

【表紙】

【提出書類】

半期報告書

【提出先】

関東財務局長殿

【提出日】

2026年7月14日提出

【計算期間】

第4期中（自 2025年10月15日 至 2026年4月14日）

【ファンド名】

Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞

Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞

【発行者名】

アセットマネジメントOne株式会社

【代表者の役職氏名】

取締役社長 杉原 規之

【本店の所在の場所】

東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【事務連絡者氏名】

積木 利浩

【連絡場所】

東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【電話番号】

03-6774-5100

【縦覧に供する場所】

該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

（1）【投資状況】

Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	172,055,198	99.47
内 日本	172,055,198	99.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	912,054	0.53
純資産総額	172,967,252	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。

Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	873,018,055	99.51
内 日本	873,018,055	99.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,322,897	0.49
純資産総額	877,340,952	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

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	817,123,930,790	97.18
内 日本	817,123,930,790	97.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	23,717,658,356	2.82
純資産総額	840,841,589,146	100.00

その他資産の投資状況

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	23,849,280,000	2.84
内 日本	23,849,280,000	2.84

（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

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	400,020,775,250	87.74
内 日本	400,020,775,250	87.74
地方債証券	22,636,421,905	4.96
内 日本	22,636,421,905	4.96
特殊債券	17,137,130,947	3.76
内 日本	17,137,130,947	3.76
社債券	14,068,643,000	3.09

	内 日本	13,773,848,000	3.02
	内 フランス	294,795,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,065,883,101	0.45
純資産総額		455,928,854,203	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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		2,550,522,492,189	96.18
	内 アメリカ	1,880,672,449,184	70.92
	内 イギリス	96,047,789,825	3.62
	内 カナダ	95,968,850,244	3.62
	内 スイス	69,504,451,860	2.62
	内 ドイツ	61,079,802,162	2.30
	内 フランス	60,923,265,191	2.30
	内 オランダ	47,713,660,743	1.80
	内 オーストラリア	43,250,354,167	1.63
	内 アイルランド	42,895,809,671	1.62
	内 スペイン	25,227,201,154	0.95
	内 スウェーデン	21,789,342,654	0.82
	内 イタリア	20,138,299,086	0.76
	内 デンマーク	11,156,979,810	0.42
	内 シンガポール	10,070,796,848	0.38
	内 香港	9,960,864,010	0.38
	内 フィンランド	8,579,472,337	0.32
	内 イスラエル	7,734,141,708	0.29
	内 ベルギー	5,913,226,041	0.22
	内 ケイマン諸島	5,458,457,385	0.21
	内 ノルウェー	4,762,105,401	0.18
	内 ジャージー	4,433,917,475	0.17
	内 ルクセンブルグ	3,805,314,162	0.14
	内 バミューダ	2,689,205,056	0.10
	内 オランダ領キュラソー	2,674,863,870	0.10
	内 オーストリア	2,269,411,735	0.09
	内 リベリア	2,070,155,354	0.08
	内 ニュージーランド	1,393,049,917	0.05
	内 ポルトガル	1,286,154,957	0.05
	内 パナマ	936,425,845	0.04
	内 マン島	116,674,337	0.00
新株予約権証券		0	0.00
	内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券		2,861,584,750	0.11
	内 オーストラリア	2,223,287,917	0.08
	内 シンガポール	638,296,833	0.02
投資証券		37,874,016,632	1.43
	内 アメリカ	35,995,448,263	1.36
	内 フランス	957,785,112	0.04
	内 イギリス	518,726,466	0.02

	内 香港	402,056,791	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		60,652,929,341	2.29
純資産総額		2,651,911,022,912	100.00

その他資産の投資状況

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	62,264,154,228	2.35
内 アメリカ	47,539,082,752	1.79
内 ドイツ	8,190,665,948	0.31
内 カナダ	3,054,782,777	0.12
内 イギリス	2,386,465,983	0.09
内 オーストラリア	1,093,156,768	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	310,875,447,943	98.10
内 アメリカ	141,824,046,709	44.75
内 中国	38,563,562,787	12.17
内 フランス	22,101,514,235	6.97
内 イタリア	20,259,165,937	6.39
内 ドイツ	17,569,063,232	5.54
内 イギリス	17,280,550,832	5.45
内 スペイン	13,331,515,287	4.21
内 カナダ	6,581,606,393	2.08
内 ベルギー	4,694,375,312	1.48
内 オーストラリア	4,160,022,910	1.31
内 オランダ	3,773,025,256	1.19
内 オーストリア	3,403,710,208	1.07
内 メキシコ	2,722,450,694	0.86
内 ポーランド	2,252,323,624	0.71
内 ポルトガル	1,872,016,981	0.59
内 フィンランド	1,605,852,292	0.51
内 マレーシア	1,578,359,603	0.50
内 イスラエル	1,378,500,978	0.43
内 アイルランド	1,344,844,415	0.42
内 シンガポール	1,148,569,665	0.36
内 ニュージーランド	982,588,065	0.31
内 韓国	754,641,236	0.24
内 デンマーク	624,008,477	0.20
内 スウェーデン	570,595,596	0.18
内 ノルウェー	498,537,219	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,021,912,940	1.90
純資産総額	316,897,360,883	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		257,885,197,642	100.10
	内 アメリカ	117,757,976,314	45.71
	内 中国	32,115,253,530	12.47
	内 フランス	18,369,895,848	7.13
	内 イタリア	16,840,357,214	6.54
	内 ドイツ	14,581,846,210	5.66
	内 イギリス	14,310,527,250	5.55
	内 スペイン	11,084,054,256	4.30
	内 カナダ	5,429,990,524	2.11
	内 ベルギー	3,949,059,513	1.53
	内 オーストラリア	3,438,016,052	1.33
	内 オランダ	3,149,626,445	1.22
	内 オーストリア	2,785,766,744	1.08
	内 メキシコ	2,257,332,242	0.88
	内 ポーランド	1,859,324,834	0.72
	内 ポルトガル	1,485,774,454	0.58
	内 マレーシア	1,330,487,977	0.52
	内 フィンランド	1,305,899,438	0.51
	内 イスラエル	1,156,463,423	0.45
	内 アイルランド	1,082,826,109	0.42
	内 シンガポール	926,515,367	0.36
	内 ニュージーランド	774,663,626	0.30
	内 韓国	514,480,008	0.20
	内 デンマーク	488,924,968	0.19
	内 スウェーデン	463,065,893	0.18
	内 ノルウェー	427,069,403	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		252,811,217	0.10
純資産総額		257,632,386,425	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2026年4月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		189,380,011,373	95.60
	内 台湾	46,732,690,734	23.59
	内 韓国	35,723,906,074	18.03
	内 ケイマン諸島	24,003,710,698	12.12
	内 インド	22,909,212,443	11.56
	内 中国	19,266,260,469	9.73
	内 ブラジル	7,262,571,762	3.67
	内 南アフリカ	5,147,951,566	2.60
	内 サウジアラビア	5,029,338,023	2.54
	内 メキシコ	2,630,327,889	1.33
	内 アラブ首長国連邦	2,330,654,752	1.18
	内 マレーシア	2,103,151,326	1.06

内 タイ	1,918,358,946	0.97
内 ポーランド	1,863,233,817	0.94
内 香港	1,448,562,698	0.73
内 インドネシア	1,400,156,123	0.71
内 クエート	1,118,659,136	0.56
内 カタール	1,025,172,230	0.52
内 チリ	910,212,737	0.46
内 トルコ	868,440,074	0.44
内 ギリシャ	851,892,664	0.43
内 イギリス	734,105,002	0.37
内 ハンガリー	660,842,638	0.33
内 バミューダ	609,254,058	0.31
内 フィリピン	576,790,279	0.29
内 アメリカ	519,054,082	0.26
内 スイス	359,249,674	0.18
内 コロンビア	266,592,610	0.13
内 ルクセンブルグ	225,238,089	0.11
内 チェコ	221,028,812	0.11
内 オランダ	178,673,264	0.09
内 ロシア	155,686,592	0.08
内 エジプト	120,853,305	0.06
内 カナダ	87,714,973	0.04
内 ペルー	78,858,559	0.04
内 シンガポール	41,605,275	0.02
内 キプロス	0	0.00
内 イギリス領バージン諸島	0	0.00
投資信託受益証券	1,010,523,123	0.51
内 メキシコ	684,846,248	0.35
内 ブラジル	325,676,875	0.16
投資証券	160,205,196	0.08
内 メキシコ	160,205,196	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,546,217,917	3.81
純資産総額	198,096,957,609	100.00

