

【表紙】

| | |
|-------------------|--|
| 【提出書類】 | 半期報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2021年11月18日提出 |
| 【計算期間】 | 第8期中(自 2021年2月19日至 2021年8月18日) |
| 【ファンド名】 | グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし |
| 【発行者名】 | アセットマネジメントOne株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 菅野 暁 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 酒井 隆 |
| 【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】

グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ

2021年8月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 297,301,096 | 98.31 |
| 内 日本 | 297,301,096 | 98.31 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 5,115,160 | 1.69 |
| 純資産総額 | 302,416,256 | 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。

グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし

2021年8月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 2,086,101,193 | 98.17 |
| 内 日本 | 2,086,101,193 | 98.17 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 38,955,960 | 1.83 |
| 純資産総額 | 2,125,057,153 | 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)

グローバルドライブ・マザーファンド

2021年8月31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 | 12,140,653 | 0.18 |
| 内 アメリカ | 12,140,653 | 0.18 |
| 投資証券 | 6,535,962,879 | 98.31 |
| 内 ルクセンブルグ | 6,535,962,879 | 98.31 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 100,002,259 | 1.50 |
| 純資産総額 | 6,648,105,791 | 100.00 |

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ

直近日(2021年8月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額 (分配落) (百万円) | 純資産総額 (分配付) (百万円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|--------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末 (2015年 2月18日) | 414 | 414 | 1.0235 | 1.0235 |
| 第2計算期間末 (2016年 2月18日) | 605 | 605 | 0.9268 | 0.9268 |
| 第3計算期間末 (2017年 2月20日) | 531 | 531 | 1.0214 | 1.0214 |
| 第4計算期間末 (2018年 2月19日) | 421 | 421 | 1.0984 | 1.0984 |

| | | | | |
|--------------------------|-----|-----|--------|--------|
| 第5計算期間末 (2019年 2月18日) | 320 | 320 | 1.0219 | 1.0219 |
| 第6計算期間末 (2020年2月18日) | 277 | 277 | 1.1219 | 1.1219 |
| 第7計算期間末 (2021年2月18日) | 320 | 320 | 1.3337 | 1.3337 |
| 2020年8月末日 | 271 | - | 1.1900 | - |
| 9月末日 | 263 | - | 1.1651 | - |
| 10月末日 | 264 | - | 1.1528 | - |
| 11月末日 | 284 | - | 1.2559 | - |
| 12月末日 | 288 | - | 1.2880 | - |
| 2021年1月末日 | 316 | - | 1.2985 | - |
| 2月末日 | 313 | - | 1.3254 | - |
| 3月末日 | 330 | - | 1.3068 | - |
| 4月末日 | 337 | - | 1.3620 | - |
| 5月末日 | 329 | - | 1.3675 | - |
| 6月末日 | 323 | - | 1.3683 | - |
| 7月末日 | 300 | - | 1.3681 | - |
| 8月末日 | 302 | - | 1.3755 | - |

グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし

直近日(2021年8月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

| | 純資産総額 (分配落) (百万円) | 純資産総額 (分配付) (百万円) | 1口当たりの 純資産額 (分配落)(円) | 1口当たりの 純資産額 (分配付)(円) |
|--------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末 (2015年 2月18日) | 2,311 | 2,311 | 1.1880 | 1.1880 |
| 第2計算期間末 (2016年 2月18日) | 4,656 | 4,656 | 1.0313 | 1.0313 |
| 第3計算期間末 (2017年 2月20日) | 4,205 | 4,205 | 1.1438 | 1.1438 |
| 第4計算期間末 (2018年 2月19日) | 3,073 | 3,073 | 1.1831 | 1.1831 |
| 第5計算期間末 (2019年 2月18日) | 2,459 | 2,459 | 1.1705 | 1.1705 |
| 第6計算期間末 (2020年2月18日) | 2,198 | 2,198 | 1.3093 | 1.3093 |
| 第7計算期間末 (2021年2月18日) | 1,984 | 1,984 | 1.5079 | 1.5079 |
| 2020年8月末日 | 1,959 | - | 1.3376 | - |
| 9月末日 | 1,943 | - | 1.3146 | - |
| 10月末日 | 1,852 | - | 1.2861 | - |
| 11月末日 | 1,967 | - | 1.3938 | - |
| 12月末日 | 1,974 | - | 1.4259 | - |
| 2021年1月末日 | 1,937 | - | 1.4514 | - |
| 2月末日 | 1,912 | - | 1.5054 | - |
| 3月末日 | 1,942 | - | 1.5444 | - |
| 4月末日 | 1,937 | - | 1.5863 | - |
| 5月末日 | 1,978 | - | 1.6047 | - |

