LTD	30,319	19.170	581,215.230		
SANTOS LTD	333,393	7.100	2,367,090.300		
SONIC HEALTHCARE	40,613	35.520	1,442,573.760		
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	24,711	25.040	618,763.440		
TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	4.950	1,062,255.150		
WESFARMERS LTD	109,481	47.750	5,227,717.750		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,641	28.080	2,545,199.280		
WOOLWORTHS GROUP LTD	120,440	35.690	4,298,503.600		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	19.780	307,638.340		
SEEK LTD	36,140	26.250	948,675.000		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	80.520	490,044.720		
BRAMBLES LTD	130,028	9.890	1,285,976.920		
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.260	402,875.860		
EVOLUTION MINING LTD	150,230	4.390	659,509.700		
AURIZON HOLDINGS LTD	138,166	3.630	501,542.580		
TREASURY WINE ESTATES LTD	75,903	11.700	888,065.100		
XERO LTD	14,063	93.210	1,310,812.230		
IDP EDUCATION LTD	22,852	25.290	577,927.080		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	7.240	865,715.760		
MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.170	897,598.180		
SOUTH32 LTD(AUD)	409,317	4.540	1,858,299.180		
COLES GROUP LTD	122,726	17.800	2,184,522.800		
WISETECH GLOBAL LTD	13,604	41.250	561,165.000		
オーストラリア・ドル 小計	6,732,965		151,027,122.340 (12,470,309,492)		
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	45,567	66.570	3,033,395.190	
	BARRICK GOLD CORP	173,687	28.870	5,014,343.690	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	12.280	261,220.160	
	BANK OF MONTREAL	63,076	142.400	8,982,022.400	
	BANK OF NOVA SCOTIA	119,119	88.800	10,577,767.200	
	NATIONAL BANK OF CANADA	32,600	100.830	3,287,058.000	
	BCE INC	7,275	66.760	485,679.000	

BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	137,930	68.250	9,413,722.500	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	29.610	834,765.120	
SAPUTO INC	25,395	31.060	788,768.700	
BLACKBERRY LTD	46,671	8.470	395,303.370	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	62,222	17.950	1,116,884.900	
CGI INC	22,985	104.330	2,398,025.050	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	61.470	944,056.260	
CAE INC	30,443	32.000	974,176.000	
CAMECO CORP	34,676	28.510	988,612.760	
ROGERS COMM-CL B	37,308	65.630	2,448,524.040	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	43,621	154.900	6,756,892.900	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	115,217	67.200	7,742,582.400	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	185.170	1,090,466.130	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,793	34.950	342,265.350	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69,109	155.950	10,777,548.550	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	49.960	1,039,917.400	
OPEN TEXT CORP	25,868	55.030	1,423,516.040	
EMPIRE CO LTD	15,093	39.350	593,909.550	
KINROSS GOLD CORP	118,575	6.800	806,310.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,452	66.630	629,786.760	
FORTIS INC	45,200	57.880	2,616,176.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	35.050	1,994,835.700	
TELUS CORP	31,890	31.960	1,019,204.400	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	37.990	959,247.500	
IMPERIAL OIL LTD	22,066	55.020	1,214,071.320	
ENBRIDGE INC	196,479	53.130	10,438,929.270	
IGM FINANCIAL INC	5,366	44.330	237,874.780	
MANULIFE FINANCIAL CORP	189,250	25.440	4,814,520.000	
LOBLAW CO LTD	15,486	101.060	1,565,015.160	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	78,873	49.470	3,901,847.310	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,202	94.080	2,841,404.160	
SUN LIFE FINANCIAL INC	57,083	66.420	3,791,452.860	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,320	615.050	1,426,916.000	
METRO INC	22,764	66.830	1,521,318.120	
EMERA INC	23,836	59.140	1,409,661.040	
ONEX CORP	6,489	84.580	548,839.620	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	30.090	564,668.940	
POWER CORP OF CANADA	56,439	39.480	2,228,211.720	
QUEBECOR INC-B	16,042	28.010	449,336.420	
ROYAL BANK OF CANADA	139,486	137.610	19,194,668.460	

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	90,681	88.110	7,989,902.910	
SHAW COMM INC-B	42,601	37.400	1,593,277.400	
SUNCOR ENERGY INC	143,108	37.030	5,299,289.240	
LUNDIN MINING CORP	64,310	11.430	735,063.300	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,824	44.650	1,956,741.600	
THOMSON REUTERS CORP	16,740	128.560	2,152,094.400	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,388	105.940	994,564.720	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	177,819	102.340	18,197,996.460	
TC ENERGY CORP	94,979	65.880	6,257,216.520	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,298	120.540	1,120,780.920	
WESTON (GEORGE) LTD	7,886	138.690	1,093,709.340	
INTACT FINANCIAL CORP	17,901	181.550	3,249,926.550	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	47,007	54.730	2,572,693.110	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,931	2,095.000	4,045,445.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	18,623	185.570	3,455,870.110	
TOURMALINE OIL CORP	32,364	47.960	1,552,177.440	
KEYERA CORP	23,772	28.760	683,682.720	
PARKLAND CORP	14,497	32.520	471,442.440	
ALTAGAS LTD	24,053	27.510	661,698.030	
PEMBINA PIPELINE CORP	56,442	41.840	2,361,533.280	
DOLLARAMA INC	26,438	64.760	1,712,124.880	
CENOVUS ENERGY INC W/I	134,422	19.290	2,593,000.380	
NORTHLAND POWER INC	23,490	37.670	884,868.300	
TMX GROUP LTD	4,797	128.230	615,119.310	
IVANHOE MINES LTD	61,930	11.380	704,763.400	
NUTRIEN LTD	55,564	99.190	5,511,393.160	
TFI INTERNATIONAL INC	8,999	130.300	1,172,569.700	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	11,346	33.260	377,367.960	
WSP GLOBAL INC	12,991	148.790	1,932,930.890	
IA FINANCIAL CORP INC	11,660	75.980	885,926.800	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	36.390	599,889.150	
NUVEI CORP	4,960	67.430	334,452.800	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	45.140	489,543.300	
AIR CANADA	17,940	24.410	437,915.400	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	26,443	71.740	1,897,020.820	
SHOPIFY INC	10,946	850.620	9,310,886.520	
FIRSTSERVICE CORP	3,293	184.790	608,513.470	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	9.140	170,314.760	
HYDRO ONE LTD	35,738	31.290	1,118,242.020	
カナダ・ドル 小計	3,811,554		243,687,666.710 (21,983,064,414)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	109,500	3.780	413,910.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	176,600	34.750	6,136,850.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.010	255,164.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	67,400	9.370	631,538.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.765	554,013.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.860	790,514.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	320,953	12.000	3,851,436.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.530	2,045,307.660	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	4.940	780,767.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	111,300	30.750	3,422,475.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.150	289,575.000	
	VENTURE CORP LTD	42,100	17.210	724,541.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.390	796,346.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	295,215	3.630	1,071,630.450	
シンガポール・ドル 小計	3,206,940		21,764,067.110 (1,857,998,409)		
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	253,013	7.532	1,905,693.910	
	LOGITECH INTL-REG	18,008	66.680	1,200,773.440	
	NESTLE SA-REGISTERED	274,536	115.160	31,615,565.760	
	CIE FINANC RICHEMONT	50,816	119.950	6,095,379.200	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	68,016	340.100	23,132,241.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	203.700	839,651.400	
	SIKA INHABER	13,838	292.100	4,042,079.800	
	SGS SA-REG	613	2,514.000	1,541,082.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	213,886	78.680	16,828,550.480	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	152.500	649,497.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	329	2,064.000	679,056.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	15.795	315,568.300	
	SWISSCOM AG-REG	2,419	537.200	1,299,486.800	
	ABB LTD	160,591	29.960	4,811,306.360	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,095	43.330	610,736.350	
	GEBERIT AG	3,539	591.800	2,094,380.200	
	LONZA GROUP AG-REG	7,169	610.800	4,378,825.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	110	9,815.000	1,079,650.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	10	101,500.000	1,015,000.000	
	GIVAUDAN-REG	901	3,687.000	3,321,987.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,734	412.700	6,080,721.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,604	374.000	1,347,896.000	
	HOLCIM LTD	51,147	45.650	2,334,860.550	
TEMENOS GROUP	6,753	89.720	605,879.160		
BACHEM HOLDING AG	500	526.000	263,000.000		
SONOVA HOLDING AG	5,210	332.500	1,732,325.000		

	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,934	238.200	1,175,278.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,125	1,399.000	1,573,875.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	274.000	819,534.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	52.650	241,768.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,494	198.600	296,708.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,053	549.800	1,678,539.400	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	162.050	851,734.800	
	EMS-CHEMIE HOLDING	616	889.000	547,624.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	88.750	713,550.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,176	1,213.000	2,639,488.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,008	52.960	1,112,583.680	
	SWISS RE LTD	29,213	92.040	2,688,764.520	
	ALCON INC	48,573	68.800	3,341,822.400	
	UBS GROUP AG	342,779	16.350	5,604,436.650	
	VAT GROUP AG	2,412	331.400	799,336.800	
スイス・フラン	小計	1,670,459		143,906,239.060 (17,991,158,007)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	63,697	469.600	29,912,111.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	40,190	410.200	16,485,938.000	
	ERICSSON LM-B SHS	279,450	92.540	25,860,303.000	
	GETINGE AB-B SHS	24,421	353.700	8,637,707.700	
	INVESTOR AB-A SHS	55,733	201.600	11,235,772.800	
	LUNDBERGS B	7,382	437.200	3,227,410.400	
	SKF AB-B SHS	32,228	175.850	5,667,293.800	
	SANDVIK AB	114,371	212.300	24,280,963.300	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	166,438	107.450	17,883,763.100	
	SKANSKA AB-B SHS	31,968	210.400	6,726,067.200	
	SWEDBANK AB	89,378	153.120	13,685,559.360	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	54,382	155.550	8,459,120.100	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	134,020	88.140	11,812,522.800	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	188.300	4,461,015.300	
	VOLVO AB-B SHS	134,282	185.180	24,866,340.760	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	66.880	10,589,043.520	
	TELE2 AB-B SHS	46,083	121.200	5,585,259.600	
	INDUSTRIVARDEN A	14,273	258.600	3,690,997.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,940	254.900	3,043,506.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	25,219	166.500	4,198,963.500	
	SECURITAS AB-B SHS	48,354	107.950	5,219,814.300	
	INVESTOR AB-B SHS	169,419	187.520	31,769,450.880	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,270	161.820	10,723,811.400	
	ASSA ABLOY AB-B	101,025	245.900	24,842,047.500	
	TELIA CO AB	269,954	34.765	9,384,950.810	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	355.300	7,376,738.600	
	BOLIDEN AB	24,047	399.500	9,606,776.500	

	ALFA LAVAL AB	27,930	290.300	8,108,079.000	
	KINNEVIK AB-B	21,449	233.250	5,002,979.250	
	FASTIGHETS AB BALDER	11,401	562.600	6,414,202.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	45,158	109.400	4,940,285.200	
	NIBE INDUSTRIER AB	134,088	77.020	10,327,457.760	
	HEXAGON AB-B SHS	185,243	120.000	22,229,160.000	
	SAGAX AB	18,348	244.200	4,480,581.600	
	EPIROC AB-A	59,363	180.500	10,715,021.500	
	EPIROC AB-B	38,943	154.600	6,020,587.800	
	ESSITY AB-B	57,654	240.900	13,888,848.600	
	EQT AB	30,003	309.100	9,273,927.300	
	EMBRACER GROUP AB	49,142	80.720	3,966,742.240	
	LIFCO AB	25,738	206.600	5,317,470.800	
	EVOLUTION AB	16,147	1,001.000	16,163,147.000	
	NORDEA BANK ABP	310,272	104.500	32,423,424.000	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	253.500	3,788,557.500	
	SINCH AB	56,299	68.140	3,836,213.860	
スウェーデン・クローナ 小計		3,309,429		506,129,935.240 (6,164,662,611)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,457	977.000	10,216,489.000	
	A P MOLLER A/S	527	20,900.000	11,014,300.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	19,900.000	6,785,900.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	110.750	7,611,293.750	
	GENMAB A/S	6,251	2,102.000	13,139,602.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,132	404.700	7,742,720.400	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,306.000	1,874,778.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	164,082	642.900	105,488,317.800	
	GN STORE NORD A/S	10,448	328.700	3,434,257.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	97,991	180.300	17,667,777.300	
	COLOPLAST-B	11,922	939.200	11,197,142.400	
	DSV A/S	19,861	1,149.000	22,820,289.000	
	DEMANT A/S	10,739	264.300	2,838,317.700	
	TRYG A/S	35,784	145.000	5,188,680.000	
	PANDORA A/S	9,265	670.800	6,214,962.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	8,984	470.800	4,229,667.200	
	AMBU A/S B	14,156	108.300	1,533,094.800	
ORSTED A/S	19,205	770.200	14,791,691.000		
デンマーク・クローネ 小計		508,683		253,789,279.950 (4,415,933,471)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	6.880	758,354.880	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	8.990	444,546.510	
	FISHER & PAYKEL	57,388	27.250	1,563,823.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	262,943	4.590	1,206,908.370	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	5.560	343,241.040	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.710	584,803.020	

ニュージーランド・ドル 小計		665,902		4,901,676.820 (379,095,685)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	218.100	9,422,356.200	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	82.460	10,640,308.560	
	TELENOR ASA	67,435	128.250	8,648,538.750	
	SCHIBSTED ASA	7,537	229.700	1,731,248.900	
	ORKLA ASA	69,440	82.300	5,714,912.000	
	EQUINOR ASA	94,306	289.500	27,301,587.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	426.400	6,478,295.200	
	AKER BP ASA	15,217	284.900	4,335,323.300	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	29,484	209.200	6,168,052.800	
	ADEVINTA ASA	22,265	80.440	1,790,996.600	
	DNB BANK ASA	89,596	192.250	17,224,831.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	202.000	1,503,890.000	
ノルウェー・クローネ 小計		590,156		100,960,340.310 (1,303,397,993)	
ユーロ	CRH PLC	75,580	38.570	2,915,120.600	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,584	121.150	2,130,301.600	
	KERRY GROUP PLC-A	14,968	101.650	1,521,497.200	
	KINGSPAN GROUP PLC	14,307	84.840	1,213,805.880	
	UMICORE	17,749	35.780	635,059.220	
	AIR LIQUIDE	46,578	144.580	6,734,247.240	
	AIRBUS SE	57,535	108.920	6,266,712.200	
	AXA SA	189,506	24.530	4,648,582.180	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	67,438	29.740	2,005,606.120	
	ADIDAS AG	18,433	210.150	3,873,694.950	
	ASSICURAZIONI GENERALI	111,777	17.465	1,952,185.300	
	DASSAULT AVIATION SA	2,950	119.500	352,525.000	
	DANONE	63,231	54.050	3,417,635.550	
	SAFRAN SA	33,308	108.100	3,600,594.800	
	INTESA SANPAOLO	1,598,158	2.412	3,854,757.090	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,921	84.990	2,797,955.790	
	ACCOR SA	17,380	30.270	526,092.600	
	BOUYGUES	20,222	31.100	628,904.200	
	BNP PARIBAS	109,914	55.090	6,055,162.260	
	THALES SA	10,448	88.360	923,185.280	
	CAPGEMINI SA	15,519	182.500	2,832,217.500	
	UNICREDIT SPA	205,636	12.118	2,491,897.040	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,859	158.950	2,679,738.050	
	COMMERZBANK AG	106,215	7.471	793,532.260	
	EIFFAGE	8,477	88.840	753,096.680	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	38,830	31.850	1,236,735.500	
	UNITED INTERNET	9,882	29.860	295,076.520	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	35.280	195,662.880		
PUBLICIS GROUPE	25,345	58.520	1,483,189.400		