その他資産の投資状況

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,726,974,302	3.90
内 アメリカ	7,726,974,302	3.90

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	106,707,298,395	97.73
内 メキシコ	12,684,553,015	11.62
内 トルコ	11,333,140,389	10.38

内 サウジアラビア	10,946,165,644	10.03
内 ブラジル	9,720,700,593	8.90
内 ポーランド	8,346,886,887	7.64
内 ハンガリー	7,623,475,379	6.98
内 ルーマニア	7,127,907,744	6.53
内 コロンビア	6,716,170,860	6.15
内 チリ	6,548,786,572	6.00
内 南アフリカ	6,015,780,945	5.51
内 アラブ首長国連邦	5,169,937,035	4.73
内 ドミニカ共和国	4,088,754,905	3.74
内 ペルー	2,217,399,769	2.03
内 ウルグアイ	2,033,164,588	1.86
内 インドネシア	1,700,534,089	1.56
内 パナマ	1,621,623,095	1.49
内 中国	1,327,562,871	1.22
内 フィリピン	1,143,681,790	1.05
内 オマーン	341,072,225	0.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,479,572,213	2.27
純資産総額	109,186,870,608	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。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	192,975,709,200	97.34
内 日本	192,975,709,200	97.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,267,805,433	2.66
純資産総額	198,243,514,633	100.00

その他資産の投資状況

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	5,361,160,500	2.70
内 日本	5,361,160,500	2.70

（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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	13,317,500,216	9.91
内 オーストラリア	8,914,193,064	6.63
内 シンガポール	4,330,435,590	3.22
内 香港	72,871,562	0.05
投資証券	119,687,560,103	89.07
内 アメリカ	105,502,051,307	78.51
内 イギリス	4,946,465,398	3.68
内 フランス	2,876,204,426	2.14

内 カナダ	1,664,549,738	1.24
内 ベルギー	1,461,107,715	1.09
内 香港	1,161,696,116	0.86
内 スペイン	773,280,500	0.58
内 ガーンジィ	313,963,308	0.23
内 韓国	265,042,539	0.20
内 イスラエル	263,014,756	0.20
内 オランダ	216,162,703	0.16
内 ニュージーランド	142,253,020	0.11
内 アイルランド	51,975,103	0.04
内 ドイツ	29,770,981	0.02
内 イタリア	20,022,493	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,369,546,397	1.02
純資産総額	134,374,606,716	100.00

その他資産の投資状況

2026年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	1,652,450,053	1.23
内 アメリカ	1,652,450,053	1.23

（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。

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞

直近日（2026年4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1計算期間末 (2023年10月12日)	237	237	0.9895	0.9895
第2計算期間末 (2024年10月15日)	249	249	0.9890	0.9890
第3計算期間末 (2025年10月14日)	232	232	0.9520	0.9520
2025年4月末日	239	-	0.9629	-
5月末日	241	-	0.9536	-
6月末日	242	-	0.9598	-
7月末日	232	-	0.9531	-
8月末日	229	-	0.9515	-
9月末日	232	-	0.9527	-
10月末日	236	-	0.9581	-
11月末日	220	-	0.9499	-
12月末日	211	-	0.9398	-
2026年1月末日	214	-	0.9301	-
2月末日	168	-	0.9461	-
3月末日	172	-	0.9267	-

4月末日	172	-	0.9241	-
------	-----	---	--------	---

Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞

直近日（2026年4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1計算期間末 （2023年10月12日）	943	943	1.1486	1.1486
第2計算期間末 （2024年10月15日）	904	904	1.3524	1.3524
第3計算期間末 （2025年10月14日）	824	824	1.5266	1.5266
2025年4月末日	778	-	1.2885	-
5月末日	794	-	1.3471	-
6月末日	803	-	1.3860	-
7月末日	812	-	1.4432	-
8月末日	812	-	1.4675	-
9月末日	814	-	1.5066	-
10月末日	844	-	1.5775	-
11月末日	827	-	1.6086	-
12月末日	822	-	1.6222	-
2026年1月末日	821	-	1.6369	-
2月末日	892	-	1.7116	-
3月末日	823	-	1.5985	-
4月末日	877	-	1.7223	-

【分配の推移】

Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2025年10月15日～2026年4月14日	-

Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2025年10月15日～2026年4月14日	-

【収益率の推移】

Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞

	収益率（％）
第1計算期間	1.1
第2計算期間	0.1
第3計算期間	3.7
2025年10月15日～2026年4月14日	2.4

（注）収益率は期間騰落率です。

Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞

	収益率（％）
第1計算期間	14.9
第2計算期間	17.7
第3計算期間	12.9
2025年10月15日～2026年4月14日	11.4

（注）収益率は期間騰落率です。

2【設定及び解約の実績】

Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞

	設定口数	解約口数
第1計算期間	251,259,415	11,191,143
第2計算期間	50,169,745	37,692,406
第3計算期間	38,496,761	47,055,307
2025年10月15日～ 2026年4月14日	30,821,727	85,191,852

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞

	設定口数	解約口数
第1計算期間	937,507,273	116,307,094
第2計算期間	17,039,556	169,098,330
第3計算期間	7,218,687	136,462,116
2025年10月15日～ 2026年4月14日	34,643,588	63,152,257

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

3【ファンドの経理状況】

Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞

Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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4期中間計算期間（2025年10月15日から2026年4月14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

【Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,715,886	1,718,040
親投資信託受益証券	231,147,000	175,060,233
流動資産合計	232,862,886	176,778,273
資産合計	232,862,886	176,778,273
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	151,307
未払受託者報酬	32,294	28,576
未払委託者報酬	549,796	486,492
その他未払費用	4,490	3,991
流動負債合計	586,580	670,366
負債合計	586,580	670,366
純資産の部		
元本等		
元本	243,987,065	189,616,940
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	11,710,759	13,509,033
（分配準備積立金）	3,281,731	2,205,276
元本等合計	232,276,306	176,107,907
純資産合計	232,276,306	176,107,907
負債純資産合計	232,862,886	176,778,273

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2024年10月16日 至 2025年4月15日	第4期中間計算期間 自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
営業収益		
受取利息	3,104	8,161
有価証券売買等損益	7,725,025	4,098,767
営業収益合計	7,721,921	4,090,606
営業費用		
受託者報酬	33,340	28,576
委託者報酬	567,558	486,492
その他費用	4,664	3,991
営業費用合計	605,562	519,059
営業利益又は営業損失（ ）	8,327,483	4,609,665
経常利益又は経常損失（ ）	8,327,483	4,609,665
中間純利益又は中間純損失（ ）	8,327,483	4,609,665
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（ ）	278,945	484,930
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,785,398	11,710,759
剰余金増加額又は欠損金減少額	246,745	4,119,154
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	246,745	4,119,154
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	438,606	1,792,693
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	438,606	1,792,693
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	11,025,797	13,509,033

（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4期中間計算期間 自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2025年10月14日、当中間計算期間末日を2026年4月14日としております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
1. 期首元本額	252,545,611円	243,987,065円
期中追加設定元本額	38,496,761円	30,821,727円
期中一部解約元本額	47,055,307円	85,191,852円
2. 受益権の総数	243,987,065口	189,616,940口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,710,759円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は13,509,033円であります。

（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3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

（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3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9520円 (9,520円)	0.9288円 (9,288円)

【Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,392,256	7,391,601
親投資信託受益証券	818,799,171	865,495,451
未収入金	-	251,000
流動資産合計	826,191,427	873,138,052
資産合計	826,191,427	873,138,052
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,353,641
未払受託者報酬	109,828	114,660
未払委託者報酬	1,867,578	1,950,053
その他未払費用	15,556	16,237
流動負債合計	1,992,962	3,434,591
負債合計	1,992,962	3,434,591
純資産の部		
元本等		
元本	539,897,976	511,389,307
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（　）	284,300,489	358,314,154
（分配準備積立金）	266,952,323	236,368,300
元本等合計	824,198,465	869,703,461
純資産合計	824,198,465	869,703,461
負債純資産合計	826,191,427	873,138,052

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2024年10月16日 至 2025年4月15日	第4期中間計算期間 自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
営業収益		
受取利息	11,746	20,684
有価証券売買等損益	59,043,257	90,930,280
営業収益合計	59,031,511	90,950,964
営業費用		
受託者報酬	118,931	114,660
委託者報酬	2,022,449	1,950,053
その他費用	16,847	16,237
営業費用合計	2,158,227	2,080,950
営業利益又は営業損失（ ）	61,189,738	88,870,014
経常利益又は経常損失（ ）	61,189,738	88,870,014
中間純利益又は中間純損失（ ）	61,189,738	88,870,014
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（ ）	383,537	5,053,424
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	235,809,364	284,300,489
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,494,634	23,576,871
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	1,494,634	23,576,871
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,362,187	33,379,796
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,362,187	33,379,796
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（ ）	152,135,610	358,314,154

（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4期中間計算期間 自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2025年10月14日、当中間計算期間末日を2026年4月14日としております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
1. 期首元本額	669,141,405円	539,897,976円
期中追加設定元本額	7,218,687円	34,643,588円
期中一部解約元本額	136,462,116円	63,152,257円
2. 受益権の総数	539,897,976口	511,389,307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3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	--	----

（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3期 2025年10月14日現在	第4期中間計算期間末 2026年4月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5266円 (15,266円)	1.7007円 (17,007円)

（参考）

「Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞」、「Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞」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、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・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）

	2026年4月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,612,861,475
株式	816,076,587,150
派生商品評価勘定	503,147,920
未収入金	48,100,000
未収配当金	7,728,048,951
差入委託証拠金	1,537,684,026
流動資産合計	838,506,429,522
資産合計	838,506,429,522
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,728,560
前受金	236,810,100
未払解約金	513,627,000
流動負債合計	779,165,660
負債合計	779,165,660
純資産の部	
元本等	
元本	120,657,185,950
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	717,070,077,912
元本等合計	837,727,263,862
純資産合計	837,727,263,862
負債純資産合計	838,506,429,522

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14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	2026年4月14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	125,605,907,231円
同期中追加設定元本額	10,416,815,607円
同期中一部解約元本額	15,365,536,888円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,188,180,966円
たわらノーロード 国内株式＜ラップ専用＞	3,684,472,811円
One DC 国内株式インデックスファンド	39,722,369,208円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,194,003,221円
たわらノーロード TOPIX	4,651,667,846円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,322,332,127円
たわらノーロード バランス（堅実型）	39,940,623円
たわらノーロード バランス（標準型）	387,577,224円
たわらノーロード バランス（積極型）	851,426,889円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,906,993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）	145,730,274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）	473,543,244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）	439,901,827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）	640,629,709円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	467,630円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,004,679円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	35,056,657円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	14,267,581円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	23,567,138円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	21,644,184円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	124,454,151円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	69,630,788円
DIAM国内株式インデックスファンド＜DC年金＞	31,010,208,031円
One グローバルバランス	114,588,862円

未来のわたし（ターゲット・イヤー／～１９７２年生まれ向け）	714,848円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７３～１９７７年生まれ向け）	421,053円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９７８～１９８２年生まれ向け）	294,615円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８３～１９８７年生まれ向け）	371,653円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	211,704円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	232,548円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９８～２００２年生まれ向け）	231,467円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／２００３～２００７年生まれ向け）	323,585円
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞１安定型	732,291,035円
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞２安定・成長型	2,826,392,439円
DIAMバランス・ファンド＜DC年金＞３成長型	3,590,027,325円
DIAM DC バランス３０インデックスファンド	192,299,628円
DIAM DC バランス５０インデックスファンド	737,639,569円
DIAM DC バランス７０インデックスファンド	937,925,632円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	20,324,722円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	867,666,321円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,289,790円
DIAM DC ８資産バランスファンド（新興国１０）	202,694,656円
DIAM DC ８資産バランスファンド（新興国２０）	299,073,040円
DIAM DC ８資産バランスファンド（新興国３０）	548,610,798円
投資のソムリエ	2,194,788,903円
クルーズコントロール	64,300,520円
投資のソムリエ＜DC年金＞	455,090,754円
DIAM ８資産バランスファンドN＜DC年金＞	295,106,411円
４資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞	1,479,688,105円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	205,645,260円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	348,790,032円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	121,778,828円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	65,335,484円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（DC）	2,470,239円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	189,999,376円
４資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	652,567,760円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	112,352,903円
９資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	178,392,713円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	121,545,947円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	76,196,945円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	43,171,485円
４資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	882,074,475円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	18,457,653円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	814,698円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	23,987,329円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	687,261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）	10,073,471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）	1,315,695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)	3,860,164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)	3,369,998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)	20,168,849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)	75,277,592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)	1,477,871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)	97,475,930円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)	277,612,549円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	3,611,991円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2024-05(適格機関投資家限定)	280,802,191円
AMOne TOPIXインデックスファンド2025-01(適格機関投資家限定)	3,506,731,457円
AMOne TOPIXインデックスファンド2026-04(適格機関投資家限定)	72,460,987円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	30,133,636円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	12,601,697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)	2,341,575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)	1,558,980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)	13,016,172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)	43,254,498円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,607,774円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,750,069円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,061,430円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	64,324円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	116,397,351円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	241,915,485円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	791,210,782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)	5,537,878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)	8,446,761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)	54,677,314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)	12,992,333円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	38,193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)	63,572,736円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	4,913,394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)	12,902,753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)	29,380,404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)	36,165,727円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	9,089,576円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	3,675,333円

動的パッケージファンド<DC年金>	16,630,849円
コア資産形成ファンド	5,780,962円
MHAMトピックスファンド	708,292,103円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	23,624,503円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	1,575,226,755円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	2,571,298,054円
計	120,657,185,950円
2. 受益権の総数	120,657,185,950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	2026年4月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2026年4月14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	21,318,879,900	-	21,793,490,000	474,610,100
合計	21,318,879,900	-	21,793,490,000	474,610,100

（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）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額	6.9430円

（1万口当たり純資産額）	(69,430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）

2026年4月14日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,228,337,084
国債証券	395,286,748,000
地方債証券	22,707,395,900
特殊債券	18,539,738,923
社債券	14,315,896,000
未収利息	757,695,702
前払費用	89,566,425
流動資産合計	453,925,378,034
資産合計	453,925,378,034
負債の部	
流動負債	
未払解約金	43,487,000
流動負債合計	43,487,000
負債合計	43,487,000
純資産の部	
元本等	
元本	407,405,640,834
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,476,250,200
元本等合計	453,881,891,034
純資産合計	453,881,891,034
負債純資産合計	453,925,378,034

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14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	2026年4月14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	402,653,275,762円
同期中追加設定元本額	89,643,362,113円
同期中一部解約元本額	84,890,997,041円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	39,722,929,822円
たわらノーロード 国内債券	21,006,330,856円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	13,145,822,793円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,228,610,665円
たわらノーロード バランス（標準型）	5,615,289,082円
たわらノーロード バランス（積極型）	984,636,025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）	209,864,343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）	3,116,776,111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）	4,005,477,140円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	1,036,538,467円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	71,676,106円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	32,772,208円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	285,983,867円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	29,483,352円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	62,284円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	101,764,743円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	25,806,163円
D I A M国内債券インデックスファンド< D C 年金 >	11,825,326,823円
O n e グローバルバランス	470,583,416円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け）	8,014,899円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け）	2,991,285円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け）	1,257,220円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け）	750,472円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1988～1992年生まれ向け）	88,495円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1993～1997年生まれ向け）	89,302円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1998～2002年生まれ向け）	73,202円