FAURECIA	10,774	36.000	387,864.000	
IBERDROLA SA	594,592	9.432	5,608,191.740	
ENI SPA	241,813	13.362	3,231,105.300	
JERONIMO MARTINS	33,135	18.755	621,446.920	
KESKO OYJ-B	23,804	25.500	607,002.000	
KBC GROUPE	26,587	65.720	1,747,297.640	
HANNOVER RUECK SE	5,321	161.100	857,213.100	
WARTSILA OYJ	48,612	9.638	468,522.450	
L'OREAL	24,554	340.650	8,364,320.100	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,069	635.900	17,213,177.100	
GEA GROUP AG	16,492	38.480	634,612.160	
BOLLORE	70,807	4.444	314,666.300	
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.346	536,852.930	
MICHELIN(CGDE) -B	16,226	124.200	2,015,269.200	
CONTINENTAL AG	9,795	78.450	768,417.750	
DEUTSCHE POST AG-REG	95,937	43.715	4,193,885.950	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	18.010	381,920.060	
OMV AG	17,007	45.700	777,219.900	
VERBUND AG	6,916	100.500	695,058.000	
PERNOD-RICARD	20,447	188.200	3,848,125.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	15,912	88.080	1,401,528.960	
RENAULT SA	19,019	29.220	555,735.180	
REPSOL SA	150,289	11.330	1,702,774.370	
REMY COINTREAU	1,847	168.000	310,296.000	
MERCK KGAA	12,364	171.300	2,117,953.200	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	49,174	54.480	2,678,999.520	
RWE AG	64,426	37.710	2,429,504.460	
SEB SA	2,439	130.000	317,070.000	
SOCIETE GENERALE-A	78,864	27.300	2,152,987.200	
VINCI S.A.	52,344	93.020	4,869,038.880	
SODEXO	9,325	74.580	695,458.500	
SOFINA	1,382	332.400	459,376.800	
SOLVAY SA	6,931	99.040	686,446.240	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	52,892	134.920	7,136,188.640	
VIVENDI SE	68,746	11.155	766,861.630	
SAP SE	101,597	97.480	9,903,675.560	
TELEFONICA S.A	537,523	4.166	2,239,320.810	
TOTALENERGIES SE	244,535	47.620	11,644,756.700	
VALEO	25,393	23.610	599,528.730	
E.ON SE	208,641	11.492	2,397,702.370	
VOEST-ALPINE AG	9,875	27.460	271,167.500	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	67.000	694,522.000	
SIEMENS AG-REG	74,631	124.180	9,267,677.580	
UPM-KYMMENE OYJ	55,982	30.500	1,707,451.000	
ING GROEP NV-CVA	380,432	11.150	4,241,816.800	

PUMA AG	10,448	83.020	867,392.960	
BAYER AG	94,861	50.600	4,799,966.600	
STORA ENSO OYJ-R SHS	55,548	16.650	924,874.200	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,500	68.940	1,206,450.000	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	82,756	68.790	5,692,785.240	
BASF SE	89,592	61.060	5,470,487.520	
BEIERSDORF AG	10,342	86.560	895,203.520	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,032	56.760	796,456.320	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,836	55.720	1,049,541.920	
ASM INTERNATIONAL NV	4,271	260.900	1,114,303.900	
ORANGE	191,727	10.716	2,054,546.530	
SAMPO OYJ-A SHS	49,985	41.060	2,052,384.100	
RANDSTAD NV	11,239	60.660	681,757.740	
ALLIANZ SE	40,157	200.200	8,039,431.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.024	1,080,991.260	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	106,390	26.310	2,799,120.900	
HERMES INTL	3,076	1,203.000	3,700,428.000	
ENDESA S.A.	28,639	18.245	522,518.550	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	70,248	6.748	474,033.500	
ERSTE GROUP BANK AG	31,546	32.400	1,022,090.400	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,509	243.800	3,293,494.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	63,979	24.915	1,594,036.780	
DASSAULT SYSTEMES SA	64,596	40.870	2,640,038.520	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,877	21.150	483,848.550	
HEINEKEN NV	24,594	89.340	2,197,227.960	
AKZO NOBEL	18,717	84.060	1,573,351.020	
ASML HOLDING NV	40,314	558.200	22,503,274.800	
AEGON NV	189,323	4.351	823,744.370	
VOLKSWAGEN AG	3,153	226.800	715,100.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,903	176.100	3,152,718.300	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	644,062	5.299	3,412,884.530	
KERING	7,293	620.200	4,523,118.600	
CNP ASSURANCES	13,987	21.760	304,357.120	
FORTUM OYJ	40,820	18.730	764,558.600	
AGEAS	17,055	41.480	707,441.400	
UCB SA	12,778	91.900	1,174,298.200	
NEMETSCHEK SE	4,841	75.000	363,075.000	
CARREFOUR SA	61,189	17.640	1,079,373.960	
NATURGY ENERGY GROUP SA	16,289	22.520	366,828.280	
NOKIA OYJ	510,690	4.745	2,423,224.050	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	88,659	29.680	2,631,399.120	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,629	88.480	2,356,133.920	
SANOFI	110,856	90.210	10,000,319.760	

STMICROELECTRONICS NV	65,099	36.690	2,388,482.310	
ELISA OYJ	13,642	48.100	656,180.200	
BANCO SANTANDER SA	1,674,154	2.988	5,002,372.150	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	46,237	16.410	758,749.170	
QIAGEN N.V.	20,427	43.110	880,607.970	
DEUTSCHE BANK AG-REG	213,285	11.260	2,401,589.100	
BMW VORZUG	6,957	72.050	501,251.850	
ENEL SPA	788,051	6.192	4,879,611.790	
COLRUYT NV	4,673	34.460	161,031.580	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	324,117	15.586	5,051,687.560	
SARTORIUS AG	2,686	383.000	1,028,738.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,151	45.500	325,370.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	126,618	29.815	3,775,115.670	
RATIONAL AG	479	645.200	309,050.800	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,501	129.950	454,954.950	
BECHTLE AG	7,533	44.570	335,745.810	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	3.002	1,025,023.890	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,943	85.800	1,196,309.400	
TELEPERFORMANCE	5,918	320.100	1,894,351.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,670	152.200	2,993,774.000	
EURAZEO	3,008	66.400	199,731.200	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,714	89.260	956,331.640	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,667	71.700	764,823.900	
INDITEX	104,255	23.660	2,466,673.300	
ESSILORLUXOTTICA	27,864	157.760	4,395,824.640	
SNAM SPA	198,963	4.758	946,665.950	
CREDIT AGRICOLE SA	114,926	11.860	1,363,022.360	
ORPEA	4,932	36.870	181,842.840	
ENAGAS	23,477	18.180	426,811.860	
WENDEL	2,220	86.700	192,474.000	
TENARIS SA	52,985	10.805	572,502.920	
TELECOM ITALIA SPA	832,580	0.374	311,384.920	
ATLANTIA SPA	45,718	15.810	722,801.580	
PROXIMUS	13,739	17.240	236,860.360	
TERNA SPA	167,140	6.834	1,142,234.760	
BIOMERIEUX	4,612	95.300	439,523.600	
GRIFOLS SA	30,687	15.140	464,601.180	
FERROVIAL SA	46,437	23.140	1,074,552.180	
LANXESS AG	7,194	43.660	314,090.040	
NESTE OYJ	43,290	33.100	1,432,899.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	19,572	16.310	319,219.320	
RECORDATI SPA	10,303	43.350	446,635.050	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	9.462	523,286.440	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,807	194.650	935,682.550	
KONE OYJ	31,956	50.400	1,610,582.400	

ELIA GROUP	2,862	117.400	335,998.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,456	334.000	820,304.000	
ENGIE	177,463	13.716	2,434,082.500	
ALSTOM	28,533	22.230	634,288.590	
ELECTRICITE DE FRANCE	41,549	7.500	311,617.500	
IPSEN SA	3,646	102.000	371,892.000	
ARKEMA SA	6,009	116.100	697,644.900	
LEGRAND SA	25,978	82.460	2,142,145.880	
AMPLIFON SPA	11,372	36.690	417,238.680	
ADP	2,313	125.150	289,471.950	
ORION OYJ	8,106	41.120	333,318.720	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	38,282	9.554	365,746.220	
SYMRISE AG	12,106	102.900	1,245,707.400	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	43.870	1,062,882.360	
PRYSMIAN SPA	21,822	27.890	608,615.580	
DIASORIN SPA	2,223	128.600	285,877.800	
CAIXABANK	409,723	2.916	1,194,752.260	
BUREAU VERITAS SA	29,810	24.390	727,065.900	
GETLINK	41,525	14.100	585,502.500	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	19.740	552,167.280	
AMADEUS IT GROUP SA	46,767	58.540	2,737,740.180	
BRENNTAG SE	16,310	71.560	1,167,143.600	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	26.950	629,013.000	
EDENRED	24,865	40.760	1,013,497.400	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.372	233,369.220	
LEG IMMOBILIEN SE	6,113	111.700	682,822.100	
KION GROUP AG	7,508	72.120	541,476.960	
VONOVIA SE	70,086	44.410	3,112,519.260	
KNORR-BREMSE AG	6,860	79.040	542,214.400	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,475	53.900	1,534,802.500	
FERRARI NV	12,050	188.250	2,268,412.500	
CNH INDUSTRIAL NV	106,155	12.410	1,317,383.550	
AROUNDTOWN SA	106,018	5.154	546,416.770	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	35.930	290,745.560	
MONCLER SPA	22,855	52.100	1,190,745.500	
NEXI SPA	43,586	12.200	531,749.200	
PROSUS NV	90,679	53.590	4,859,487.610	
JDE PEET'S BV	7,308	28.150	205,720.200	
SIEMENS ENERGY AG	35,761	19.485	696,803.080	
INPOST SA	20,395	4.841	98,732.190	
EURONEXT NV	9,619	79.550	765,191.450	
IMCD NV	5,359	140.500	752,939.500	
WORLDLINE SA	23,570	46.665	1,099,894.050	
NN GROUP NV	28,124	42.860	1,205,394.640	
FINECOBANK SPA	65,274	14.520	947,778.480	
ARGENX SE	4,255	248.900	1,059,069.500	

	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	67,941	19.574	1,329,877.130	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	37,831	28.145	1,064,753.490	
	ZALANDO SE	20,857	55.500	1,157,563.500	
	STELLANTIS NV	196,248	16.034	3,146,640.430	
	AENA SME SA	7,076	140.900	997,008.400	
	CELLNEX TELECOM SAU	48,760	39.610	1,931,383.600	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,029	32.765	525,190.180	
	ABN AMRO BANK NV	34,382	11.954	411,002.420	
	EXOR NV	9,966	65.580	653,570.280	
	SCOUT24 SE	9,670	49.250	476,247.500	
	COVESTRO AG	19,158	47.360	907,322.880	
	HELLOFRESH SE	16,990	45.970	781,030.300	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	74,093	54.380	4,029,177.340	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	10.040	559,719.960	
	AMUNDI SA	5,924	60.700	359,586.800	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,281	8.854	206,129.970	
	ADYEN NV	1,920	1,804.600	3,464,832.000	
	UNIPER SE	10,427	28.630	298,525.010	
	DELIVERY HERO SE	16,645	44.210	735,875.450	
ユーロ 小計		17,831,375		434,607,265.870 (56,246,872,349)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	16.520	2,709,280.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	80.000	12,960,000.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	53,500	48.500	2,594,750.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	116,440	394.600	45,947,224.000	
	MTR CORP	137,500	41.400	5,692,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	150.600	11,415,480.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	120,450	32.600	3,926,670.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	49.450	7,219,700.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,175,456	11.860	13,940,908.160	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	200,000	46.650	9,330,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	353,500	28.950	10,233,825.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	31.850	5,193,652.100	
	SINO LAND CO	505,400	9.960	5,033,784.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	138,500	93.950	13,012,075.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	44.650	2,210,175.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	132,000	124.800	16,473,600.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	20.950	3,477,700.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	15.560	3,379,632.000	

AIA GROUP LTD	1,175,027	81.800	96,117,208.600	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.700	4,761,500.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	21.450	5,405,400.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	133,000	31.650	4,209,450.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	20.200	2,104,840.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	151,750	34.850	5,288,487.500	
ESR CAYMAN LTD	203,800	24.000	4,891,200.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.800	1,794,000.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	23.950	3,606,870.000	
WH GROUP LTD	897,000	5.470	4,906,590.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,332	56.050	14,367,408.600	
CK ASSET HOLDINGS LTD	186,332	50.200	9,353,866.400	
香港・ドル 小計	8,261,353		331,557,776.360 (4,907,055,090)	
合計	106,182,656		578,920,878,786 (578,920,878,786)	

(2) 株式以外の有価証券

2022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	101,202.000	1,067,681.100	
		GOODMAN GROUP	158,185.000	3,429,450.800	
		GPT GROUP	207,292.000	976,345.320	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,060,160.000	
		SCENTRE GROUP	479,376.000	1,433,334.240	
		STOCKLAND	243,481.000	1,012,880.960	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	665,362.690	
	オーストラリア・ドル 小計		1,975,372.000	9,645,215.110 (796,405,412)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	248,606.000	693,610.740	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	545,177.000	1,150,323.470	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	346,140.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	484,500.000	843,030.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,470,583.000	3,033,104.210 (258,936,106)	
投資信託受益証券 合計		3,445,955	1,055,341,518 (1,055,341,518)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,320.000	573,057.600	

	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,788.000	2,620,960.920	
	AMERICAN TOWER CORP	44,301.000	10,266,756.750	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	150,150.000	1,043,542.500	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,356.000	3,156,957.720	
	BOSTON PROPERTIES INC	14,801.000	1,776,268.010	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	10,440.000	1,701,093.600	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	42,028.000	6,934,620.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	27,360.000	3,675,542.400	
	DUKE REALTY TRUST	35,306.000	1,850,740.520	
	EQUINIX INC	8,702.000	6,139,173.980	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,573.000	1,239,328.940	
	EQUITY RESIDENTIAL	34,397.000	2,911,018.110	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,132.000	1,940,839.320	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	13,998.000	2,655,980.520	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	49,946.000	1,542,831.940	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	75,616.000	1,398,139.840	
	INVITATION HOMES INC	55,207.000	2,057,012.820	
	IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,292,029.200	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	54,080.000	1,082,681.600	
	MID AMERICA	11,699.000	2,390,339.680	
	PROLOGIS INC	72,030.000	10,324,059.900	
	PUBLIC STORAGE	15,276.000	5,371,499.880	
	REALTY INCOME CORP	53,267.000	3,501,772.580	
	REGENCY CENTERS CORP	14,665.000	966,423.500	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,551.000	3,189,567.300	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,871.000	4,392,461.220	
	SUN COMMUNITIES INC	11,066.000	1,996,638.380	
	UDR INC	28,289.000	1,536,658.480	
	VENTAS INC	40,408.000	2,101,216.000	
	VICI PROPERTIES INC	57,882.000	1,593,491.460	
	VORNADO REALTY TRUST	15,123.000	640,459.050	
	WELLTOWER INC	40,744.000	3,341,822.880	
	WEYERHAEUSER CO	72,184.000	2,759,594.320	
	WP CAREY INC	19,446.000	1,471,867.740	
アメリカ・ドル	小計	1,233,442.000	101,436,448.660 (11,723,010,370)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	75,770.000	383,093.120	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	557,578.890	
	SEGRO PLC	120,360.000	1,479,826.200	
イギリス・ポンド	小計	270,158.000	2,420,498.210	