未来のわたし(ターゲット・イヤー/2003~2007年生まれ向け)	107,085円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	14,518,706,646円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	22,887,828,704円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	11,703,268,373円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,989,830,293円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	3,292,152,637円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	754,379,307円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	95,238,660円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	4,079,446,425円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	10,287,537円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	6,653,270,401円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	3,486,376,873円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	789,344,439円
投資のソムリエ	33,974,717,136円
クルーズコントロール	236,262,299円
投資のソムリエ<DC年金>	7,036,796,578円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	9,756,439,097円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	4,895,749,829円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	13,386,831,106円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	22,801,769,364円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	675,207,270円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	365,958,107円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	160,575,537円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,557,995,665円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	9,919,796,021円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,987,018,137円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,920,928,110円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	912,575,996円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	427,747,612円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	241,834,723円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	6,498,537,598円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	103,682,689円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	129,825,019円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	3,855,763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)	395,467,894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)	761,589,604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)	1,014,513,113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)	1,978,089,563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)	1,534,844,844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)	852,893,021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)	1,648,449,955円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	2,061,798,505円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,737,304,232円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	450,896,796円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	240,655,886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）	1,347,763,508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）	23,284,362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）	90,794,993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）	100,450,858円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	21,810,329円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	58,830,364円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	29,951,526円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	499,341円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	1,801,057,644円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	2,105,539,663円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,589,253,270円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	48,477,198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）	123,233,623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）	952,322,641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）	75,491,614円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	668,435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）	984,067,355円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	28,547,835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）	150,050,895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）	227,276,937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）	350,499,564円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	173,328,019円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	49,746,560円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	456,244,779円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	317,181,023円
コア資産形成ファンド	110,184,598円
たわらノーロード 国内債券＜ラップ専用＞	11,688,399,436円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	30,229,411,568円
MHAM日本債券パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	30,267,831,890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〕	143,353,669円
計	407,405,640,834円
2. 受益権の総数	407,405,640,834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	2026年4月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額	1,114円
（1万口当たり純資産額）	(11,141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）

2026年4月14日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	17,135,834,769
コール・ローン	1,123,585,242
株式	2,477,401,798,034
投資信託受益証券	2,755,049,566
投資証券	37,103,924,106
派生商品評価勘定	1,321,531,383
未収入金	78,909,647
未収配当金	2,322,252,173
差入委託証拠金	13,154,404,060
流動資産合計	2,552,397,288,980
資産合計	2,552,397,288,980
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,485,677
未払解約金	972,977,000
流動負債合計	975,462,677
負債合計	975,462,677
純資産の部	
元本等	
元本	201,942,681,750
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,349,479,144,553
元本等合計	2,551,421,826,303
純資産合計	2,551,421,826,303
負債純資産合計	2,552,397,288,980

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年4月14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	192,511,113,011円
同期中追加設定元本額	17,806,867,459円
同期中一部解約元本額	8,375,298,720円

元本の内訳

ファンド名

インデックスオープン・世界株式	30,062,289円
インデックスオープン・先進国株式	41,849,934円
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,651,795,937円
たわらノーロード 先進国株式	92,784,772,440円
たわらノーロード 先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,836,485,145円
たわらノーロード バランス（８資産均等型）	1,261,968,507円
たわらノーロード バランス（堅実型）	68,367,649円
たわらノーロード バランス（標準型）	823,070,018円
たわらノーロード バランス（積極型）	1,422,870,640円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	1,335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	58,197,548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）	368,857,982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）	466,486,543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）	742,818,609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）	692,473円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	21,019,604円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	11,272,681円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	24,037,858円
たわらノーロード 全世界株式	18,055,178,662円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	12,351,088円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	52,531,250円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	22,390,357円
D I A M外国株式インデックスファンド＜D C 年金＞	57,359,669,942円
One D C 先進国株式インデックスファンド	4,312,504,602円
One グローバルバランス	65,815,028円
D I A Mバランス・ファンド＜D C 年金＞ 1 安定型	111,599,580円
D I A Mバランス・ファンド＜D C 年金＞ 2 安定・成長型	634,737,184円
D I A Mバランス・ファンド＜D C 年金＞ 3 成長型	943,389,266円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	53,452,512円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	175,699,647円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	205,333,305円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,927,979円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	509,942,661円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	102,863,586円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国 1 0 ）	111,917,247円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国 2 0 ）	159,863,950円
D I A M D C 8 資産バランスファンド（新興国 3 0 ）	300,193,115円
投資のソムリエ	1,971,862,404円
クルーズコントロール	13,979,762円
投資のソムリエ＜D C 年金＞	409,016,524円
D I A M 8 資産バランスファンドN＜D C 年金＞	161,954,326円
4 資産分散投資・ハイクラス＜D C 年金＞	387,661,509円
投資のソムリエ＜D C 年金＞リスク抑制型	181,638,278円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド	308,164,378円
ワールドアセットバランス（基本コース）	47,179,071円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	78,782,210円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 4 5 ）	98,065,792円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 5 5 ）	52,435,472円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド（D C ）	2,181,757円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 3 5 ）	197,620,226円

4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	177,658,030円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	109,874,611円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,783,194円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	77,410,793円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	61,360,147円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	34,714,821円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	241,751,736円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	15,142,025円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	24,462,338円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	566,798円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	6,187,835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)	3,901,103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)	4,083,535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)	10,202,631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)	14,244,663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)	4,402,783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)	16,724,300円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	10,674,627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)	217,973,220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)	12,076,441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)	854,311,242円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	867,067,872円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	26,758,739円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	2,977,691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)	6,967,370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)	1,382,933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)	7,194,703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)	23,907,475円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	888,682円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,599,641円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	568,727円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	23,649円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	42,870,334円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	116,973,849円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	437,311,792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)	15,425,925円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	14,086,044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)	60,487,991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)	2,387,853円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	95,392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）	23,414,927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）	2,715,785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）	7,132,153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）	10,825,089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）	19,991,702円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	12,229,988円
コア資産形成ファンド	4,244,046円
たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジなし）< ラップ専用 >	3,044,969,636円
O n e 外国株式インデックスファンド	122,906,104円
たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジあり）< ラップ専用 >	660,401,487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]	1,158,979,460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]	1,518,856,529円
計	201,942,681,750円
2. 受益権の総数	201,942,681,750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	2026年4月14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	2026年4月14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 買建	635,406,261	-	635,379,969	26,292
アメリカ・ドル	426,241,577	-	426,223,105	18,472
カナダ・ドル	48,043,340	-	48,041,884	1,456
ユーロ	161,121,344	-	161,114,980	6,364
合計	635,406,261	-	635,379,969	26,292

（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	2026年4月14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	33,295,015,422	-	34,614,087,420	1,319,071,998
合計	33,295,015,422	-	34,614,087,420	1,319,071,998

（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）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額	12.6344円
（1万口当たり純資産額）	（126,344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）

2026年4月14日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	2,325,235,899
コール・ローン	1,309,988,240
国債証券	308,658,676,718
派生商品評価勘定	645,154
未収利息	2,933,737,155
前払費用	320,923,544
流動資産合計	315,549,206,710
資産合計	315,549,206,710
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,137,813
未払金	2,404,906,309
未払解約金	77,060,000
流動負債合計	2,483,104,122
負債合計	2,483,104,122
純資産の部	
元本等	
元本	114,380,514,531
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	198,685,588,057
元本等合計	313,066,102,588
純資産合計	313,066,102,588
負債純資産合計	315,549,206,710

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14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	2026年4月14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	124,868,965,021円
同期中追加設定元本額	17,298,964,439円
同期中一部解約元本額	27,787,414,929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	9,401,838,261円
たわらノーロード 先進国債券	26,946,247,677円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,643,911,666円
たわらノーロード バランス（堅実型）	77,356,851円
たわらノーロード バランス（標準型）	557,929,284円
たわらノーロード バランス（積極型）	162,067,919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）	16,829,890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）	914,565,100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）	1,697,652,956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）	916,184,114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）	604,147,063円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,778,107円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	12,698,907円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	144,193,727円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	39,869,340円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	28,201,659円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	54,857,394円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	12,725,900円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	447,717円
D I A M外国債券インデックスファンド＜DC年金＞	6,906,014,635円
One DC 先進国債券インデックスファンド	4,974,432,111円
One グローバルバランス	208,185,225円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞ 1 安定型	771,236,833円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞ 2 安定・成長型	2,608,980,983円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞ 3 成長型	3,522,272,523円