				(374,354,253)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT		8,220.000	438,783.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		13,467.000	333,038.910	
カナダ・ドル 小計			21,687.000	771,822.510 (69,626,109)	
ユーロ	COVIVIO		4,663.000	332,471.900	
	GECINA SA		4,763.000	525,597.050	
	KLEPIERRE		17,099.000	431,236.780	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		12,920.000	848,456.400	
ユーロ 小計			39,445.000	2,137,762.130 (276,669,175)	
香港・ドル	LINK REIT		199,700.000	12,740,860.000	
香港・ドル 小計			199,700.000	12,740,860.000 (188,564,728)	
投資証券 合計			1,764,432	12,632,224,635 (12,632,224,635)	
合計				13,687,566,153 (13,687,566,153)	

(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)

- 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。
- 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。
- 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 607銘柄	69.79	-	-	73.50
	投資証券 35銘柄	-	-	1.93	
イギリス・ポンド	株式 78銘柄	4.38	-	-	4.55
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.13	-	-	0.13
オーストラリア・ドル	株式 54銘柄	2.05	-	-	2.24
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.62	-	-	3.72
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.31	-	-	0.36
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.96	-	-	3.04
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	1.02	-	-	1.04
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.73	-	-	0.75
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.06	-	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.21	-	-	0.22
ユーロ	株式 227銘柄	9.26	-	-	9.54
	投資証券 4銘柄	-	-	0.05	
香港・ドル	株式 30銘柄	0.81	-	-	0.86

	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	
--	------	-----	---	---	------	--

(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)

2022年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,885,051,647
国債証券	527,095,182,400
地方債証券	31,528,978,987
特殊債券	28,905,227,169
社債券	27,635,641,480
未収利息	865,336,672
前払費用	345,086,531
流動資産合計	620,260,504,886
資産合計	620,260,504,886
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,229,656,000
流動負債合計	1,229,656,000
負債合計	1,229,656,000
純資産の部	
元本等	
元本	481,096,291,502
剰余金	
剰余金又は欠損金()	137,934,557,384
元本等合計	619,030,848,886
純資産合計	619,030,848,886
負債純資産合計	620,260,504,886

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月26日 至 2022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	2022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	211,258,108,968円
同期中追加設定元本額	662,772,675,986円
同期中一部解約元本額	392,934,493,452円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,732,691,985円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	120,324,023円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	159,439,856円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	127,274,098円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	670,050,494円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	133,587,952円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,730,893円
たわらノーロード 国内債券	15,976,196,022円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,552,467,591円
たわらノーロード バランス(堅実型)	894,770,209円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,521,253,187円
たわらノーロード バランス(積極型)	192,614,033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)	75,059,663円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	1,340,531,350円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,243,044,037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)	332,534,550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)	23,087,109円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	17,160,157円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	13,672,915円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	91,625,263円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,084,927円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	414,272円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,243,070,817円
Oneグローバルバランス	11,009,022円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,975,298,917円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,473,804,373円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,177,420,423円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,188,884,122円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,323,139,978円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	389,968,785円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	88,556,920円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,051,936,044円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,707,847円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,303,183,102円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,576,117,456円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	340,130,669円
投資のソムリエ	110,542,248,613円
クルーズコントロール	331,216,116円
投資のソムリエ<DC年金>	6,680,109,543円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,612,393,810円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	739,000,418円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	7,803,605,987円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	53,422,997,060円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	36,416,147円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	17,735,957円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	64,195,233円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	176,635,602円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,247,263,833円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,552,981,290円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,327,869,089円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	37,377,953円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	15,418,280円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	12,985,711円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	338,120,905円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	866,584円
DIAM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)	1,808,283,912円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,853,307,619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)	1,368,128,834円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,131,456,649円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,788,079,489円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	3,491,532,367円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,216,964,056円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,613,213,776円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,901,363,144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)	1,198,874,241円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,735,534,513円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(債券動的アロケーション型)(適格機関投資家限定)	729,499,704円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	276,996,912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)	5,696,248,214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)	5,703,682,008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)	5,675,072,205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)	3,074,060,900円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	67,692,542円

AMOne コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	408,623,911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)	165,802,939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)	98,585,137円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	27,819,110円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	97,096,530円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	34,365,367円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,292,404円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	25,634,272円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	113,607,560円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,573,694,564円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,297,823,276円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,367,124,045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)	109,652,594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)	174,717,361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)	2,154,260,393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)	180,476,427円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,231,460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)	2,253,630,273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)	49,059,889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)	354,407,860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)	555,070,576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)	931,766,622円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	297,667,398円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	101,646,068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)	1,479,632,235円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	841,347,658円
動的パッケージファンド<DC年金>	354,560,760円
コア資産形成ファンド	242,225,956円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	42,426,785,829円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	48,586,058,661円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	14,305,294,738円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	1,773,607,342円
計	481,096,291,502円
2. 受益権の総数	481,096,291,502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 2021年2月26日 至 2022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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>
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	2022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	321,069,050
地方債証券	5,574,143
特殊債券	14,729,003
社債券	9,304,560
合計	339,528,470

(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(2022年2月15日から2022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)

2022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)	1.2867円 (12,867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

2022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 2 3 回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,002,280,000	
	4 2 4 回 利付国庫債券(2年)	3,100,000,000	3,102,511,000	
	4 2 5 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,001,620,000	
	4 2 6 回 利付国庫債券(2年)	2,100,000,000	2,101,680,000	
	4 2 7 回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,402,040,000	
	4 2 8 回 利付国庫債券(2年)	2,800,000,000	2,802,296,000	
	4 2 9 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,001,740,000	
	4 3 0 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,001,660,000	
	4 3 1 回 利付国庫債券(2年)	4,000,000,000	4,003,160,000	
	4 3 2 回 利付国庫債券(2年)	3,400,000,000	3,402,482,000	
	1 3 6 回 利付国庫債券(5年)	4,850,000,000	4,860,136,500	
	1 3 7 回 利付国庫債券(5年)	6,910,000,000	6,926,169,400	
	1 3 8 回 利付国庫債券(5年)	5,000,000,000	5,012,650,000	
	1 3 9 回 利付国庫債券(5年)	3,750,000,000	3,760,012,500	
	1 4 0 回 利付国庫債券(5年)	3,490,000,000	3,499,632,400	
	1 4 1 回 利付国庫債券(5年)	3,610,000,000	3,620,613,400	
	1 4 2 回 利付国庫債券(5年)	3,530,000,000	3,540,872,400	
1 4 3 回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,210,240,000		
1 4 4 回 利付国庫債券(5年)	5,400,000,000	5,417,820,000		

145回 利付国庫債券(5年)	4,350,000,000	4,364,703,000	
146回 利付国庫債券(5年)	3,900,000,000	3,914,079,000	
147回 利付国庫債券(5年)	6,800,000,000	6,798,572,000	
148回 利付国庫債券(5年)	6,100,000,000	6,097,316,000	
149回 利付国庫債券(5年)	5,200,000,000	5,196,412,000	
150回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,498,185,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	150,377,700	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	832,645,800	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	716,499,000	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	959,896,800	
5回 利付国庫債券(40年)	1,310,000,000	1,686,795,300	
6回 利付国庫債券(40年)	1,330,000,000	1,685,522,300	
7回 利付国庫債券(40年)	1,190,000,000	1,450,276,800	
8回 利付国庫債券(40年)	1,310,000,000	1,492,063,800	
9回 利付国庫債券(40年)	2,250,000,000	1,914,345,000	
10回 利付国庫債券(40年)	2,120,000,000	2,108,742,800	
11回 利付国庫債券(40年)	1,480,000,000	1,426,113,200	
12回 利付国庫債券(40年)	1,700,000,000	1,476,161,000	
13回 利付国庫債券(40年)	2,030,000,000	1,755,036,500	
14回 利付国庫債券(40年)	1,900,000,000	1,757,177,000	
329回 利付国庫債券(10年)	8,150,000,000	8,241,606,000	
330回 利付国庫債券(10年)	3,860,000,000	3,910,874,800	
331回 利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	1,969,617,000	
332回 利付国庫債券(10年)	5,280,000,000	5,340,614,400	
333回 利付国庫債券(10年)	5,630,000,000	5,702,289,200	
334回 利付国庫債券(10年)	6,340,000,000	6,430,662,000	
335回 利付国庫債券(10年)	6,400,000,000	6,484,352,000	
336回 利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,130,072,000	
337回 利付国庫債券(10年)	3,010,000,000	3,036,187,000	
338回 利付国庫債券(10年)	6,030,000,000	6,104,591,100	

339回 利付国庫債券(10年)	6,510,000,000	6,594,955,500	
340回 利付国庫債券(10年)	5,910,000,000	5,993,035,500	
341回 利付国庫債券(10年)	6,420,000,000	6,492,096,600	
342回 利付国庫債券(10年)	5,980,000,000	6,000,571,200	
343回 利付国庫債券(10年)	6,550,000,000	6,573,907,500	
344回 利付国庫債券(10年)	5,790,000,000	5,811,075,600	
345回 利付国庫債券(10年)	5,190,000,000	5,208,684,000	
346回 利付国庫債券(10年)	4,740,000,000	4,756,732,200	
347回 利付国庫債券(10年)	5,030,000,000	5,047,303,200	
348回 利付国庫債券(10年)	4,990,000,000	5,006,566,800	
349回 利付国庫債券(10年)	4,430,000,000	4,444,087,400	
350回 利付国庫債券(10年)	7,110,000,000	7,131,401,100	
351回 利付国庫債券(10年)	5,100,000,000	5,114,382,000	
352回 利付国庫債券(10年)	5,540,000,000	5,554,459,400	
353回 利付国庫債券(10年)	4,810,000,000	4,821,399,700	
354回 利付国庫債券(10年)	5,060,000,000	5,070,626,000	
355回 利付国庫債券(10年)	5,010,000,000	5,015,410,800	
356回 利付国庫債券(10年)	4,740,000,000	4,741,753,800	
357回 利付国庫債券(10年)	4,890,000,000	4,888,092,900	
358回 利付国庫債券(10年)	4,850,000,000	4,846,120,000	
359回 利付国庫債券(10年)	5,660,000,000	5,648,340,400	
360回 利付国庫債券(10年)	5,340,000,000	5,324,140,200	
361回 利付国庫債券(10年)	5,100,000,000	5,077,815,000	
362回 利付国庫債券(10年)	4,750,000,000	4,722,450,000	
363回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,764,816,000	

364回 利付国庫債券(10年)	5,200,000,000	5,153,616,000	
365回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,583,840,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	132,331,100	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	118,204,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,692,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	242,324,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	232,762,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	289,382,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	277,177,600	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	179,386,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	423,558,400	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	327,888,600	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	303,350,400	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	338,887,800	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	497,996,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	349,420,400	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	421,294,500	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	388,343,200	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	371,777,100	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	449,767,500	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	347,765,400	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	416,489,700	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	792,694,800	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	804,809,600	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	1,002,593,900	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,109,881,600	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,125,379,200	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	910,951,200	

32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,247,769,200	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,460,745,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,530,924,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,816,196,200	
36回 利付国庫債券(30年)	2,070,000,000	2,581,828,200	
37回 利付国庫債券(30年)	2,260,000,000	2,782,399,000	
38回 利付国庫債券(30年)	1,550,000,000	1,881,855,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	2,124,354,800	
40回 利付国庫債券(30年)	1,440,000,000	1,751,472,000	
41回 利付国庫債券(30年)	1,580,000,000	1,891,449,600	
42回 利付国庫債券(30年)	1,320,000,000	1,579,723,200	
43回 利付国庫債券(30年)	1,420,000,000	1,700,535,200	
44回 利付国庫債券(30年)	1,730,000,000	2,073,093,600	
45回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	2,164,225,800	
46回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,933,292,200	
47回 利付国庫債券(30年)	1,810,000,000	2,134,261,500	
48回 利付国庫債券(30年)	1,640,000,000	1,862,744,800	
49回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,658,399,400	
50回 利付国庫債券(30年)	1,660,000,000	1,666,723,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,350,000,000	1,205,280,000	
52回 利付国庫債券(30年)	1,510,000,000	1,411,215,800	
53回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,433,445,000	
54回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,448,477,500	
55回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,516,792,800	
56回 利付国庫債券(30年)	1,630,000,000	1,623,105,100	

57回 利付国庫債券(30年)	1,700,000,000	1,690,956,000	
58回 利付国庫債券(30年)	2,070,000,000	2,054,495,700	
59回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,470,980,000	
60回 利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,144,712,600	
61回 利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	1,097,865,600	
62回 利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	976,877,900	
63回 利付国庫債券(30年)	1,160,000,000	1,027,226,400	
64回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,042,801,400	
65回 利付国庫債券(30年)	1,210,000,000	1,067,123,200	
66回 利付国庫債券(30年)	1,090,000,000	959,319,900	
67回 利付国庫債券(30年)	1,950,000,000	1,809,853,500	
68回 利付国庫債券(30年)	1,740,000,000	1,614,058,800	
69回 利付国庫債券(30年)	1,850,000,000	1,761,311,000	
70回 利付国庫債券(30年)	1,820,000,000	1,730,183,000	
71回 利付国庫債券(30年)	1,600,000,000	1,520,496,000	
72回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,423,305,000	
73回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	569,118,000	
64回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	30,910,200	
65回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	62,100,600	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,978,500	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,786,000	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,044,400	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	484,904,400	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	401,397,800	
74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,364,800	

75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	191,547,000	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	74,062,800	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,443,600	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	265,617,500	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,289,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	96,218,100	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	428,316,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	150,409,000	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	75,569,200	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	182,877,500	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	639,849,100	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	131,110,800	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	130,624,800	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	648,020,600	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,940,400	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	516,666,300	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	121,422,400	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,275,280,800	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	406,785,400	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	739,994,900	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	615,983,500	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	133,125,600	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	739,068,000	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	178,280,000	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	839,280,000	

100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	937,999,600	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	262,706,000	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	573,870,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	182,632,000	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	124,176,800	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	725,529,600	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	570,090,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	682,992,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	776,084,400	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	395,101,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	502,876,000	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	530,840,000	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	848,587,600	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,346,553,000	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	947,059,000	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	418,572,000	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	618,684,900	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,240,493,800	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	640,814,100	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	534,939,900	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	751,552,400	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	908,357,800	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	650,575,200	
123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,229,056,500	
124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	697,098,000	

125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	709,560,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	594,017,400	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	624,137,400	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,587,145,000	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	873,490,800	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,048,529,300	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	902,835,700	
132回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	950,673,700	
133回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,189,670,600	
134回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	925,704,000	
135回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	734,259,200	
136回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	750,703,800	
137回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	919,320,000	
138回 利付国庫債券(20年)	940,000,000	1,061,260,000	
139回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,047,953,600	
140回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,637,003,700	
141回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,823,019,800	
142回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,746,510,000	
143回 利付国庫債券(20年)	2,280,000,000	2,609,710,800	
144回 利付国庫債券(20年)	1,310,000,000	1,485,343,500	
145回 利付国庫債券(20年)	3,150,000,000	3,646,219,500	
146回 利付国庫債券(20年)	3,080,000,000	3,571,660,400	
147回 利付国庫債券(20年)	3,150,000,000	3,621,114,000	
148回 利付国庫債券(20年)	3,110,000,000	3,542,103,400	
149回 利付国庫債券(20年)	3,270,000,000	3,729,075,300	