DIAM DC バランス30インデックスファンド	357,878,589円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	840,298,768円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	924,397,896円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,772,124円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,055,863,906円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	38,305,990円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	156,797,134円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	176,543,663円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	326,326,598円
クルーズコントロール	192,800,626円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,130,824円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,449,326,841円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,175,457,512円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	174,341,663円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,071,104,624円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	3,242,474円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	28,687,273円
Oneパッシブ資産分散ファンド	729,064,021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)	345,934,242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)	283,821,103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)	100,737,422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)	737,123,640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)	395,013,493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)	317,656,929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)	311,257,380円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	566,551,475円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,872,924,525円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,322,046,616円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	3,475,017,161円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	30,156,487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)	502,283,086円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	149,666,446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)	165,604,870円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,983,395円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	16,150,968円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,933,311円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	51,519円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	648,026,962円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	939,335,523円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,887,263,292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)	33,283,980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)	71,067,538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）	522,656,022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）	113,793,810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）	137,754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）	101,279,039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）	93,465,492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）	115,481,801円
D I A M世界バランス 2 5 V A（適格機関投資家限定）	21,710,815円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	61,383,752円
コア資産形成ファンド	21,315,368円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジなし）< ラップ専用 >	2,447,050,368円
たわらノーロード 外国債券（為替ヘッジあり）< ラップ専用 >	6,850,500,303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]	5,711,196,989円
M H A M外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	5,960,685,287円
計	114,380,514,531円
2. 受益権の総数	114,380,514,531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	2026年4月14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	2026年4月14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 買建	553,000,000	-	552,507,341	492,659
アメリカ・ドル	261,008,000	-	259,973,928	1,034,072
イギリス・ポンド	49,081,000	-	49,299,298	218,298
オフショア・人民元	78,012,000	-	77,908,259	103,741
カナダ・ドル	30,108,000	-	30,155,340	47,340

ユーロ	134,791,000	-	135,170,516	379,516
合計	553,000,000	-	552,507,341	492,659

（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）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額	2.7371円
（1万口当たり純資産額）	（27,371円）

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2026年4月14日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,033,612,668
コール・ローン	554,950,209
国債証券	218,877,335,228
派生商品評価勘定	5,529,284
未収入金	4,686,119
未収利息	2,189,971,574
前払費用	169,372,582
流動資産合計	222,835,457,664
資産合計	222,835,457,664
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,765,241,562
未払金	778,696,940
未払解約金	346,845,000
流動負債合計	3,890,783,502
負債合計	3,890,783,502
純資産の部	
元本等	
元本	191,396,243,856
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	27,548,430,306
元本等合計	218,944,674,162
純資産合計	218,944,674,162
負債純資産合計	222,835,457,664

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14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	2026年4月14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	227,198,175,942円
同期中追加設定元本額	24,768,817,833円
同期中一部解約元本額	60,570,749,919円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券＜為替ヘッジあり＞	14,843,019,264円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,016,487,025円
たわらノーロード バランス（標準型）	7,638,346,123円
たわらノーロード バランス（積極型）	5,039,851,520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）	70,108,666円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	2,478,184,437円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	3,130,263,775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）	467,336,688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）	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	5,908,601円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	31,302,655円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	288,913,677円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	36,817,878円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	91,804円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	157,152,462円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	419,190,656円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	49,154,213円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／～1972年生まれ向け）	9,605,897円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1973～1977年生まれ向け）	3,313,866円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1978～1982年生まれ向け）	1,317,354円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／1983～1987年生まれ向け）	626,804円

未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９８８～１９９２年生まれ向け）	13,160円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９３～１９９７年生まれ向け）	13,114円
未来のわたし（ターゲット・イヤー／１９９８～２００２年生まれ向け）	13,988円
投資のソムリエ	49,721,878,011円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	10,299,179,021円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	13,995,408,942円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	23,836,268,579円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,612,254,124円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,682,714,641円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,320,725,581円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	712,196,999円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	167,865,664円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	4,973,665,982円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,054,155,487円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	7,729,610,025円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	1,712,478,813円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	825,525,951円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	470,604,886円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	201,781,551円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	10,762,296円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	7,494,796円
外国債券パッシブファンド２（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	19,096,463,220円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	6,549,819,385円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	659,915,098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）	34,084,923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）	240,172,632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）	27,856,044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）	146,437,018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）	277,677,089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）	342,040,078円
計	191,396,243,856円
２． 受益権の総数	191,396,243,856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	2026年4月14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	2026年4月14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	218,599,345,529	-	221,359,057,807	2,759,712,278
アメリカ・ドル	100,467,684,573	-	100,670,597,370	202,912,797
イギリス・ポンド	12,074,531,263	-	12,395,503,980	320,972,717
イスラエル・シェケル	925,763,437	-	960,605,458	34,842,021
オーストラリア・ドル	2,836,114,456	-	2,939,773,656	103,659,200
オフショア・人民元	27,025,821,247	-	27,404,451,783	378,630,536
カナダ・ドル	4,571,064,920	-	4,632,426,700	61,361,780
シンガポール・ドル	766,967,196	-	777,688,310	10,721,114
スウェーデン・クローナ	383,543,750	-	398,773,248	15,229,498
デンマーク・クローネ	431,170,080	-	440,950,400	9,780,320
ニュージーランド・ドル	657,830,448	-	677,602,696	19,772,248
ノルウェー・クローネ	353,951,063	-	365,483,020	11,531,957
ポーランド・ズロチ	1,574,020,440	-	1,629,196,551	55,176,111
マレーシア・リンギット	1,112,024,982	-	1,133,183,078	21,158,096
メキシコ・ペソ	1,885,416,694	-	1,970,188,794	84,772,100
ユーロ	63,007,319,570	-	64,419,621,210	1,412,301,640
韓国・ウォン	526,121,410	-	543,011,553	16,890,143
合計	218,599,345,529	-	221,359,057,807	2,759,712,278

（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）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額	1.1439円
（1万口当たり純資産額）	(11,439円)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2026年4月14日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	7,801,807,152
コール・ローン	472,237,497
株式	173,398,983,876
投資信託受益証券	1,018,851,257
投資証券	160,494,921
派生商品評価勘定	713,833,444
未収入金	7,716,786
未収配当金	358,657,354
差入委託証拠金	2,750,136,281
流動資産合計	186,682,718,568
資産合計	186,682,718,568
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,283
未払金	16,803
未払解約金	389,549,000
流動負債合計	389,584,086
負債合計	389,584,086
純資産の部	
元本等	
元本	67,661,780,922
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	118,631,353,560
元本等合計	186,293,134,482
純資産合計	186,293,134,482
負債純資産合計	186,682,718,568

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14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。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年4月14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	70,171,663,530円
同期中追加設定元本額	10,409,070,098円
同期中一部解約元本額	12,918,952,706円
元本の内訳	
ファンド名	
インデックスオープン・世界株式	19,572,163円
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	11,602,712,613円
たわらノーロード 新興国株式< ラップ専用 >	6,135,579,237円
たわらノーロード 新興国株式	20,145,733,459円

たわらノーロード バランス(8資産均等型)	5,998,164,334円
たわらノーロード バランス(堅実型)	26,897,555円
たわらノーロード バランス(標準型)	138,778,415円
たわらノーロード バランス(積極型)	337,238,749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)	93,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	46,491,297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)	201,360,356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)	276,677,034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)	429,961,142円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	628,081円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,580,994円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,935,815円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,674,292円
たわらノーロード 全世界株式	11,767,921,547円
One DC 新興国株式インデックスファンド	3,441,259,054円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1972年生まれ向け)	671,958円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1973~1977年生まれ向け)	369,580円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1978~1982年生まれ向け)	252,480円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1983~1987年生まれ向け)	312,269円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1988~1992年生まれ向け)	176,174円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1993~1997年生まれ向け)	191,892円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/1998~2002年生まれ向け)	185,494円
未来のわたし(ターゲット・イヤー/2003~2007年生まれ向け)	265,142円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	319,300,385円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	266,780,378円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	513,249,840円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,037,794,727円
投資のソムリエ	1,650,963,518円
クルーズコントロール	64,466,508円
投資のソムリエ<DC年金>	342,414,803円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	387,001,525円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	406,920,622円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	692,064,467円
ワールドアセットバランス(基本コース)	218,245,380円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	363,973,186円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	41,546,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	22,220,562円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,695,224円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	126,916,227円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	163,800,059円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	231,489,676円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	47,753,970円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	25,986,880円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,777,014円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,329,652円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	12,900,843円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	230,544円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	22,677,932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）	857,646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）	53,874,649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）	24,863,500円
計	67,661,780,922円
２． 受益権の総数	67,661,780,922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	2026年4月14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	2026年4月14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	3,456,602	-	3,447,665	8,937
カタル・リアル	1,296,892	-	1,291,581	5,311
ブラジル・リアル	2,159,710	-	2,156,084	3,626
買建	3,456,602	-	3,438,319	18,283
アメリカ・ドル	3,456,602	-	3,438,319	18,283
合計	6,913,204	-	6,885,984	9,346

（注）時価の算定方法

為替予約取引

１． 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
 - ２．計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 - ３．換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2026年4月14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	10,968,191,126	-	11,682,015,633	713,824,507
合計	10,968,191,126	-	11,682,015,633	713,824,507

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

- １．原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
 - ２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - ３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.7533円 (27,533円)

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2026年4月14日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	2,067,541,291
コール・ローン	420,104,965
国債証券	99,756,462,402
未収利息	1,101,571,457
前払費用	400,359,279
流動資産合計	103,746,039,394
資産合計	103,746,039,394
負債の部	
流動負債	
未払金	1,295,882,209
未払解約金	93,160,000
流動負債合計	1,389,042,209
負債合計	1,389,042,209
純資産の部	
元本等	
元本	36,345,497,281
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,011,499,904
元本等合計	102,356,997,185
純資産合計	102,356,997,185
負債純資産合計	103,746,039,394

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年4月14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	41,112,824,878円
同期中追加設定元本額	15,568,401,174円
同期中一部解約元本額	20,335,728,771円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,507,690,446円
たわらノーロード バランス（堅実型）	201,796,022円
たわらノーロード バランス（標準型）	819,103,974円
たわらノーロード バランス（積極型）	475,572,707円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	695,732円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	4,735,890円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	44,799,901円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	8,665,893円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	5,811,060円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	47,745,786円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	250,831,915円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	453,732,465円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	984,545,219円
投資のソムリエ	4,393,308,639円
クルーズコントロール	62,494,711円
投資のソムリエ＜DC年金＞	910,295,904円
D I A M 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	368,738,202円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	1,081,302,897円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,835,713,367円
ワールドアセットバランス（基本コース）	133,081,629円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	222,176,652円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	113,952,162円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	60,979,905円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	12,991,097円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	435,275,304円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	562,834,700円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	213,565,696円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	167,377,205円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	71,274,522円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	40,649,171円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	17,343,367円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	1,271,134円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	5,919,594円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０７０）	640,426円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	15,107,258,775円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	58,519,572円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	481,259,886円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド２（適格機関投資家限定）	551,970,467円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,018,861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）	49,547,373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）	22,912,686円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	554,096,367円
計	36,345,497,281円
２． 受益権の総数	36,345,497,281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	2026年4月14日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	（１）有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

	2026年4月14日現在
１口当たり純資産額	2.8162円
（１万口当たり純資産額）	(28,162円)

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2026年4月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,344,550,410
投資証券	191,553,415,500
未収入金	330,274,013
未収配当金	2,491,774,052
前払金	140,850,100
差入委託証拠金	266,075,240
流動資産合計	200,126,939,315
資産合計	200,126,939,315
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	81,167,370
未払金	2,378,777,224
未払解約金	479,266,000
流動負債合計	2,939,210,594
負債合計	2,939,210,594
純資産の部	
元本等	
元本	70,517,007,042
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	126,670,721,679
元本等合計	197,187,728,721
純資産合計	197,187,728,721
負債純資産合計	200,126,939,315

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
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	2026年4月14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	75,641,315,204円
同期中追加設定元本額	10,711,386,229円
同期中一部解約元本額	15,835,694,391円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 国内リート	7,351,315,744円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,521,655,607円
たわらノーロード バランス（堅実型）	49,781,889円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,384,638,922円
たわらノーロード バランス（積極型）	2,085,662,154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）	36,161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）	396,942,026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）	1,146,439,813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）	861,099,741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）	979,549,330円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	6,069,356円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	91,947,782円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	29,216,407円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	39,033,956円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	20,703,105円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	62,453,881円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	42,071,913円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,182,951円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	463,252,458円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,539,059円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	149,418,663円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	267,854,432円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	580,824,886円
投資のソムリエ	2,947,574,880円
投資のソムリエ＜DC年金＞	610,847,312円

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	218,643,216円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	725,982,165円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,233,689,636円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	58,860,471円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	31,473,591円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,717,745円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	212,301,429円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	684,018,608円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	132,165,561円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	112,812,131円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	36,772,758円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	20,971,129円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	8,955,874円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	39,732,541円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	327,396円
Jリートインデックスファンド(DC)	106,250,165円
One J-REITインデックスファンド(隔月決算型)	52,901,626円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04 (適格機関投資家限定)	259,115,599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)	46,599,046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)	30,252,526円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	68,183,103円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナル ヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	398,963,564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)	40,637,075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)	78,591,709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)	169,767,022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)	118,836,916円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	68,084,825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)	33,930,531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)	118,475,709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)	170,489,435円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)	637,251,102円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	81,959,838円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)24-04(適格機関投資家限定)	182,736,973円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2024-05(適格機関投資家限定)	426,326,193円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	1,789,870,795円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	39,325,506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）	92,192,758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）	53,682,595円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	2,027,103円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	295,712,343円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	6,209,063,554円
One J-REITインデックスファンド（毎月決算型）	22,327,956,435円
One J-REITインデックスファンド（年1回決算型）	2,435,380,504円
たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	5,552,905,813円
計	70,517,007,042円
2. 受益権の総数	70,517,007,042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	2026年4月14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）

不動産投信関連

種類	2026年4月14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	5,583,435,100	-	5,502,582,000	80,853,100
合計	5,583,435,100	-	5,502,582,000	80,853,100

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

- 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。

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）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額	2.7963円
（1万口当たり純資産額）	(27,963円)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2026年4月14日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	535,097,879
コール・ローン	150,081,845
投資信託受益証券	12,730,103,302
投資証券	113,131,308,358
派生商品評価勘定	58,168,655
未収入金	1,331,264
未収配当金	334,459,780
差入委託証拠金	372,499,530
流動資産合計	127,313,050,613
資産合計	127,313,050,613
負債の部	
流動負債	
未払解約金	92,250,000
流動負債合計	92,250,000
負債合計	92,250,000
純資産の部	
元本等	
元本	50,521,205,521
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	76,699,595,092
元本等合計	127,220,800,613
純資産合計	127,220,800,613
負債純資産合計	127,313,050,613