150回 利付国庫債券(20年)	3,440,000,000	3,883,863,200	
151回 利付国庫債券(20年)	3,360,000,000	3,712,363,200	
152回 利付国庫債券(20年)	3,140,000,000	3,468,852,200	
153回 利付国庫債券(20年)	2,620,000,000	2,929,002,800	
154回 利付国庫債券(20年)	2,690,000,000	2,972,503,800	
155回 利付国庫債券(20年)	3,160,000,000	3,408,091,600	
156回 利付国庫債券(20年)	2,550,000,000	2,539,851,000	
157回 利付国庫債券(20年)	2,430,000,000	2,348,327,700	
158回 利付国庫債券(20年)	2,690,000,000	2,706,516,600	
159回 利付国庫債券(20年)	2,880,000,000	2,933,856,000	
160回 利付国庫債券(20年)	2,610,000,000	2,692,502,100	
161回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,325,861,400	
162回 利付国庫債券(20年)	2,720,000,000	2,757,264,000	
163回 利付国庫債券(20年)	2,070,000,000	2,095,709,400	
164回 利付国庫債券(20年)	2,680,000,000	2,666,117,600	
165回 利付国庫債券(20年)	2,310,000,000	2,292,698,100	
166回 利付国庫債券(20年)	1,830,000,000	1,870,223,400	
167回 利付国庫債券(20年)	1,970,000,000	1,947,345,000	
168回 利付国庫債券(20年)	1,680,000,000	1,630,524,000	
169回 利付国庫債券(20年)	1,950,000,000	1,855,366,500	
170回 利付国庫債券(20年)	2,120,000,000	2,012,558,400	
171回 利付国庫債券(20年)	2,440,000,000	2,311,070,400	
172回 利付国庫債券(20年)	2,210,000,000	2,125,865,300	
173回 利付国庫債券(20年)	2,320,000,000	2,226,921,600	
174回 利付国庫債券(20年)	2,490,000,000	2,384,922,000	

	175回 利付国庫債券(20年)	2,430,000,000	2,364,924,600	
	176回 利付国庫債券(20年)	2,180,000,000	2,117,368,600	
	177回 利付国庫債券(20年)	2,300,000,000	2,190,083,000	
	178回 利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,034,732,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	774,184,000	
国債証券 合計		508,945,000,000	527,095,182,400	
地方債証券	719回 東京都公募公債	200,000,000	201,784,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	303,351,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	405,120,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,863,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	110,515,900	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	197,758,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	397,644,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	298,284,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	240,892,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	124,789,000	
	1回 東京都公募公債 20年	100,000,000	101,999,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	106,311,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,489,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	220,430,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	330,834,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	114,350,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	115,369,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,999,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	400,536,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	99,029,000	
	29回1号 宮城県公募公債 10年	100,000,000	101,089,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	247,880,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	303,615,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,494,000	
	237回 神奈川県公募公債	200,000,000	199,660,000	
	251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	199,090,000	
3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	129,729,000		
11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	113,878,000		

16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	348,309,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	115,029,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	303,909,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,748,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,441,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	196,886,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	198,186,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	197,318,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	196,628,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	228,648,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	109,495,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	100,068,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	354,231,500	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	109,756,387	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	397,748,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	199,446,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	202,488,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	197,882,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	99,281,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	128,558,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	214,020,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	307,443,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	321,573,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	106,081,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	103,071,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	197,906,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	99,208,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	198,044,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	106,922,000	

4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	107,411,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	210,092,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	107,540,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	342,264,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	347,922,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	125,877,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	303,153,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	173,640,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	101,558,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	199,296,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	100,644,000	
令和2年7回 広島県公募公債	200,000,000	199,446,000	
27年度2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	96,915,000	
令和2年2回 広島県公募公債	100,000,000	96,289,000	
25年度8回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,240,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	405,572,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	198,946,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	203,570,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	115,748,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	113,617,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	340,575,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	109,104,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	202,678,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	100,771,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	200,606,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	197,814,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	99,154,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	106,856,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	112,751,000	
21年度2回 福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,015,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	340,482,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	202,454,000	
25年度6回 千葉県公募公債	100,000,000	101,225,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,121,000	

令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	196,910,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	108,485,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	108,790,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	98,556,000	
25年度2回 新潟県公募公債	100,000,000	101,294,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	198,922,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	113,372,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,190,000	
127回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,089,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,324,000	
132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,307,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,355,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,160,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	609,756,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,475,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,561,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,074,400	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,998,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,445,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,055,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,557,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,120,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,337,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,599,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,167,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	100,167,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	101,318,000	
25年度2回 島根県公募公債	106,000,000	107,197,800	

令和元年度1回 島根県公募公債	200,000,000	189,362,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	198,198,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	101,289,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,841,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	200,164,000	
令和2年 2回 大阪市公募公債	300,000,000	298,017,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	227,662,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	456,381,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	197,938,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	113,246,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	109,615,000	
5回 京都市公募公債 30年 定時償還	200,000,000	189,880,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	111,097,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	232,954,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	229,062,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	101,364,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	302,028,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	187,996,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	404,792,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	395,776,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	125,806,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	112,886,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	113,367,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	125,219,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	202,050,000	
26年度4回 札幌市公募公債 10年	100,000,000	101,168,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	301,119,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	200,454,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	229,130,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	125,227,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	112,540,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	113,250,000	

	22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	127,533,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	202,450,000	
	2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	94,078,000	
	26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	101,150,000	
	29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	201,436,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	301,695,000	
	30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	101,725,000	
	17回 さいたま市公募公債	200,000,000	198,614,000	
	令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	198,198,000	
	26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	101,241,000	
	26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	101,160,000	
	30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	199,788,000	
地方債証券 合計		30,445,330,000	31,528,978,987	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	214,016,000	
	12回 新関西国際空港社債	200,000,000	212,536,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	301,911,000	
	127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,893,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	93,079,000	
	19回 政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,716,000	
	33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,637,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	210,639,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	261,044,000	
	75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,445,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	101,076,000	
	124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,898,000	
	139回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,153,000	
	155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,186,000	
	159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,172,000	
	162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	121,819,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	106,394,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	192,910,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	100,399,000	
	97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,988,000	
	116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	119,176,000	

121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	568,325,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,775,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,523,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	503,250,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,020,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	435,684,600	
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,241,100	
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,305,000	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,457,000	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,914,000	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	327,360,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,410,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,692,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,400,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	223,482,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,322,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,270,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	802,056,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,268,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,225,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	181,564,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	184,382,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	186,804,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	637,470,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	225,544,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	344,844,000	

2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	345,594,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	116,439,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	319,956,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	229,656,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	113,654,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	227,956,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,940,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	506,390,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	549,685,560	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	113,399,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,924,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,124,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	220,768,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	336,477,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	400,248,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,119,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	101,306,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,340,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,317,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,618,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	228,330,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,876,400	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	107,704,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	106,429,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	210,990,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	186,554,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	110,130,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,281,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	228,834,000	

61回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,715,000	
75回	住宅金融支援機構債券	350,000,000	406,675,500	
80回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,859,000	
115回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,865,000	
124回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,433,000	
148回	住宅金融支援機構債券	250,000,000	305,387,500	
159回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,943,000	
172回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,624,000	
187回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,061,000	
222回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,362,000	
230回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,776,000	
233回	住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,283,000	
321回	住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,295,000	
325回	住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,295,000	
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,607,000	29,668,878	
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,706,000	20,908,711	
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,623,000	31,936,067	
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,411,000	33,993,353	
40回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,096,000	51,415,027	
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,209,000	11,415,133	
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,795,000	54,769,765	
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,226,000	32,612,389	
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,085,000	53,633,898	
4回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,979,000	11,152,687	
27回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,671,000	19,671,952	
29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	112,585,000	119,550,633	
36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,976,000	182,775,706	

3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,221,000	25,400,320	
4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,048,000	22,036,203	
5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,107,000	26,216,980	
5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,331,000	27,507,469	
6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,764,000	37,375,525	
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,552,000	83,766,830	
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,953,000	36,381,529	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,074,000	42,416,709	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,755,000	43,151,704	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,545,000	47,053,450	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,705,000	48,975,861	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,914,000	53,543,147	
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,393,000	60,564,823	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,621,000	63,299,556	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	228,276,000	227,002,219	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,473,000	77,578,363	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,103,000	77,298,841	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,191,000	77,327,628	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	241,122,000	240,970,093	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	241,002,000	240,691,107	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,316,000	163,093,890	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,409,000	244,655,594	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,211,000	244,536,669	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	424,330,000	424,987,710	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,346,000	84,410,946	

142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	87,002,000	86,227,682	
154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	276,159,000	272,994,217	
156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	369,132,000	366,127,265	
160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	283,044,000	281,079,674	
168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	290,907,000	289,426,283	
170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	881,010,000	873,354,023	
21回 沖縄振興開発金融公庫 債券	100,000,000	101,856,000	
い第828号 利付商工債	100,000,000	100,067,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	99,930,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	299,190,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	298,944,000	
い第855号 利付商工債	200,000,000	199,284,000	
342回 利附信金中金債(5 年)	100,000,000	100,068,000	
369回 利附信金中金債(5 年)	400,000,000	399,648,000	
377回 利附信金中金債(5 年)	300,000,000	299,436,000	
7回 広島県・広島市折半保証 広島高速道路債券	100,000,000	101,028,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	113,990,000	
18回 国際協力機構債券	100,000,000	101,108,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,840,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	299,391,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,670,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	504,340,000	
71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,305,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	104,518,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	198,370,000	
特殊債券 合計	27,751,985,000	28,905,227,169	
社債券			
25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 017)	300,000,000	300,339,000	
26回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 018)	100,000,000	100,227,000	
2回 BPCE SA円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	99,979,000	
6回 クレディ・アグリコル・ エス・エー円貨社債	200,000,000	202,612,000	

11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(20 16)	100,000,000	99,466,000	
25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,859,000	
27回 首都高速道路社債	400,000,000	399,388,000	
16回 成田国際空港社債	100,000,000	101,305,000	
37回 成田国際空港社債	100,000,000	94,248,000	
57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,978,000	
67回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,884,000	
79回 東日本高速道路社債	300,000,000	299,160,000	
83回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,440,000	
56回 中日本高速道路社債	100,000,000	101,295,000	
90回 中日本高速道路債券	200,000,000	199,428,000	
91回 中日本高速道路債券	500,000,000	498,070,000	
25回 西日本高速道路社債	200,000,000	202,464,000	
26回 西日本高速道路社債	100,000,000	101,656,000	
33回 西日本高速道路債券	300,000,000	302,073,000	
34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,026,000	
62回 西日本高速道路債券	500,000,000	498,070,000	
24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	198,908,000	
10回 キリンホールディング ス社債	100,000,000	101,203,000	
9回 野村不動産ホールディン グス社債	100,000,000	99,622,000	
12回 セブン&アイ・ホール ディングス社債	100,000,000	101,892,000	
14回 セブン&アイ・ホール ディングス社債	200,000,000	199,712,000	
30回 東レ社債	300,000,000	300,132,000	
42回 王子ホールディングス 社債	200,000,000	198,800,000	
49回 住友化学社債	100,000,000	101,550,000	
23回 三菱ケミカルホール ディングス社債	200,000,000	202,458,000	
40回 三菱ケミカルホール ディングス社債	100,000,000	99,412,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	300,879,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	493,975,000	
4回 住友三井オートサービス 社債	100,000,000	99,747,000	
6回 JXホールディングス社 債	100,000,000	101,369,000	
14回 プリヂストン社債	300,000,000	300,183,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	297,984,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	100,790,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	99,468,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	198,466,000	
29回 三菱重工業社債	100,000,000	101,082,000	
5回 三井住友トラスト・パナ ソニックファイナンス社債	100,000,000	100,155,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	201,864,000	

16回	トヨタ自動車社債	200,000,000	202,178,000	
26回	トヨタ自動車社債	200,000,000	199,152,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	100,646,000	
73回	三井物産社債	400,000,000	398,120,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	101,126,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	101,475,000	
12回	新生銀行社債	400,000,000	398,652,000	
13回	新生銀行社債	200,000,000	199,276,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	110,793,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,189,000	
20回	三井住友信託銀行社債	300,000,000	299,223,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,208,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	100,721,000	
11回	セブン銀行社債	200,000,000	202,136,000	
28回	芙蓉総合リース社債	300,000,000	298,107,000	
17回	NTTファイナンス社債	300,000,000	300,210,000	
18回	NTTファイナンス社債	400,000,000	400,008,000	
69回	ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,155,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,832,000	
96回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,568,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	201,624,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	197,520,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	297,831,000	
23回	三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	99,818,000	
29回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,730,000	
31回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,706,000	
56回	三菱UFJリース社債	300,000,000	301,767,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	105,274,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	100,382,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	200,348,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	106,163,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	97,683,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	318,276,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	213,406,000	
65回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	114,135,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,262,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	230,412,000	
107回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	109,034,000	
125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,000,000	

127回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,630,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,594,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	92,472,000	
163回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,969,000	
165回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	193,204,000	
171回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	187,954,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,012,000	
21回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,557,000	
60回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	198,834,000	
70回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	93,370,000	
71回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	92,603,000	
74回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,064,000	
75回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	192,572,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	206,738,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,189,000	
32回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,085,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	131,102,400	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	90,673,000	
12回	ソフトバンク社債	400,000,000	396,388,000	
30回	光通信社債	200,000,000	200,972,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	101,194,000	
532回	中部電力社債	200,000,000	197,460,000	
497回	関西電力社債	100,000,000	102,489,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	302,283,000	
530回	関西電力社債	400,000,000	399,140,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	193,582,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	297,240,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	405,888,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	202,052,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	99,603,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	101,102,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	103,425,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	102,916,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	407,168,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	100,022,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	401,184,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	198,884,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	202,258,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	203,664,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	406,944,000	
428回	九州電力社債	100,000,000	101,741,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	100,041,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	98,828,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	296,820,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	96,212,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	198,530,000	
321回	北海道電力社債	261,000,000	265,771,080	
340回	北海道電力社債	300,000,000	302,127,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	198,810,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	211,866,000	

38回	電源開発社債	300,000,000	304,350,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	100,126,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	198,034,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	303,405,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	197,954,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	95,765,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	92,134,000	
27回	NTTデータ社債	200,000,000	202,074,000	
5回	ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,013,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,122,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	200,674,000	
社債券 合計		27,481,000,000	27,635,641,480	
合計			615,165,030,036	

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)

2022年2月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	479,124,516
コール・ローン	361,733,653
国債証券	139,998,578,004
未収利息	792,240,144
前払費用	38,737,902
流動資産合計	141,670,414,219
資産合計	141,670,414,219
負債の部	
流動負債	
未払解約金	21,160,000
流動負債合計	21,160,000
負債合計	21,160,000
純資産の部	
元本等	
元本	70,478,534,058
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,170,720,161
元本等合計	141,649,254,219
純資産合計	141,649,254,219
負債純資産合計	141,670,414,219

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月26日 至 2022年2月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p>
2. 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</p> <p>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	2022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	68,826,099,673円
同期中追加設定元本額	27,255,255,250円
同期中一部解約元本額	25,602,820,865円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,940,657,475円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	10,339,634円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	40,206,625円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	119,309,694円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	57,288,539円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	34,587,798円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	22,681,845円
たわらノーロード 先進国債券	13,411,433,376円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,768,467円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,697,389,145円
たわらノーロード バランス（堅実型）	48,297,970円
たわらノーロード バランス（標準型）	234,951,241円
たわらノーロード バランス（積極型）	48,864,225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）	6,510,378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）	330,184,293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）	382,425,252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）	74,350,919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）	364,777円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,078,910円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	26,299,286円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,149,968円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,999,545円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,295,919,835円
One DC 先進国債券インデックスファンド	579,327,806円
Oneグローバルバランス	7,550,748円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	711,700,267円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	2,226,508,317円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,403,942,419円