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2025年10月15日 至 2026年4月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年4月14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	47,520,447,220円
同期中追加設定元本額	11,814,849,528円
同期中一部解約元本額	8,814,091,227円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞	5,341,134,850円
たわらノーロード 先進国リート	17,422,230,455円
たわらノーロード 先進国リート＜為替ヘッジあり＞	229,381,082円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	6,327,673,614円
たわらノーロード バランス（堅実型）	28,795,538円
たわらノーロード バランス（標準型）	769,623,990円
たわらノーロード バランス（積極型）	2,172,811,560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）	49,838,372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）	755,512,073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）	900,199,446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)	1,474,923,429円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,361,563円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	60,423,802円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	30,334,769円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	57,774,084円
One DC 先進国リートインデックスファンド	4,661,547,821円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	16,730,081円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	719,089,455円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	91,899,274円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	174,621,042円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	315,178,721円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	687,282,388円
投資のソムリエ	3,347,223,588円
投資のソムリエ<DC年金>	693,875,116円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	258,129,858円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	329,854,106円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	559,716,495円
ワールドアセットバランス(基本コース)	155,637,125円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	259,962,343円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	89,085,734円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	47,656,450円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,958,236円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	339,735,532円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	385,984,952円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	148,383,048円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	127,763,789円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	55,702,817円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	31,751,306円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	13,553,789円
One グローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	58,799,847円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	499,989円
One パッシブ資産分散ファンド	342,380,635円
DIAM 外国リートインデックスファンド<DC年金>	514,738,863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)	125,270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)	1,787,456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)	711,941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)	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	5,202円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	44,380,109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)	572,716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)	2,301,022円
DIAM 世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	23,672,350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)	57,859,647円
DIAM グローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	336,527,673円
計	50,521,205,521円
2. 受益権の総数	50,521,205,521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	2026年4月14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	2026年4月14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	159,528,420	-	159,521,706	6,714
アメリカ・ドル	159,528,420	-	159,521,706	6,714
合計	159,528,420	-	159,521,706	6,714

（注）時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

不動産投信関連

種類	2026年4月14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	1,121,541,281	-	1,179,703,222	58,161,941
合計	1,121,541,281	-	1,179,703,222	58,161,941

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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）

	2026年4月14日現在
1口当たり純資産額	2.5182円
（1万口当たり純資産額）	(25,182円)

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

（2026年4月30日現在）

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

「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。

2026年4月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,650,272,619,692
追加型株式投資信託	758	21,012,307,430,530
単位型公社債投資信託	16	25,552,801,285
単位型株式投資信託	150	818,718,352,855
合計	950	23,506,851,204,362

（３）【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2025年5月14日付で100％子会社であるAsset Management One Singapore Pte. Ltd. を清算しました。

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社は2025年12月26日付で清算終了しました。

（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。

5【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第41期事業年度（自2025年4月1日至2026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40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	40,201	44,626
有価証券	0	-
金銭の信託	31,340	31,701
未収委託者報酬	19,595	21,109
未収運用受託報酬	4,015	8,039
未収投資助言報酬	359	381
未収収益	11	18
前払費用	1,758	1,764
その他	2,106	2,130
流動資産計	99,390	109,772
固定資産		
有形固定資産	1,361	1,099
建物	1 841	1 735
器具備品	1 352	1 341
リース資産	1 3	1 1
建設仮勘定	163	20
無形固定資産	3,771	3,871
ソフトウェア	2,740	2,936
ソフトウェア仮勘定	1,030	934
電話加入権	0	0
投資その他の資産	9,039	8,550
投資有価証券	183	106
関係会社株式	4,037	3,364
長期差入保証金	760	774
繰延税金資産	3,842	4,054
その他	215	250
固定資産計	14,172	13,521
資産合計	113,562	123,293

（単位：百万円）

	第40期 （2025年3月31日現在）	第41期 （2026年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	227	520
リース債務	1	1
未払金	8,823	9,766
未払収益分配金	1	1
未払償還金	0	1
未払手数料	8,596	9,373
その他未払金	225	390
未払費用	9,265	11,969
未払法人税等	4,277	4,023
未払消費税等	1,606	1,883
賞与引当金	2,198	2,225
役員賞与引当金	60	60
流動負債計	26,462	30,451
固定負債		
リース債務	2	0
退職給付引当金	2,715	2,721
時効後支払損引当金	64	53
固定負債計	2,781	2,775
負債合計	29,244	33,227
（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	62,765	68,513
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	62,642	68,390
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	30,962	36,710
株主資本計	84,318	90,066
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	84,318	90,066
負債・純資産合計	113,562	123,293

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）		第41期 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	112,281		117,297	
運用受託報酬	17,981		23,568	
投資助言報酬	2,374		1,997	
その他営業収益	30		24	
営業収益計		132,668		142,888
営業費用				
支払手数料	49,384		51,925	
広告宣伝費	401		297	
公告費	0		-	
調査費	39,013		43,316	
調査費	14,703		18,298	
委託調査費	24,309		25,017	
委託計算費	522		308	
営業雑経費	774		711	
通信費	38		36	
印刷費	538		473	
協会費	67		66	
諸会費	47		47	
支払販売手数料	81		88	
営業費用計		90,097		96,558
一般管理費				
給料	11,477		11,766	
役員報酬	181		183	
給料・手当	10,148		10,445	
賞与	1,147		1,137	
交際費	59		82	
寄付金	12		17	
旅費交通費	246		307	
租税公課	668		1,028	
不動産賃借料	1,085		1,107	
退職給付費用	421		431	
固定資産減価償却費	1,457		1,460	
福利厚生費	57		58	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	2,198		2,225	
役員賞与引当金繰入額	60		60	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,261		3,472	
事務用消耗品費	43		53	
器具備品費	2		1	
諸経費	313		210	
一般管理費計		21,366		22,286
営業利益		21,204		24,043

（単位：百万円）

	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）		第41期 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		12		50
受取配当金	1	450	1	328
時効成立分配金・償還金		0		0
金銭の信託運用益		-		631
雑収入		11		10
時効後支払損引当金戻入額		7		8
営業外収益計		482		1,030
営業外費用				
投資信託償還損		-		0
為替差損		39		51
金銭の信託運用損		329		-
早期割増退職金		6		27
営業外費用計		374		78
経常利益		21,312		24,994
特別利益				
固定資産売却益	2	6	2	0
特別利益計		6		0
特別損失				
固定資産除却損		13		0
投資有価証券売却損		-		22
関係会社株式評価損		31		523
関係会社清算損		25		4
特別損失計		70		550
税引前当期純利益		21,247		24,444
法人税、住民税及び事業税		7,356		7,469
法人税等調整額		435		212
法人税等合計		6,920		7,256
当期純利益		14,326		17,187

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846
当期変動額									
剰余金の配当							10,855	10,855	10,855
当期純利益							14,326	14,326	14,326
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,471	3,471	3,471
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	30,962	62,765	84,318

	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	80,846
当期変動額			
剰余金の配当			10,855
当期純利益			14,326
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	3,471
当期末残高	0	0	84,318

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	30,962	62,765	84,318
当期変動額									
剰余金の配当							11,440	11,440	11,440
当期純利益							17,187	17,187	17,187
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,747	5,747	5,747
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	36,710	68,513	90,066

	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	84,318
当期変動額			
剰余金の配当			11,440
当期純利益			17,187
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	5,747
当期末残高	0	0	90,066

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、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 ... 3～20年 (2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、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。 (3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 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。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

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

（未適用の会計基準等）

- ・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）
- ・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

（1） 概要

企業会計基準委員会において、日本基準を国際的に整合性のあるものとする取組みの一環として、借手の全てのリースについて資産及び負債を認識するリースに関する会計基準の開発に向けて、国際的な会計基準を踏まえた検討が行われ、基本的な方針として、IFRS第16号の単一の会計処理モデルを基礎とするものの、IFRS第16号の全ての定めを採り入れるのではなく、主要な定めのみを採り入れることにより、簡素で利便性が高く、かつ、IFRS第16号の定めを個別財務諸表に用いても、基本的に修正が不要となることを目指したリース会計基準等が公表されました。

借手の会計処理として、借手のリースの費用配分の方法については、IFRS第16号と同様に、リースがファイナンス・リースであるかオペレーティング・リースであるかにかかわらず、全てのリースについて使用权資産に係る減価償却費及びリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

（2） 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

（3） 当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

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40期 （2025年3月31日現在）	第41期 （2026年3月31日現在）
建物	740	849
器具備品	662	705
リース資産	5	7

（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40期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）	第41期 （自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日）
受取配当金	438	314

2. 固定資産売却益

固定資産売却益の内容は、次のとおりであります。

	第40期 （自 2024年4月 1日 至 2025年3月31日）	第41期 （自 2025年4月 1日 至 2026年3月31日）
ソフトウェア	6	0

（株主資本等変動計算書関係）第40期（自 2024年4月1日 至 2025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（財 産）の総額 （百万円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2024年3月15日 みなし株主総会	普通 株式	575	14,390	2024年4月1日	2024年4月1日
	A種種類 株式				
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式				