DIAM DC バランス30インデックスファンド	398,655,077円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	833,078,883円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	708,824,350円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,028,565円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	469,729,710円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,691,463円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	139,147,601円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	124,156,154円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	214,713,670円
クルーズコントロール	314,234,233円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	340,795,660円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	412,429,256円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	180,716,406円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	87,774,390円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770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)	515,001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)	358,315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)	100,794,148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)	418,167円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	546,045円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	30,957,907円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	461,773,967円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	294,771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)	5,739,805,045円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,636,543,183円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,562,805,722円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,405,633,352円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,529,486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)	645,235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)	421,372,128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)	250,634,953円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	17,641,800円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	41,091,423円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,714,858円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	681,339円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	16,339,671円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	48,304,162円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,983,849,370円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,578,600,509円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,769,411,536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)	117,153,727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)	155,311,687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)	1,839,867,070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)	419,588,655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)	3,247,697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)	357,842,695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)	352,697,590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)	477,953,064円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	57,398,790円
計	70,478,534,058円
2. 受益権の総数	70,478,534,058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 2021年2月26日 至 2022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。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022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	2022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		171,748,066
合計		171,748,066

（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（2022年2月22日から2022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）

2022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）	2.0098円 (20,098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

2022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	5,000,000.000	4,871,484.350	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,000,000.000	3,891,875.000	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,959,863.270	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,574,250.000	
		US T N/B 0.125 07/31/23	2,640,000.000	2,595,243.720	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,964,218.740	
		US T N/B 0.125 08/31/23	530,000.000	520,228.120	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,961,562.500	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,000,000.000	1,951,562.500	
		US T N/B 0.25 03/15/24	4,810,000.000	4,682,610.130	
		US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	1,979,101.560	
		US T N/B 0.25 05/15/24	2,000,000.000	1,941,093.740	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,252,262.090	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,763,031.230	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,663,056.250	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,850,468.750	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	948,515.620	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	947,031.250	
		US T N/B 0.25 09/30/23	2,500,000.000	2,454,882.800	

US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,836,640.610	
US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,887,968.740	
US T N/B 0.375 01/31/26	1,500,000.000	1,416,328.120	
US T N/B 0.375 04/15/24	5,000,000.000	4,872,656.250	
US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,914,296.880	
US T N/B 0.375 07/31/27	3,500,000.000	3,227,109.370	
US T N/B 0.375 08/15/24	3,500,000.000	3,392,402.330	
US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,935,468.740	
US T N/B 0.375 09/30/27	1,050,000.000	965,548.820	
US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,453,417.950	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,838,281.250	
US T N/B 0.5 02/28/26	2,500,000.000	2,369,335.920	
US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	1,987,212.960	
US T N/B 0.5 03/31/25	1,300,000.000	1,251,351.550	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,865,937.500	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,397,578.120	
US T N/B 0.5 06/30/27	1,540,000.000	1,432,801.550	
US T N/B 0.5 08/31/27	4,340,000.000	4,026,028.120	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,775,000.000	
US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,692,281.250	
US T N/B 0.625 05/15/30	4,220,000.000	3,797,670.330	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,200,000.000	3,031,499.990	
US T N/B 0.625 08/15/30	5,920,000.000	5,310,424.990	
US T N/B 0.625 10/15/24	3,500,000.000	3,405,117.170	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,000,000.000	1,859,453.120	
US T N/B 0.625 12/31/27	2,430,000.000	2,257,906.640	
US T N/B 0.75 01/31/28	3,390,000.000	3,168,987.860	
US T N/B 0.75 03/31/26	2,570,000.000	2,457,964.060	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,000,000.000	2,866,406.250	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,000,000.000	2,863,359.360	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,000,000.000	3,809,062.480	
US T N/B 0.75 11/15/24	1,490,000.000	1,452,458.970	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,173,721.070	
US T N/B 0.875 09/30/26	2,370,000.000	2,267,423.430	
US T N/B 0.875 11/15/30	6,000,000.000	5,482,968.710	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,000,000.000	2,828,906.250	
US T N/B 1.0 12/15/24	3,710,000.000	3,638,408.570	
US T N/B 1.125 02/15/31	6,860,000.000	6,390,518.740	
US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	982,148.430	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,061,457.030	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,020,000.000	2,886,223.420	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,710,351.540	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,500,000.000	2,837,597.620	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,000,000.000	2,848,710.930	
US T N/B 1.125 10/31/26	2,000,000.000	1,932,968.740	
US T N/B 1.25 03/31/28	2,910,000.000	2,796,896.470	
US T N/B 1.25 04/30/28	3,170,000.000	3,045,924.200	
US T N/B 1.25 05/15/50	3,780,000.000	2,931,271.870	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,000,000.000	3,837,656.240	

US T N/B 1.25 06/30/28	3,000,000.000	2,876,132.790	
US T N/B 1.25 08/15/31	7,160,000.000	6,711,940.570	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,415,409.360	
US T N/B 1.25 09/30/28	3,000,000.000	2,870,156.250	
US T N/B 1.25 11/30/26	2,000,000.000	1,944,218.740	
US T N/B 1.25 12/31/26	1,390,000.000	1,350,254.680	
US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,247,584.350	
US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,013,125.000	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,463,514.040	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,040,000.000	3,234,051.530	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,077,484.370	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,499,531.250	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,000,000.000	3,856,093.720	
US T N/B 1.375 11/15/31	3,520,000.000	3,331,624.980	
US T N/B 1.375 11/15/40	2,810,000.000	2,377,962.500	
US T N/B 1.375 12/31/28	1,500,000.000	1,444,980.460	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,449,051.150	
US T N/B 1.5 02/15/30	2,970,000.000	2,874,403.120	
US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,004,218.750	
US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,007,500.000	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,041,960.140	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,189,429.680	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	1,989,062.500	
US T N/B 1.5 11/30/28	2,000,000.000	1,942,890.620	
US T N/B 1.625 02/15/26	2,180,000.000	2,161,435.920	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,015,937.500	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,061,755.450	
US T N/B 1.625 05/15/31	6,740,000.000	6,546,225.000	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,912,687.500	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,380,000.000	3,308,439.040	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	1,881,000.000	
US T N/B 1.625 10/31/23	4,500,000.000	4,513,359.370	
US T N/B 1.625 10/31/26	1,350,000.000	1,336,183.580	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,400,000.000	3,749,625.000	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,791,334.370	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,013,459.370	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,634,942.170	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,343,664.050	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,700,378.120	
US T N/B 1.75 08/15/41	3,570,000.000	3,206,306.250	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,940,000.000	1,915,750.000	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,601,750.000	
US T N/B 1.75 12/31/26	1,740,000.000	1,732,251.550	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,110,000.000	3,784,089.800	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,770,000.000	4,320,203.860	
US T N/B 1.875 06/30/26	1,450,000.000	1,451,132.810	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,372,592.180	
US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	824,548.430	
US T N/B 1.875 11/15/51	3,700,000.000	3,356,160.130	

US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,409,944.500	
US T N/B 2.0 02/15/25	4,300,000.000	4,332,921.870	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,270,000.000	3,047,742.170	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,812,110.130	
US T N/B 2.0 08/15/25	2,680,000.000	2,696,959.360	
US T N/B 2.0 08/15/51	3,690,000.000	3,442,366.370	
US T N/B 2.0 11/15/26	2,140,000.000	2,152,539.050	
US T N/B 2.0 11/15/41	1,770,000.000	1,659,858.960	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,315,640.620	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,127,493.720	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,320,000.000	3,355,534.350	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,072,101.560	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	2,962,962.500	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	2,022,187.500	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	354,949.210	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,614,066.380	
US T N/B 2.25 03/31/26	2,260,000.000	2,294,959.370	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,345,890.620	
US T N/B 2.25 05/15/41	3,890,000.000	3,800,955.440	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,530,000.000	2,578,425.760	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,710,000.000	1,654,425.000	
US T N/B 2.25 08/15/49	1,490,000.000	1,463,808.580	
US T N/B 2.25 10/31/24	2,000,000.000	2,029,531.240	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	4,759,800.370	
US T N/B 2.25 11/15/25	4,690,000.000	4,760,350.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,330,546.070	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	3,045,234.360	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,796,300.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,700,000.000	4,815,847.610	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	2,892,214.430	
US T N/B 2.375 05/15/51	4,300,000.000	4,365,171.870	
US T N/B 2.375 08/15/24	3,920,000.000	3,988,600.000	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	2,798,782.000	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	3,962,329.680	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,101,124.990	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,793,922.640	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,613,351.560	
US T N/B 2.5 03/31/23	3,020,000.000	3,063,176.540	
US T N/B 2.5 05/15/24	4,240,000.000	4,323,143.720	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,810,000.000	1,833,685.470	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,402,730.440	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,244,207.800	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,292,862.840	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,800,000.000	1,827,843.750	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,206,521.470	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,852,134.370	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,121,678.120	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,357,447.640	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,445,934.340	

US T N/B 2.75 02/15/28	2,370,000.000	2,481,278.880	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,708,957.010	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,535,714.830	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,330,035.130	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	814,440.620	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,335,910.930	
US T N/B 2.75 08/15/42	430,000.000	453,784.370	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,012,481.240	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,213,739.060	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,691,378.110	
US T N/B 2.75 11/15/23	5,520,000.000	5,641,612.500	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,220,000.000	1,286,718.740	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,140,000.000	2,289,800.000	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	4,674,688.250	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,900,000.000	2,041,460.920	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	3,424,589.050	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,616,178.120	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	1,925,971.870	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,730,000.000	3,940,978.120	
US T N/B 2.875 08/15/45	740,000.000	799,084.370	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	859,556.250	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,774,466.380	
US T N/B 2.875 11/15/46	920,000.000	999,493.740	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,640,000.000	1,822,962.490	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	2,854,721.860	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,476,295.300	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,077,004.680	
US T N/B 3.0 05/15/45	500,000.000	550,507.810	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,290,000.000	1,437,442.960	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,710,000.000	3,052,349.180	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,468,272.640	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	1,999,500.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,790,000.000	1,967,881.250	
US T N/B 3.0 11/15/45	650,000.000	718,046.870	
US T N/B 3.125 02/15/42	680,000.000	760,909.370	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,607,737.490	
US T N/B 3.125 05/15/48	1,630,000.000	1,876,155.450	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	1,960,546.870	
US T N/B 3.125 11/15/28	3,670,000.000	3,941,379.280	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	849,121.870	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,530,000.000	1,779,939.820	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,660,000.000	3,208,001.530	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,062,421.870	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,963,640.620	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,170,000.000	1,406,559.370	
US T N/B 3.75 08/15/41	710,000.000	863,426.550	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,665,468.740	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,367,728.120	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,045,279.680	

	US T N/B 4.25 11/15/40	510,000.000	658,099.210	
	US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	716,460.930	
	US T N/B 4.375 05/15/40	800,000.000	1,049,937.490	
	US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,366,056.240	
	US T N/B 4.375 11/15/39	910,000.000	1,191,815.620	
	US T N/B 4.5 02/15/36	630,000.000	821,559.370	
	US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	713,264.050	
	US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,049,403.900	
	US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,011,035.140	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,645,781.240	
	US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	689,375.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,028,101.560	
	US T N/B 5.375 02/15/31	700,000.000	898,625.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	975,843.750	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,107,421.870	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	943,024.210	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,071,796.870	
アメリカ・ドル	小計	584,890,000.000 (67,595,737,300)	582,106,782.080 (67,274,080,801)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	800,000.000	766,320.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,487,609.400	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,762,110.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	500,000.000	467,584.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,600,000.000	1,433,520.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,130,000.000	1,083,589.990	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	600,000.000	551,772.240	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	400,000.000	377,819.200	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	970,000.000	702,154.380	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	750,000.000	735,986.400	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	800,000.000	704,142.560	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	360,000.000	282,965.760	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	960,000.000	954,694.080	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	760,000.000	647,672.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	450,000.000	420,688.800	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	880,517.820	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,470,000.000	1,463,203.890	

UK TREASURY 1.125 01/31/39	390,000.000	360,122.100	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	700,000.000	700,665.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	390,000.000	359,275.800	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,040,000.000	970,369.920	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	800,000.000	809,872.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,030,000.000	1,007,185.500	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	952,155.560	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	540,000.000	551,004.980	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	500,000.000	552,704.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	528,408.960	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,210,000.000	1,291,950.880	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,140,000.000	1,158,103.200	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	810,950.800	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	980,000.000	995,001.840	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,329,379.800	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	497,792.250	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	910,000.000	1,181,005.280	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,080,000.000	1,465,492.600	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,648,492.800	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	870,000.000	1,328,693.580	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	770,000.000	1,339,547.440	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	890,000.000	1,185,827.100	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,010,000.000	1,277,336.900	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	720,000.000	1,009,807.200	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	909,631.320	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	860,000.000	1,224,640.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,000,000.000	1,533,976.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	850,000.000	1,357,110.510	

	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,750,801.440	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	860,000.000	1,145,571.600	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	980,000.000	1,476,085.800	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	870,000.000	1,114,496.100	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,287,548.410	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,310,000.000	1,455,619.600	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	560,000.000	731,571.680	
イギリス・ポンド 小計		45,350,000.000 (7,013,831,000)	52,020,548.470 (8,045,498,026)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,350,000.000	1,275,610.950	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,000,000.000	887,722.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,064,550.600	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,687,785.830	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,160,000.000	1,211,542.280	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,100,000.000	2,222,362.800	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,390,000.000	1,627,909.620	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,320,000.000	2,414,020.320	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,300,000.000	1,899,822.600	
イスラエル・シュケル 小計		15,260,000.000 (543,104,926)	16,291,327.000 (579,809,957)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	940,000.000	909,280.210	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,371,802.350	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	310,000.000	291,617.600	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,439,930.330	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,560,000.000	1,420,236.290	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	990,000.000	908,171.550	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,300,000.000	1,231,214.710	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	930,000.000	738,699.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	900,000.000	863,754.880	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	800,000.000	808,320.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,550,000.000	1,598,075.100	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,480,000.000	1,529,423.560	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	758,255.500	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	557,950.450	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,695,363.000	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,160,000.000	1,213,795.230		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,260,000.000	1,313,298.000		

	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	760,000.000	805,527.800	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	190,000.000	199,492.970	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,000,000.000	1,080,632.800	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	684,328.780	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	892,032.590	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,810,000.000	1,986,971.120	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	880,000.000	1,082,714.070	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,120,000.000	1,181,473.440	
オーストラリア・ドル 小計		26,270,000.000 (2,169,113,900)	26,562,361.330 (2,193,254,175)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	5,000,000.000	5,016,984.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	15,000,000.000	15,075,150.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,000,000.000	5,906,235.540	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	17,000,000.000	17,097,070.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	3,000,000.000	3,023,087.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	14,500,000.000	14,610,272.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,000,000.000	3,098,577.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	4,950,000.000	5,097,609.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	1,100,000.000	1,158,955.710	
オフショア・人民元 小計		69,550,000.000 (1,271,923,445)	70,083,941.450 (1,281,688,113)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	500,000.000	495,466.000	
	CANADA 0.25 03/01/26	1,300,000.000	1,227,509.400	
	CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,460,653.500	
	CANADA 0.25 05/01/23	1,000,000.000	987,854.000	
	CANADA 0.25 08/01/23	700,000.000	688,910.600	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,550,000.000	1,487,690.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	610,359.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,500,000.000	1,333,779.000	
	CANADA 0.75 02/01/24	200,000.000	197,097.400	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	674,330.300	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,070,000.000	1,035,937.620	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	692,164.900	
	CANADA 1.25 03/01/27	400,000.000	389,857.200	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,728,350.900	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,212,536.160	
	CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	694,655.500	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,970,000.000	1,900,829.360	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	439,017.920	
CANADA 1.5 12/01/31	600,000.000	576,024.000		