会社法第319条第1項に基づき、2024年3月15日に決議があったものとみなされた株主総会での配当決議は当社の子会社であったAsset Management One USA Inc.（以下「AM-One USA」という）の全株式の現物配当であります。

本現物配当は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）の子会社である米州みずほLLC（以下「米州みずほ」という）が、2024年10月1日に米国外国銀行規制上の中間持株会社へ移行することに伴う規制上の対応として実施したものです。

当社が100%保有していたAM-One USAの議決権は、本現物配当後、米州みずほが議決権の51%を、第一生命ホールディングス株式会社（以下「DL」という）が議決権の49%をそれぞれ保有します。当社を通じてMHFGとDLが間接的に保有していたAM-One USA株式の議決権比率と同等となります。

（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
2025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（予定）日
2025年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,440	286,000	2025年3月31日	2025年6月17日
	A種種類株式					

第41期（自 2025年4月1日 至 2026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
2025年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,440	286,000	2025年3月31日	2025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
2026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（予定）日
2026年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	22,000	550,000	2026年3月31日	2026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おります。

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40期（2025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）有価証券	0	0	-
（2）金銭の信託	31,340	31,340	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	0	0	-
資産計	31,342	31,342	-

第41期（2026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	31,701	31,701	-
（２）投資有価証券 其他有価証券	0	0	-
資産計	31,702	31,702	-

（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40期（2025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	40,201	-	-	-
（２）有価証券	0	-	-	-
（３）金銭の信託	31,340	-	-	-
（４）未収委託者報酬	19,595	-	-	-
（５）未収運用受託報酬	4,015	-	-	-
（６）投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	0	-	-
合計	95,154	0	-	-

第41期（2026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	44,626	-	-	-
（２）金銭の信託	31,701	-	-	-
（３）未収委託者報酬	21,109	-	-	-
（４）未収運用受託報酬	8,039	-	-	-
（５）投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	0	-	-
合計	105,477	0	-	-

３．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第40期（2025年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
（1）有価証券	-	0	-	0
（2）金銭の信託	-	31,340	-	31,340
（3）投資有価証券 其他有価証券	-	0	-	0
資産計	-	31,342	-	31,342

第41期（2026年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
（1）金銭の信託	-	31,701	-	31,701
（2）投資有価証券 其他有価証券	-	0	-	0
資産計	-	31,702	-	31,702

（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

有価証券

有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

金銭の信託

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

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

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

	第40期 （2025年3月31日現在）	第41期 （2026年3月31日現在）
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	182	106
関係会社株式		
非上場株式	4,037	3,364

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第40期の貸借対照表計上額4,037百万円、第41期の貸借対照表計上額3,364百万円）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40期（2025年3月31日現在）

（百万円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額182百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

第41期（2026年3月31日現在）

（百万円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	0	1	0
小計	0	1	0
合計	0	1	0

（注）非上場株式（貸借対照表計上額106百万円）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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

該当はありません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026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	51	-	22

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について31百万円（関係会社株式31百万円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について523百万円（関係会社株式523百万円）減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（百万円）

	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	第41期 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,760	2,759
勤務費用	299	311
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	18	439
退職給付の支払額	321	320
退職給付債務の期末残高	2,759	2,313

（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40期 （2025年3月31日現在）	第41期 （2026年3月31日現在）
非積立型制度の退職給付債務	2,759	2,313
未積立退職給付債務	2,759	2,313
未認識数理計算上の差異	44	408
未認識過去勤務費用	0	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,715	2,721
退職給付引当金	2,715	2,721
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,715	2,721

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

	第40期 （自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）	第41期 （自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）
勤務費用	299	311
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	14	12
過去勤務費用の費用処理額	0	0
その他	4	3
確定給付制度に係る退職給付費用	312	323

（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6百万円、当事業年度において27百万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40期 （2025年3月31日現在）	第41期 （2026年3月31日現在）
割引率	0.09%	2.14%
予想昇給率	1.00%～3.56%	1.00%～3.56%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度108百万円、当事業年度105百万円であります。

（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40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	259	225
未払事業所税	10	10
賞与引当金	673	701
未払法定福利費	106	110
運用受託報酬	555	1,534
資産除去債務	20	23
減価償却超過額（一括償却資産）	5	3
減価償却超過額	66	71
繰延資産償却超過額（税法上）	407	407
退職給付引当金	855	857
時効後支払損引当金	20	16
ゴルフ会員権評価損	2	2
関係会社株式評価損	774	-
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	73	73
その他	6	11
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,842	4,054
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,842	4,054

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

	第40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	- %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.64 %	- %
税制非適格現物配当益金算入項目	3.56	- %
税率変更による影響	0.18	- %
その他	0.79 %	- %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.57 %	- %

（注）当事業年度は、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）

（取得による企業結合）

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40期 (2025年3月31日現在)	第41期 (2026年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	53,066百万円	46,634百万円
資産合計	53,066百万円	46,634百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	561百万円	- 百万円
負債合計	561百万円	- 百万円
純資産	52,505百万円	46,634百万円
（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	43,829百万円	40,018百万円
顧客関連資産	13,661百万円	10,603百万円

(2) 損益計算書項目

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	7,259百万円	6,868百万円
経常利益	7,259百万円	6,868百万円
税引前当期純利益	7,259百万円	6,868百万円
当期純利益	6,298百万円	5,870百万円
1株当たり当期純利益	157,468円47銭	146,764円94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	3,447百万円	3,057百万円

(共通支配下の取引等)

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当社は、2024年4月1日に株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という。親会社）及び第一生命ホールディングス株式会社（その他の関係会社）へ以下の現物配当を行いました。

1. 取引の概要

(1) 取引内容

Asset Management One USA Inc. (当社の子会社) 株式の現物配当

(2) 効力発生日

2024年4月1日

(3) 取引の総額

575百万円

(4) その他取引の概要に関する事項

本現物配当は、MHFGの子会社である米州みずほLLCが、2024年10月1日に米国外国銀行規制上の中間持株会社へ移行することに伴う規制上の対応として実施したものです。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成31年1月16日)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31年1月16日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

(資産除去債務関係)

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
委託者報酬	111,988百万円	115,972百万円
運用受託報酬	16,520百万円	18,429百万円
投資助言報酬	2,374百万円	1,997百万円
成功報酬（注）	1,754百万円	6,463百万円
その他営業収益	30百万円	24百万円
合計	132,668百万円	142,888百万円

（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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）及び第41期（自 2025年4月1日 至 2026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。

（持分法損益等）

第40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

当社はPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

（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40期（自 2024年4月1日 至 2025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	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	22,567 億円	持株 会社	(被所有) 直接 51%	-	持株会社	現物配当	402	-	-
その他の 関係会社	第一生命 ホール ディング ス株式 会社	東京都 千代田 区	3,443 億円	持株 会社	(被所有) 直接 49%	-	持株会社	現物配当	172	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注）現物配当の詳細については、（株主資本等変動計算書関係）2. 配当に関する事項及び（企業結合等関係）（共通支配下の取引等）に記載しております。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026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40期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

該当はありません。

第41期（自 2025年4月1日 至 2026年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第40期（自 2024年4月1日 至 2025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	9,048	未払 手数料	1,976
	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	20,086	未払 手数料	3,306

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第41期（自 2025年4月1日 至 2026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	9,462	未払 手数料	2,204
	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	21,894	未払 手数料	3,421

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40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
1株当たり純資産額	2,107,956円73銭	2,251,656円50銭
1株当たり当期純利益金額	358,173円51銭	429,699円67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40期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	第41期 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
当期純利益金額	14,326百万円	17,187百万円
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	14,326百万円	17,187百万円
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。

独立監査人の監査報告書

2026年5月22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 森 重 俊 寛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 稲 葉 宏 和
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、「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2025年4月1日から2026年3月31日までの第41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2026年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年6月19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Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞の2025年10月15日から2026年4月14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、Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞の2026年4月14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（2025年10月15日から2026年4月14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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年6月19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Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞の2025年10月15日から2026年4月14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、Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞の2026年4月14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（2025年10月15日から2026年4月14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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。