	CANADA 1.75 03/01/23	460,000.000	462,247.100	
	CANADA 1.75 12/01/53	710,000.000	632,387.060	
	CANADA 2.0 06/01/28	420,000.000	425,975.340	
	CANADA 2.0 09/01/23	880,000.000	888,026.480	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,430,000.000	2,324,460.240	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	537,584.830	
	CANADA 2.25 06/01/25	900,000.000	917,631.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	629,032.610	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,550,000.000	1,582,367.100	
	CANADA 2.75 12/01/48	580,000.000	642,553.580	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	395,332.700	
	CANADA 3.5 12/01/45	610,000.000	752,929.100	
	CANADA 4.0 06/01/41	540,000.000	689,658.300	
	CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	531,493.170	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,268,024.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	520,000.000	712,752.560	
カナダ・ドル 小計		30,950,000.000 (2,791,999,500)	31,225,477.930 (2,816,850,364)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	200,000.000	192,680.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	200,000.000	195,644.700	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	200,000.000	201,540.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	440,000.000	413,600.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	50,000.000	47,476.500	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	284,307.800	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	420,000.000	428,610.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	489,674.400	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	350,064.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	186,840.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	380,000.000	397,860.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	466,200.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	418,843.600	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	715,680.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	470,000.000	501,866.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	398,046.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	572,220.000	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	280,000.000	318,360.000		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	791,320.000		
シンガポール・ドル 小計		7,070,000.000 (603,565,900)	7,370,833.000 (629,248,013)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,150,000.000	2,069,275.680	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,840,000.000	1,868,768.400	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	3,225,316.500	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	3,250,000.000	3,336,515.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	4,700,000.000	4,820,542.780	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,700,000.000	3,152,425.500	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,980,000.000	8,543,763.060	
SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,739,854.200		

スウェーデン・クローナ 小計		29,060,000.000 (353,950,800)	31,756,461.120 (386,793,696)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	3,300,000.000	3,156,312.060	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,020,000.000	1,845,128.600	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,246,147.700	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,370,000.000	4,432,403.600	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,661,262.040	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,580,000.000	12,651,838.640	
デンマーク・クローネ 小計		29,720,000.000 (517,128,000)	34,993,092.640 (608,879,812)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,100,000.000	1,021,845.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,530,612.850	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,703,218.220	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,900,000.000	1,878,367.360	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,782,607.400	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,750,000.000	2,693,157.500	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,064,514.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,813,802.400	
	NORWAY 3.0 03/14/24	5,800,000.000	5,947,900.000	
ノルウェー・クローネ 小計		26,720,000.000 (344,955,200)	26,436,025.230 (341,289,086)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,400,000.000	1,181,684.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	2,680,000.000	2,429,456.680	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,900,000.000	2,331,165.700	
	POLAND 2.25 10/25/24	1,000,000.000	959,791.680	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,225,832.080	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,180,000.000	2,047,336.910	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,250,000.000	2,080,496.050	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,910,000.000	2,708,046.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	192,045.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,321,323.090	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,740,000.000	2,747,672.000	
POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,596,456.000		
ポーランド・ズロチ 小計		24,380,000.000 (681,828,146)	22,821,305.190 (638,236,596)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	917,162.970	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	1,017,093.100	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,239,776.810	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,015,362.400	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,700,000.000	1,670,026.400	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,207,135.410	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	819,202.800	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	800,000.000	818,030.960	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	500,000.000	513,096.600	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,700,000.000	2,784,157.380	

	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,506,067.740	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,206,681.610	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,898,658.360	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	535,094.100	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,400,000.000	1,498,003.080	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,700,000.000	2,889,259.740	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,153,880.400	
マレーシア・リングgit 小計		26,830,000.000 (738,385,747)	27,688,689.860 (762,017,665)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	8,000,000.000	7,952,160.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,085,000.000	5,979,534.380	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	19,796,000.000	20,879,302.440	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	22,143,000.000	20,607,864.110	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	17,835,763.820	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	17,000,000.000	16,874,965.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	11,643,000.000	11,216,866.200	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	6,000,000.000	5,916,900.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	18,000,000.000	18,091,260.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	12,654,000.000	12,463,576.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,064,174.600	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	17,758,962.350	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	13,125,000.000	13,670,682.370	
	メキシコ・ペソ 小計		182,626,000.000 (1,026,303,332)	183,312,011.270 (1,030,158,510)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	690,000.000	665,611.950	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	530,000.000	505,347.960	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	201,214.000	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	70,000.000	70,193.060	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	190,000.000	185,758.250	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	300,000.000	255,090.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	140,000.000	128,716.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	770,000.000	777,643.790	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	650,000.000	663,206.050	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	250,000.000	204,496.750	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	775,000.000	798,957.570	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	290,000.000	275,854.960	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	480,000.000	495,372.000	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	250,000.000	185,819.060	

AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	654,342.000	
AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	805,535.200	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	669,769.600	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	430,000.000	491,426.360	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	166,515.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	450,000.000	473,122.570	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	780,000.000	808,185.300	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	473,181.100	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	680,000.000	821,176.840	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	470,000.000	696,618.020	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	399,261.450	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,330,550.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	740,000.000	889,214.340	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	892,406.500	
BELGIUM 0.0 10/22/27	510,000.000	504,422.640	
BELGIUM 0.0 10/22/31	770,000.000	727,204.940	
BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	777,760.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	667,194.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	430,000.000	387,188.340	
BELGIUM 0.5 10/22/24	670,000.000	683,464.650	
BELGIUM 0.65 06/22/71	330,000.000	244,091.530	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,174,678.800	
BELGIUM 0.8 06/22/27	840,000.000	868,400.400	
BELGIUM 0.8 06/22/28	670,000.000	693,517.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,050,000.000	1,092,812.700	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,110,000.000	1,155,786.390	
BELGIUM 1.0 06/22/31	930,000.000	970,661.460	
BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	759,844.840	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	474,865.600	
BELGIUM 1.6 06/22/47	670,000.000	737,215.740	
BELGIUM 1.7 06/22/50	670,000.000	751,634.140	
BELGIUM 1.9 06/22/38	520,000.000	599,595.360	
BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	537,894.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	860,627.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	350,000.000	447,429.850	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,020,000.000	1,089,016.260	
BELGIUM 3.0 06/22/34	590,000.000	747,366.570	
BELGIUM 3.75 06/22/45	520,000.000	807,307.800	
BELGIUM 4.0 03/28/32	730,000.000	977,523.290	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,110,000.000	1,735,502.760	
BELGIUM 4.5 03/28/26	430,000.000	509,674.700	
BELGIUM 5.0 03/28/35	890,000.000	1,358,711.380	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,190,000.000	1,578,333.890	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,430,000.000	1,440,081.500	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,261,038.750	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,050,000.000	1,056,510.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,400,000.000	1,411,074.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	670,000.000	676,679.900	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,554,491.400	

BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,037,076.100	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,292,275.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,140,622.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,684,524.400	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,660,000.000	1,645,358.800	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,200,000.000	1,156,608.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,350,000.000	1,291,990.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	1,988,500.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	499,145.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	700,000.000	691,082.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	450,000.000	445,504.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,720,000.000	1,537,518.320	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	400,000.000	359,696.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	340,000.000	298,458.800	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,203,132.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	500,000.000	500,605.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	1,994,594.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,390,000.000	1,415,324.410	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,810,000.000	1,841,566.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,660,000.000	1,700,869.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,858,508.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,640,000.000	1,692,742.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,000,000.000	2,062,132.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,691,608.800	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,610,000.000	1,608,808.600	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,386,269.260	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,470,000.000	1,533,327.600	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,820,000.000	2,230,928.700	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	920,000.000	938,749.600	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,692,067.740	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,950,000.000	2,034,171.750	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,750,000.000	1,828,699.250	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,930,000.000	3,044,168.030	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,611,998.400	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,890,000.000	2,874,363.030	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	890,000.000	1,417,244.900	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,640,000.000	2,552,530.440	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	940,000.000	1,579,576.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,100,000.000	1,437,942.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,660,000.000	2,598,630.400	

DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,140,000.000	2,058,988.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,844,314.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,550,514.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	946,965.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,061,024.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	962,745.800	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	181,292.580	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	163,478.630	
FINLAND 0.125 04/15/36	260,000.000	239,004.740	
FINLAND 0.125 04/15/52	220,000.000	178,340.800	
FINLAND 0.125 09/15/31	240,000.000	230,975.880	
FINLAND 0.25 09/15/40	230,000.000	208,778.820	
FINLAND 0.5 04/15/26	490,000.000	499,994.530	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	509,789.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	100,000.000	101,346.900	
FINLAND 0.5 09/15/29	370,000.000	374,029.670	
FINLAND 0.75 04/15/31	250,000.000	256,223.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	330,000.000	341,393.040	
FINLAND 09/15/23	280,000.000	282,207.800	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	306,674.130	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	319,894.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	470,000.000	480,988.600	
FINLAND 2.0 04/15/24	260,000.000	273,293.020	
FINLAND 2.625 07/04/42	250,000.000	340,275.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	420,000.000	487,773.300	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	490,251.170	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,138,294.200	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	900,000.000	905,157.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,150,000.000	1,158,002.850	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,460,000.000	2,457,783.540	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	900,000.000	892,539.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,550,000.000	2,468,614.200	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,800,000.000	2,678,023.600	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	2,330,000.000	2,198,117.340	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,150,000.000	2,164,019.720	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,490,000.000	2,540,397.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,770,000.000	2,822,434.710	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,220,000.000	2,243,012.520	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,270,000.000	1,175,475.170	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	600,000.000	418,611.600	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	740,000.000	663,959.080	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,270,000.000	3,368,544.720	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,890,000.000	1,686,664.350	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	650,000.000	572,461.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,420,000.000	2,490,931.650	

FRANCE OAT 03/25/23	2,200,000.000	2,214,157.000	
FRANCE OAT 03/25/24	2,520,000.000	2,536,383.770	
FRANCE OAT 03/25/25	2,970,000.000	2,980,620.720	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,460,000.000	2,566,882.080	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,304,167.080	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,540,000.000	2,685,691.860	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,590,000.000	2,732,968.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,362,664.690	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,000,000.000	2,179,624.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,530,000.000	2,603,111.680	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	820,000.000	950,065.940	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,690,000.000	1,938,328.600	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,380,000.000	2,509,840.900	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,047,962.280	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,093,396.580	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,240,000.000	3,789,993.240	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,840,000.000	3,255,435.200	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,600,000.000	2,333,008.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,520,000.000	2,884,644.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,260,000.000	2,231,838.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	730,000.000	1,350,223.330	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,630,000.000	2,434,431.080	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,130,000.000	3,376,165.730	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,250,000.000	3,663,954.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,550,000.000	2,332,195.100	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,475,022.260	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,100,000.000	3,219,783.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,204,148.600	
IRISH 0.0 10/18/31	660,000.000	616,179.960	
IRISH 0.2 05/15/27	560,000.000	559,709.360	
IRISH 0.2 10/18/30	450,000.000	436,417.200	
IRISH 0.4 05/15/35	350,000.000	327,409.950	
IRISH 0.55 04/22/41	220,000.000	202,140.400	
IRISH 0.9 05/15/28	390,000.000	405,665.910	
IRISH 1.0 05/15/26	640,000.000	665,644.800	
IRISH 1.1 05/15/29	520,000.000	544,735.880	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	357,749.020	
IRISH 1.35 03/18/31	270,000.000	289,174.860	
IRISH 1.5 05/15/50	420,000.000	449,531.040	
IRISH 1.7 05/15/37	390,000.000	431,751.450	
IRISH 2.0 02/18/45	600,000.000	715,805.400	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	727,341.300	
IRISH 3.4 03/18/24	320,000.000	344,365.560	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	596,648.980	
IRISH 5.4 03/13/25	710,000.000	829,584.590	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	999,800.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	990,000.000	953,568.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,000,000.000	996,000.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	600,000.000	577,620.000	

ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,080,000.000	1,020,708.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,007,260.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,077,139.080	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,400,000.000	1,387,631.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	477,400.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	506,100.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,610,000.000	1,454,527.790	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	992,182.380	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,300,000.000	1,293,435.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,000,000.000	933,890.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	932,636.560	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	900,000.000	778,860.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,084,701.800	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	240,000.000	221,016.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,111,032.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,430,000.000	1,420,991.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,180,000.000	1,096,646.710	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,230,000.000	1,251,058.830	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,110,000.000	1,096,861.480	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	900,000.000	845,190.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,379,576.900	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,069,222.960	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	590,000.000	512,474.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,460,000.000	1,505,839.620	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,135,970.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,320,000.000	1,311,987.600	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,482,649.200	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	900,000.000	776,250.900	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,240,901.040	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	770,000.000	723,492.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	838,674.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	935,190.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,430,000.000	1,500,184.400	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,018,363.230	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,040,000.000	1,094,202.720	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	680,000.000	716,995.740	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	320,000.000	279,648.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	400,000.000	378,520.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	920,000.000	974,556.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	690,000.000	714,564.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,140,000.000	1,212,989.640	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	970,000.000	984,453.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	968,172.680	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	587,326.300	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,237,876.380	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,120,000.000	1,208,032.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	611,181.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.000	1,098,890.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,045,468.000	

ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,481,601.380	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	820,000.000	939,990.600	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,169,694.900	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,010,000.000	1,175,766.250	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,244,166.420	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,779,682.520	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,210,000.000	1,314,341.930	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	570,000.000	741,981.540	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,086,454.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,390,000.000	1,513,157.190	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,874,500.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,479,745.400	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,033,000.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	2,047,768.800	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,403,659.840	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,032,920.900	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,172,051.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	1,896,713.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,390,000.000	2,005,770.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,050,000.000	2,631,790.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,792,640.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,470,000.000	2,023,455.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,328,790.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	452,900.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,370,058.900	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	920,000.000	918,327.440	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	270,000.000	266,160.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	400,000.000	367,503.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	610,000.000	513,938.420	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	750,000.000	734,048.250	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	540,000.000	524,011.680	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,280,000.000	1,297,372.160	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	792,999.630	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	630,000.000	631,354.500	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,130,000.000	1,157,233.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	1,037,817.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	980,000.000	1,019,609.640	
NETHERLANDS 01/15/24	1,310,000.000	1,320,671.260	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	450,000.000	464,708.500	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,130,000.000	1,193,174.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	980,000.000	1,200,419.640	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,140,000.000	1,743,628.860	

NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,130,000.000	1,828,963.760	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,060,000.000	1,596,572.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,120,300.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,396,150.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	800,000.000	789,048.160	
SPAIN 0.0 01/31/27	350,000.000	340,497.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	1,113,600.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	995,336.100	
SPAIN 0.0 05/31/24	860,000.000	860,354.320	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,190,000.000	1,097,775.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,240,000.000	1,247,819.060	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,420,000.000	1,432,686.280	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,850,000.000	1,798,965.900	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,100,000.000	1,040,296.950	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,180,000.000	1,162,169.020	
SPAIN 0.7 04/30/32	610,000.000	582,977.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,211,220.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	600,000.000	547,531.200	
SPAIN 1.0 07/30/42	130,000.000	116,662.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,170,000.000	962,382.330	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,080,000.000	1,011,723.480	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,370,000.000	1,403,291.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,460,000.000	1,520,153.460	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,440,000.000	1,504,531.290	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,310,000.000	1,366,002.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,226,902.950	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,500,000.000	1,570,273.320	
SPAIN 1.45 10/31/71	300,000.000	231,784.800	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,240,000.000	1,301,566.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,517,961.500	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,200,000.000	1,273,874.400	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,352,937.350	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,584,570.120	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,474,879.140	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,383,840.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	930,000.000	1,122,608.580	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,653,803.070	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,060,000.000	1,320,739.750	
SPAIN 3.45 07/30/66	920,000.000	1,255,018.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,190,000.000	1,290,334.850	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,100,000.000	1,522,536.400	
SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,195,983.930	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,575,143.800	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,250,000.000	1,918,543.750	
SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,237,067.500	
SPAIN 4.9 07/30/40	970,000.000	1,500,105.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	1,030,000.000	1,326,382.500	
SPAIN 5.15 10/31/44	910,000.000	1,524,502.980	

	SPAIN 5.4 01/31/23	1,160,000.000	1,223,272.310	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	1,781,422.040	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,370,000.000	1,702,381.180	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,149,151.860	
	ユーロ 小計	372,215,000.000 (48,172,065,300)	412,693,348.710 (53,410,773,190)	
国債証券 合計		133,823,892,496.200 (133,823,892,496)	139,998,578,004 (139,998,578,004)	
合計			139,998,578,004 (139,998,578,004)	

(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 232銘柄	47.49	48.05
イギリス・ポンド	国債証券 52銘柄	5.68	5.75
イスラエル・シケル	国債証券 9銘柄	0.41	0.41
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.55	1.57
オフショア・人民元	国債証券 9銘柄	0.90	0.92
カナダ・ドル	国債証券 35銘柄	1.99	2.01
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.27	0.28
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.43	0.43
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.24	0.24
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.45	0.46
マレーシア・リングgit	国債証券 17銘柄	0.54	0.54
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.73	0.74
ユーロ	国債証券 340銘柄	37.71	38.15

(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

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> 1 安定型
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期中間計算期間(2022年2月26日から2022年8月25日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 2022年2月25日現在	第20期中間計算期間末 2022年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	575,069,039	613,751,772
親投資信託受益証券	17,163,528,953	17,983,371,627
未収入金	40,585,000	455,000
流動資産合計	17,779,182,992	18,597,578,399
資産合計	17,779,182,992	18,597,578,399
負債の部		
流動負債		
未払解約金	58,362,378	30,058,392
未払受託者報酬	2,949,926	2,958,242
未払委託者報酬	22,616,411	22,680,148
その他未払費用	349,969	350,952
流動負債合計	84,278,684	56,047,734
負債合計	84,278,684	56,047,734
純資産の部		
元本等		
元本	10,206,817,945	10,536,134,655
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	7,488,086,363	8,005,396,010
(分配準備積立金)	1,606,932,137	1,520,330,672
元本等合計	17,694,904,308	18,541,530,665
純資産合計	17,694,904,308	18,541,530,665
負債純資産合計	17,779,182,992	18,597,578,399

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期中間計算期間 自 2021年2月26日 至 2021年8月25日	第20期中間計算期間 自 2022年2月26日 至 2022年8月25日
営業収益		
受取利息	243	2,215
有価証券売買等損益	370,442,336	296,874,674
営業収益合計	370,442,579	296,876,889
営業費用		
支払利息	61,425	54,144
受託者報酬	2,739,864	2,958,242
委託者報酬	21,005,921	22,680,148
その他費用	325,048	350,952
営業費用合計	24,132,258	26,043,486
営業利益又は営業損失()	346,310,321	270,833,403
経常利益又は経常損失()	346,310,321	270,833,403
中間純利益又は中間純損失()	346,310,321	270,833,403
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	14,932,566	6,150,467
期首剰余金又は期首欠損金()	6,799,335,375	7,488,086,363
剰余金増加額又は欠損金減少額	844,268,486	673,123,854
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	844,268,486	673,123,854
剰余金減少額又は欠損金増加額	463,893,055	420,497,143
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	463,893,055	420,497,143
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	7,511,088,561	8,005,396,010

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第20期中間計算期間	
	自	至
	2022年2月26日	2022年8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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第19期	第20期中間計算期間末
	2022年2月25日現在	2022年8月25日現在
1. 期首元本額	9,306,233,072円	10,206,817,945円
期中追加設定元本額	2,220,967,739円	902,167,307円
期中一部解約元本額	1,320,382,866円	572,850,597円
2. 受益権の総数	10,206,817,945口	10,536,134,655口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第19期	第20期中間計算期間末
	2022年2月25日現在	2022年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第19期 2022年2月25日現在	第20期中間計算期間末 2022年8月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7336円 (17,336円)	1.7598円 (17,598円)

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 2022年2月25日現在	第20期中間計算期間末 2022年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,196,254,900	1,271,832,950
親投資信託受益証券	35,799,789,823	38,229,925,949
未収入金	5,858,000	15,102,000
流動資産合計	37,001,902,723	39,516,860,899
資産合計	37,001,902,723	39,516,860,899
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,646,103	43,352,795
未払受託者報酬	6,189,516	6,247,026
未払委託者報酬	53,642,777	54,141,230
その他未払費用	564,561	564,770
流動負債合計	93,042,957	104,305,821
負債合計	93,042,957	104,305,821
純資産の部		
元本等		
元本	16,810,432,066	17,350,609,226
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	20,098,427,700	22,061,945,852
(分配準備積立金)	7,067,176,512	6,771,648,053
元本等合計	36,908,859,766	39,412,555,078
純資産合計	36,908,859,766	39,412,555,078
負債純資産合計	37,001,902,723	39,516,860,899

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期中間計算期間 自 2021年2月26日 至 2021年8月25日	第20期中間計算期間 自 2022年2月26日 至 2022年8月25日
営業収益		
受取利息	509	4,747
有価証券売買等損益	1,214,770,171	1,355,259,126
営業収益合計	1,214,770,680	1,355,263,873
営業費用		
支払利息	126,985	114,325
受託者報酬	5,709,328	6,247,026
委託者報酬	49,481,180	54,141,230
その他費用	532,852	564,770
営業費用合計	55,850,345	61,067,351
営業利益又は営業損失()	1,158,920,335	1,294,196,522
経常利益又は経常損失()	1,158,920,335	1,294,196,522
中間純利益又は中間純損失()	1,158,920,335	1,294,196,522
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	33,141,209	25,185,471
期首剰余金又は期首欠損金()	17,964,983,532	20,098,427,700
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,751,475,357	1,567,976,012
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,751,475,357	1,567,976,012
剰余金減少額又は欠損金増加額	856,642,062	873,468,911
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	856,642,062	873,468,911
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	19,985,595,953	22,061,945,852

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第20期中間計算期間	
	自	至
	2022年2月26日	2022年8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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第19期	第20期中間計算期間末
	2022年2月25日現在	2022年8月25日現在
1. 期首元本額	15,437,389,171円	16,810,432,066円
期中追加設定元本額	2,931,027,984円	1,270,015,186円
期中一部解約元本額	1,557,985,089円	729,838,026円
2. 受益権の総数	16,810,432,066口	17,350,609,226口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第19期	第20期中間計算期間末
	2022年2月25日現在	2022年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第19期 2022年2月25日現在	第20期中間計算期間末 2022年8月25日現在
1口当たり純資産額	2,1956円	2,2715円
(1万口当たり純資産額)	(21,956円)	(22,715円)

【DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 2022年2月25日現在	第20期中間計算期間末 2022年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	982,856,485	1,069,533,402
親投資信託受益証券	28,862,511,470	31,550,521,551
未収入金	2,032,000	765,000
流動資産合計	29,847,399,955	32,620,819,953
資産合計		
29,847,399,955		
32,620,819,953		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	35,596,647	37,436,208
未払受託者報酬	5,013,973	5,088,443
未払委託者報酬	48,468,742	49,188,640
その他未払費用	494,811	496,029
流動負債合計	89,574,173	92,209,320
負債合計		
89,574,173		
92,209,320		
純資産の部		
元本等		
元本	11,065,901,730	11,477,565,480
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	18,691,924,052	21,051,045,153
(分配準備積立金)	6,333,530,443	6,025,462,442
元本等合計	29,757,825,782	32,528,610,633
純資産合計		
29,757,825,782		
32,528,610,633		
負債純資産合計		
29,847,399,955		
32,620,819,953		

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期中間計算期間 自 2021年2月26日 至 2021年8月25日	第20期中間計算期間 自 2022年2月26日 至 2022年8月25日
営業収益		
受取利息	410	3,898
有価証券売買等損益	1,271,706,851	1,682,994,081
営業収益合計	1,271,707,261	1,682,997,979
営業費用		
支払利息	102,495	94,130
受託者報酬	4,516,462	5,088,443
委託者報酬	43,659,508	49,188,640
その他費用	462,080	496,029
営業費用合計	48,740,545	54,867,242
営業利益又は営業損失()	1,222,966,716	1,628,130,737
経常利益又は経常損失()	1,222,966,716	1,628,130,737
中間純利益又は中間純損失()	1,222,966,716	1,628,130,737
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	46,823,253	37,751,683
期首剰余金又は期首欠損金()	16,233,903,351	18,691,924,052
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,919,780,012	1,716,506,847
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,919,780,012	1,716,506,847
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,063,748,225	947,764,800
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,063,748,225	947,764,800
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	18,266,078,601	21,051,045,153

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第20期中間計算期間	
	自	至
	2022年2月26日	2022年8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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第19期	第20期中間計算期間末
	2022年2月25日現在	2022年8月25日現在
1. 期首元本額	10,022,091,306円	11,065,901,730円
期中追加設定元本額	2,436,219,650円	971,918,235円
期中一部解約元本額	1,392,409,226円	560,254,485円
2. 受益権の総数	11,065,901,730口	11,477,565,480口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第19期	第20期中間計算期間末
	2022年2月25日現在	2022年8月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第19期 2022年2月25日現在	第20期中間計算期間末 2022年8月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6891円 (26,891円)	2.8341円 (28,341円)

(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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年8月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,413,504,815
株式	448,824,280,410
派生商品評価勘定	31,181,950
未収入金	6,549,820
未収配当金	519,142,234
前払金	66,515,000
差入委託証拠金	366,240,000
流動資産合計	458,227,414,229
資産合計	458,227,414,229
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,078,240
未払解約金	664,653,000
流動負債合計	723,731,240
負債合計	723,731,240
純資産の部	
元本等	
元本	137,787,728,091
剰余金	
剰余金又は欠損金()	319,715,954,898
元本等合計	457,503,682,989
純資産合計	457,503,682,989
負債純資産合計	458,227,414,229

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月26日 至 2022年8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	2022年8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	122,380,637,954円
同期中追加設定元本額	88,433,815,096円
同期中一部解約元本額	73,026,724,959円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,646,816,366円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	4,893,871,191円
One DC 国内株式インデックスファンド	22,270,492,456円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,839,917,533円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,435,386円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	23,895,330円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	85,177,339円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,164,496円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,287,194円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	24,616,410円
たわらノーロード TOPIX	1,490,581,305円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,301,644,938円
たわらノーロード バランス(堅実型)	46,489,674円
たわらノーロード バランス(標準型)	306,023,106円
たわらノーロード バランス(積極型)	487,460,218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)	5,204,081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)	180,929,841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)	436,141,195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)	301,440,145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)	429,936,746円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	653,906円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,764,601円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	41,676,090円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,415,165円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	16,553,066円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,659,121,403円
Oneグローバルバランス	5,364,486円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,068,671,350円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,611,268,355円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,944,456,889円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	345,279,983円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,104,466,551円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,136,767,672円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	32,407,197円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,130,856,960円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	309,475,685円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	354,479,856円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	573,691,359円
投資のソムリエ	22,306,481,584円
クルーズコントロール	524,512,323円
投資のソムリエ<DC年金>	1,462,846,164円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	357,736,982円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	772,092,450円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,553,794,615円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,557,180,151円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	54,527,034円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	27,248,860円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	10,313,044円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	204,857,675円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	459,989,731円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	928,480,351円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	269,358,743円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	69,620,788円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	27,877,582円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	17,906,841円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	274,761,036円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,330,303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)	33,580,994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)	34,396,016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)	20,158,524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)	21,036,102円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	32,952,527円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	72,064,478円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	37,641,768円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	133,747,900円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	62,250,221円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	43,553,877円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	29,880,324円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	43,370,374円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)	62,414,122円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	87,201,528円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	556,410,393円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	8,148,387円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	32,495,259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)	114,954,532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)	56,861,129円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	25,834,677円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	19,229,467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)	50,583,270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)	97,377,127円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,147,586円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,245,293円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,434,489円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	655,741円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,919,767円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,036,832円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	493,015,680円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	580,542,232円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,685,746,963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)	18,406,471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)	25,595,656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)	260,631,057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)	65,468,840円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	490,635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)	308,473,649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)	18,605,620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)	64,167,223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)	146,218,378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)	214,598,905円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	33,664,250円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	16,492,220円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	260,091,271円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	922,255,638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)	1,220,307,862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)	48,743,066円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	18,753,917円
コア資産形成ファンド	12,284,405円
M H A Mトピックスファンド	754,104,485円
M H A M T O P I XファンドV A (適格機関投資家専用)	59,785,256円
M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	2,471,336,439円
M H A M日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,718,211,597円
計	137,787,728,091円
2. 受益権の総数	137,787,728,091口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年8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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2022年8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	8,192,770,000	-	8,165,010,000	27,760,000
合計	8,192,770,000	-	8,165,010,000	27,760,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。
 - 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年8月25日現在
1口当たり純資産額	3.3204円
(1万口当たり純資産額)	(33,204円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年8月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	14,369,884,125
コール・ローン	571,575,938
株式	746,041,989,603
投資信託受益証券	1,290,721,263
投資証券	17,465,711,332
派生商品評価勘定	716,131,946
未収入金	3,947,893
未収配当金	1,188,097,345
差入委託証拠金	5,277,783,019
流動資産合計	786,925,842,464
資産合計	
786,925,842,464	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	119,660,170
未払解約金	241,016,000
流動負債合計	360,676,170
負債合計	
360,676,170	
純資産の部	
元本等	
元本	126,534,098,689
剰余金	
剰余金又は欠損金()	660,031,067,605
元本等合計	786,565,166,294
純資産合計	786,565,166,294
負債純資産合計	786,925,842,464

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月26日 至 2022年8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礎となる事項	<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	2022年8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	110,324,823,154円
同期中追加設定元本額	42,956,209,691円
同期中一部解約元本額	26,746,934,156円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,371,095,761円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,574,535円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	15,712,980円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	68,684,482円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,016,589円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	11,359,948円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	19,872,078円
たわらノーロード 先進国株式	35,766,119,656円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	433,270,786円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,750,625,469円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	700,938,168円
たわらノーロード バランス(堅実型)	74,463,522円
たわらノーロード バランス(標準型)	627,451,335円
たわらノーロード バランス(積極型)	786,693,375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)	474,408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)	138,451,034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)	411,706,890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)	330,385,270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)	492,386,593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)	1,195,435円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	24,252,732円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,742,915円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,618,025円
たわらノーロード 全世界株式	384,332,790円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	53,832,656,137円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,524,924,973円
Oneグローバルバランス	2,837,061円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	150,881,650円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	782,916,760円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,020,304,742円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	92,457,449円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	254,626,334円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	243,756,930円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,659,398円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	614,803,235円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	124,424,959円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	166,896,166円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	189,303,958円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	303,643,440円
投資のソムリエ	4,839,890,597円
クルーズコントロール	143,511,312円
投資のソムリエ<DC年金>	317,448,124円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	189,127,899円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	194,731,396円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	269,466,760円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,310,196,265円
ワールドアセットバランス(基本コース)	162,956,717円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	135,960,336円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	15,461,260円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,641,220円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,768,695円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	34,688,522円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	122,992,998円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	161,816,448円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	143,244,707円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	12,717,607円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,872,276円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,106,308円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	73,304,931円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	936,702円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,080,114円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,203,616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)	719,029円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,054,128円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	126,341円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,447,832円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	961,920円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	2,027,331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)	431,052,098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)	40,584,659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)	1,172,323,882円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,533,267円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,082,938,024円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	120,705,282円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	1,102,339円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	7,505,287円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,911,209円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	5,623,001円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	3,390,317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)	27,291,292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)	52,587,941円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,239,785円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	20,453,685円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,466,284円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	236,051円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,736,880円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,716,930円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	177,127,656円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	274,302,288円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	909,115,905円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	50,628,657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)	42,121,453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)	282,071,617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)	11,771,857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)	1,211,779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)	111,024,730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)	10,041,525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)	34,649,996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)	52,620,510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)	115,883,151円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	7,219,794円
コア資産形成ファンド	4,785,481円
M H A M外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,526,960,010円
M H A M外国株式インデックスファンド	141,607,181円
M H A M外国株式インデックスファンド< 為替ヘッジあり > (ファンドラップ)	12,420,084円
M H A M動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	968,492,241円
M H A M外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,666,663,755円
計	126,534,098,689円
2. 受益権の総数	126,534,098,689口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年8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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年8月25日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	385,671,232	-	385,706,216	34,984
アメリカ・ドル	269,771,800	-	269,771,800	-
イギリス・ポンド	15,694,832	-	15,694,687	145

オーストラリア・ドル	14,405,838	-	14,417,741	11,903
カナダ・ドル	33,702,727	-	33,722,601	19,874
ユーロ	52,096,035	-	52,099,387	3,352
買建	200,158,152	-	200,332,227	174,075
アメリカ・ドル	158,678,690	-	158,748,230	69,540
イギリス・ポンド	10,677,018	-	10,678,859	1,841
ユーロ	30,802,444	-	30,905,138	102,694
合計	585,829,384	-	586,038,443	139,091

(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ではありません。

株式関連

種類	2022年8月25日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	20,726,455,550	-	21,322,788,235	596,332,685
合計	20,726,455,550	-	21,322,788,235	596,332,685

(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ではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年8月25日現在
1口当たり純資産額	6.2162円
(1万口当たり純資産額)	(62,162円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年8月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,564,582,944
国債証券	467,704,531,700
地方債証券	32,920,957,375
特殊債証券	30,585,151,491
社債証券	26,392,455,860
未収利息	889,504,490
前払費用	215,298,333
流動資産合計	562,272,482,193
資産合計	562,272,482,193
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,402,730,000
流動負債合計	1,402,730,000
負債合計	1,402,730,000
純資産の部	
元本等	
元本	439,890,189,634
剰余金	
剰余金又は欠損金()	120,979,562,559
元本等合計	560,869,752,193
純資産合計	560,869,752,193
負債純資産合計	562,272,482,193

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月26日 至 2022年8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	2022年8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	481,096,291,502円
同期中追加設定元本額	434,541,898,042円
同期中一部解約元本額	475,747,999,910円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	25,407,858,331円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	144,506,421円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	165,856,373円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	140,191,670円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	695,637,592円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	119,080,084円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	39,957,771円
たわらノーロード 国内債券	16,860,539,311円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,232,897,200円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,073,154,114円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,886,037,065円
たわらノーロード バランス(積極型)	243,540,820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)	120,886,323円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	1,410,403,372円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,497,832,844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)	434,723,087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)	79,477,348円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	22,551,892円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	17,311,171円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	134,949,434円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,755,414円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	959,182円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,006,685,633円
Oneグローバルバランス	13,254,053円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	9,445,556,820円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	13,161,624,145円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,525,035,330円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,300,933,793円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,403,036,202円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	408,240,119円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	99,738,983円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,477,973,652円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,441,521円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,476,685,677円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,875,500,268円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	365,592,312円
投資のソムリエ	80,607,442,550円
クルーズコントロール	1,329,639,533円
投資のソムリエ<DC年金>	5,285,788,538円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,250,726,445円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,097,582,529円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,328,051,684円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	30,780,249,355円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	231,717,772円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	116,259,510円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	42,487,156円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,043,368,202円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,072,158,901円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,027,976,145円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,213,665,380円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	320,710,289円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	118,934,350円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	75,580,766円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	878,596,671円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	14,172,281円
DIAM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)	1,955,184,956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)	2,002,989,505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)	1,515,112,654円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,223,907,947円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,933,997,843円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	5,002,180,152円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,896,863,545円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,744,771,423円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	1,944,970,047円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,132,295,665円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,249,449,034円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,342,101,887円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	583,158,520円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	272,281,971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)	4,870,266,482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)	4,881,603,781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)	4,838,160,658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)	3,316,444,550円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s 用)(適格機関投資家専用)	61,474,793円
A M O n e 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)	513,360,115円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	52,045,029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)	154,707,482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)	99,305,688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)	24,697,985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)	96,619,104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)	34,694,615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)	2,230,376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)	26,482,973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)	107,305,469円
D I A M バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,355,325,060円
D I A M バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,221,891,414円
D I A M バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,300,332,611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)	70,543,857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)	163,327,693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)	2,000,570,452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)	167,003,061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)	3,758,690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)	2,098,650,656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)	47,419,052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)	327,442,768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)	497,279,673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)	912,624,294円
D I A M 世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	282,151,791円
D I A M 国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	98,182,943円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	935,002,540円
動的パッケージファンド<DC年金>	381,434,633円
コア資産形成ファンド	251,792,075円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	45,566,401,932円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	51,241,264,455円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	13,154,778,087円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	1,782,384,254円
計	439,890,189,634円
2. 受益権の総数	439,890,189,634口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年8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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年8月25日現在
1口当たり純資産額	1,2750円
(1万口当たり純資産額)	(12,750円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年8月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,240,458,120
コール・ローン	784,718,910
国債証券	184,299,997,314
派生商品評価勘定	642,540
未収利息	882,727,120
前払費用	149,409,413
流動資産合計	189,357,953,417
資産合計	189,357,953,417
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,542
未払金	3,023,860,136
未払解約金	36,151,000
流動負債合計	3,060,015,678
負債合計	3,060,015,678
純資産の部	
元本等	
元本	89,449,850,313
剰余金	
剰余金又は欠損金()	96,848,087,426
元本等合計	186,297,937,739
純資産合計	186,297,937,739
負債純資産合計	189,357,953,417

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月26日 至 2022年8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礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年8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	70,478,534,058円
同期中追加設定元本額	42,517,445,448円
同期中一部解約元本額	23,546,129,193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	7,923,850,327円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	11,135,806円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	37,764,426円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	125,177,571円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	53,600,954円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,995,366円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	36,034,235円
たわらノーロード 先進国債券	15,129,063,943円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	232,127,957円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,053,881,578円
たわらノーロード バランス(堅実型)	55,249,106円
たわらノーロード バランス(標準型)	278,910,750円
たわらノーロード バランス(積極型)	59,362,990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)	14,689,051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)	527,074,576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)	729,490,741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)	279,064,285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)	193,876,564円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,005,433円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	6,811,111円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	78,809,503円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,474,272円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,801,035円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,437,841,961円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	669,626,031円

Oneグローバルバランス	8,560,694円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	698,112,940円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,204,461,784円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,432,663,617円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	399,028,717円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	822,896,003円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	705,395,366円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,352,119円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	500,436,036円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	36,330,259円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	141,979,694円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	143,520,539円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	219,615,314円
クルーズコントロール	1,205,971,023円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	164,408,923円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	486,488,505円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	535,554,916円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	168,767,510円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	217,033,351円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,138,219,592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)	218,863,506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)	224,674,647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)	91,907,289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)	137,410,354円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	216,626,363円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	352,625,968円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	246,284,150円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	195,570,187円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	330,326,593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)	5,231,676,627円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,610,973,444円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,559,276,411円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,287,215,268円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	89,881,835円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	49,701,595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)	371,613,140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)	371,490,590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)	238,619,322円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	14,825,245円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	38,656,980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)	8,322,055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)	334,400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)	15,896,987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)	42,927,385円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,762,313,935円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,444,868,411円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,581,299,640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)	70,698,110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)	137,616,526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)	1,615,266,438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)	372,807,475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)	1,130,626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)	314,771,191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)	298,491,902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)	438,139,389円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	51,468,108円
動的パッケージファンド<DC年金>	57,699,013円
コア資産形成ファンド	38,066,701円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	2,550,083,685円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	277,928,186円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	7,727,202,075円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,539,782,087円
計	89,449,850,313円
2. 受益権の総数	89,449,850,313口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年8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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年8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	200,000,000	-	200,004,541	4,541
アメリカ・ドル	129,414,000	-	129,413,999	1
ユーロ	70,586,000	-	70,590,542	4,542
買建	450,000,000	-	450,642,539	642,539
アメリカ・ドル	252,540,000	-	252,650,674	110,674
イギリス・ポンド	40,000,000	-	40,006,898	6,898
ユーロ	157,460,000	-	157,984,967	524,967
合計	650,000,000	-	650,647,080	637,998

（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ではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年8月25日現在
1口当たり純資産額	2.0827円
（1万口当たり純資産額）	（20,827円）

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型

2022年8月31日現在

資産総額	18,590,991,942円
負債総額	19,422,333円
純資産総額（ - ）	18,571,569,609円
発行済数量	10,572,884,989口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7565円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型

2022年8月31日現在

資産総額	39,399,354,442円
負債総額	28,155,895円
純資産総額（ - ）	39,371,198,547円
発行済数量	17,398,548,381口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2629円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型

2022年8月31日現在

資産総額	32,469,598,494円
負債総額	32,039,135円
純資産総額（ - ）	32,437,559,359円
発行済数量	11,509,938,078口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8182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

2022年8月31日現在

資産総額	455,017,963,855円
負債総額	159,796,450円
純資産総額（ - ）	454,858,167,405円
発行済数量	137,898,546,716口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2985円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年8月31日現在

資産総額	771,912,701,581円
負債総額	566,078,965円
純資産総額（ - ）	771,346,622,616円
発行済数量	126,854,091,438口
1口当たり純資産額（ / ）	6.0806円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年8月31日現在

資産総額	628,103,566,080円
負債総額	15,287,235,000円
純資産総額（ - ）	612,816,331,080円
発行済数量	480,745,270,942口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2747円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年8月31日現在

資産総額	188,289,781,949円
負債総額	1,763,000円
純資産総額(-)	188,288,018,949円
発行済数量	89,597,757,765口
1口当たり純資産額(/)	2.1015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(2022年8月31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(2022年8月31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。

2022年8月31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	1,465,585,877,674
追加型株式投資信託	809	14,673,904,917,819
単位型公社債投資信託	25	50,448,515,623
単位型株式投資信託	220	1,067,180,543,090
合計	1,080	17,257,119,854,206

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の財務諸表及び中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第37期事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	36,734	31,421
金銭の信託	25,670	30,332
未収委託者報酬	16,804	17,567
未収運用受託報酬	5,814	4,348
未収投資助言報酬	317	309
未収収益	7	5
前払費用	724	1,167
その他	2,419	2,673
流動資産計	88,493	87,826
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 915	1 1,109
器具備品	1 202	1 158
建設仮勘定	0	-
無形固定資産		
ソフトウェア	2,878	3,107
ソフトウェア仮勘定	1,109	1,449
電話加入権	3	3
投資その他の資産		
投資有価証券	261	241
関係会社株式	5,299	5,349
長期差入保証金	1,324	1,102
繰延税金資産	3,676	3,092
その他	591	367
固定資産計	16,264	15,983
資産合計	104,757	103,810

(単位:百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

(単位:百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		1	559
時効成立分配金・償還金	0		0	
為替差益	7		7	
金銭の信託運用益	1,229		-	
雑収入	13		19	
時効後支払損引当金戻入額	13		10	
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0		-	
金銭の信託運用損	-		743	
早期割増退職金	48		20	
雑損失	0		-	
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	-		0	
特別利益計		-		0
特別損失				
固定資産除却損	1		5	
投資有価証券売却損	-		6	
ゴルフ会員権売却損	-		3	
オフィス再編費用	-		2	509
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,871	49,674	71,227
当期変動額									
剰余金の配当							12,000	12,000	12,000
当期純利益							14,125	14,125	14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125	2,125	2,125
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	0	0	73,353

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 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		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	4,219
当期末残高	0	0	77,573

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 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</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。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</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 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 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 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。 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。 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 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. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 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。

（会計上の見積りの変更）

第37期

（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社は、当事業年度において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万円減少しております。

（会計方針の変更）

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分法相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
建物	407	415
器具備品	978	966

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
受取配当金	-	543

2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17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
2022年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種 類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っているデリバティブ取引は後述するリスクを低減する目的で行っております。当該デリバティブ取引は、実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引(為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引)を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。

投資有価証券は、主にその他有価証券(投資信託)、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

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おります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	25,670	25,670	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,672	25,672	-

第37期(2022年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	36,734	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	85,024	1	-	-

第37期(2022年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第36期(2021年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
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	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
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	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額239百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
投資信託	0	-	0

（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。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	-	6

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を採用しております。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	4	14
退職給付の支払額	245	185
過去勤務費用の発生額	1	-
その他	1	-
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	84	35
未認識過去勤務費用	102	33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	7	3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.76%	1.00% ~ 3.76%

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100百万円、当事業年度97百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第36期	第37期
	(2021年3月31日現在)	(2022年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額(一括償却資産)	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額(税法上)	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	3,676	3,092
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,676	3,092

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	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224百万円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b. 負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(4) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

(2) 損益計算書項目

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,823百万円	8,429百万円
経常利益	8,823百万円	8,429百万円
税引前当期純利益	8,823百万円	8,429百万円
当期純利益	7,288百万円	7,015百万円
1株当たり当期純利益	182,220円85銭	175,380円68銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬(注)	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

(注) 成功報酬は、損益計算書において委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)及び第37期(自 2021年4月1日 至 2022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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435	未払 手数料	1,457
	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	12,767	未払 手数料	2,524

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	7,789	未払 手数料	1,592
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,373	未払 手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
 (東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36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36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社（以下「PPAM」といいます。）の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

(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

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2022年3月末日現在）
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2022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

2022年5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 正彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37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2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R 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

2022年4月1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 長谷川 敬
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2021年2月26日から2022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2022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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) X B R 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

2022年4月1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 長谷川 敬

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2021年2月26日から2022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2022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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) X B R 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

2022年4月1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 長谷川 敬
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2021年2月26日から2022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2022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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年10月28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 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の2022年2月26日から2022年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型の2022年8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中間計算期間（2022年2月26日から2022年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年10月28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 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2022年2月26日から2022年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型の2022年8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中間計算期間（2022年2月26日から2022年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年10月28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 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の2022年2月26日から2022年8月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型の2022年8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中間計算期間（2022年2月26日から2022年8月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。