| | | | | |
|------|-------|---|--------|---|
| 6月末日 | 2,007 | - | 1.6173 | - |
| 7月末日 | 2,056 | - | 1.6021 | - |
| 8月末日 | 2,125 | - | 1.6166 | - |

【分配の推移】

グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ

| | 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 |
| 第4計算期間 | | 0.0000 |
| 第5計算期間 | | 0.0000 |
| 第6計算期間 | | 0.0000 |
| 第7計算期間 | | 0.0000 |
| 2021年2月19日～2021年8月18日 | | - |

グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし

| | 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 |
| 第4計算期間 | | 0.0000 |
| 第5計算期間 | | 0.0000 |
| 第6計算期間 | | 0.0000 |
| 第7計算期間 | | 0.0000 |
| 2021年2月19日～2021年8月18日 | | - |

【収益率の推移】

グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ

| | 収益率(%) | |
|-----------------------|--------|------|
| 第1計算期間 | | 2.4 |
| 第2計算期間 | | 9.4 |
| 第3計算期間 | | 10.2 |
| 第4計算期間 | | 7.5 |
| 第5計算期間 | | 7.0 |
| 第6計算期間 | | 9.8 |
| 第7計算期間 | | 18.9 |
| 2021年2月19日～2021年8月18日 | | 2.0 |

(注) 収益率は期間騰落率です。

グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし

| | 収益率(%) | |
|-----------------------|--------|------|
| 第1計算期間 | | 18.8 |
| 第2計算期間 | | 13.2 |
| 第3計算期間 | | 10.9 |
| 第4計算期間 | | 3.4 |
| 第5計算期間 | | 1.1 |
| 第6計算期間 | | 11.9 |
| 第7計算期間 | | 15.2 |
| 2021年2月19日～2021年8月18日 | | 5.7 |

(注) 収益率は期間騰落率です。

2【設定及び解約の実績】

グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ

| | 設定口数 | 解約口数 |
|---------------------------|-------------|-------------|
| 第1計算期間 | 463,443,751 | 58,444,887 |
| 第2計算期間 | 314,897,151 | 66,710,225 |
| 第3計算期間 | 39,370,910 | 172,493,914 |
| 第4計算期間 | 62,572,092 | 198,697,659 |
| 第5計算期間 | 30,227,587 | 100,388,376 |
| 第6計算期間 | 17,893,183 | 83,967,947 |
| 第7計算期間 | 34,526,895 | 41,710,786 |
| 2021年2月19日～ 2021年8月18日 | 21,813,451 | 42,408,394 |

(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。

グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし

| | 設定口数 | 解約口数 |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 2,550,538,146 | 605,233,472 |
| 第2計算期間 | 2,985,380,732 | 415,813,204 |
| 第3計算期間 | 132,050,493 | 970,484,844 |
| 第4計算期間 | 97,107,712 | 1,175,769,513 |
| 第5計算期間 | 69,202,319 | 565,501,591 |
| 第6計算期間 | 21,395,379 | 443,744,337 |
| 第7計算期間 | 91,469,027 | 454,486,316 |
| 2021年2月19日～ 2021年8月18日 | 165,643,368 | 174,173,735 |

(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】

グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ

グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間(2021年2月19日から2021年8月18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

【グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | 第7期 2021年2月18日現在 | 第8期中間計算期間末 2021年8月18日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 13,956,309 | 8,514,891 |
| 親投資信託受益証券 | 314,400,129 | 292,969,039 |
| 派生商品評価勘定 | - | 1,114,373 |
| 未収入金 | 8,000,000 | - |
| 流動資産合計 | 336,356,438 | 302,598,303 |
| 資産合計 | | |
| | 336,356,438 | 302,598,303 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 5,545,640 | - |
| 未払解約金 | 7,058,298 | - |
| 未払受託者報酬 | 47,322 | 52,399 |
| 未払委託者報酬 | 2,920,928 | 3,235,142 |
| その他未払費用 | 4,147 | 4,588 |
| 流動負債合計 | 15,576,335 | 3,292,129 |
| 負債合計 | | |
| | 15,576,335 | 3,292,129 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 240,517,775 | 219,922,832 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 80,262,328 | 79,383,342 |
| (分配準備積立金) | 68,511,612 | 57,320,959 |
| 元本等合計 | 320,780,103 | 299,306,174 |
| 純資産合計 | | |
| | 320,780,103 | 299,306,174 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 336,356,438 | 302,598,303 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第7期中間計算期間 自 2020年2月19日 至 2020年8月18日 | 第8期中間計算期間 自 2021年2月19日 至 2021年8月18日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | - | 3 |
| 有価証券売買等損益 | 5,647,789 | 21,768,910 |
| 為替差損益 | 8,232,915 | 11,353,430 |
| 営業収益合計 | 13,880,704 | 10,415,483 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 1,724 | 1,071 |
| 受託者報酬 | 41,385 | 52,399 |
| 委託者報酬 | 2,554,989 | 3,235,142 |
| その他費用 | 9,576 | 10,528 |
| 営業費用合計 | 2,607,674 | 3,299,140 |
| 営業利益又は営業損失() | 11,273,030 | 7,116,343 |
| 経常利益又は経常損失() | 11,273,030 | 7,116,343 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 11,273,030 | 7,116,343 |
| 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() | 601,945 | 886,632 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 30,203,876 | 80,262,328 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 225,230 | 6,999,796 |
| 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 | 225,230 | 6,999,796 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 3,031,155 | 14,108,493 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 3,031,155 | 14,108,493 |
| 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() | 39,272,926 | 79,383,342 |

(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8期中間計算期間 | |
|-----------------------|---|--------------|
| | 自 2021年2月19日 | 至 2021年8月18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. 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。 | |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第7期 | 第8期中間計算期間末 |
|-----------|--------------|--------------|
| | 2021年2月18日現在 | 2021年8月18日現在 |
| 1. 期首元本額 | 247,701,666円 | 240,517,775円 |
| 期中追加設定元本額 | 34,526,895円 | 21,813,451円 |
| 期中一部解約元本額 | 41,710,786円 | 42,408,394円 |
| 2. 受益権の総数 | 240,517,775口 | 219,922,832口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第7期中間計算期間 | 第8期中間計算期間 |
|---------|--|--|
| | 自 2020年2月19日 至 2020年8月18日 | 自 2021年2月19日 至 2021年8月18日 |
| 1. 委託費用 | 信託財産の運用の指図にかかわる権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 (注)当該金額は、親投資信託の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額のうち、信託財産に属する額となっております。 1,035,823円 | 信託財産の運用の指図にかかわる権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 (注)当該金額は、親投資信託の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額のうち、信託財産に属する額となっております。 1,311,569円 |

(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7期 | 第8期中間計算期間末 |
|------------------------|--|--|
| | 2021年2月18日現在 | 2021年8月18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ぬ。 | 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ぬ。 |

| | | |
|----------------------------|--|----|
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載していません。</p> <p>(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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 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 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> | 同左 |

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

| 種類 | 第7期 2021年2月18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 | 297,870,760 | - | 303,416,400 | 5,545,640 |
| アメリカ・ドル | 297,870,760 | - | 303,416,400 | 5,545,640 |
| 合計 | 297,870,760 | - | 303,416,400 | 5,545,640 |

| 種類 | 第8期中間計算期間末 2021年8月18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 | 284,821,419 | - | 283,707,046 | 1,114,373 |
| アメリカ・ドル | 284,821,419 | - | 283,707,046 | 1,114,373 |
| 合計 | 284,821,419 | - | 283,707,046 | 1,114,373 |

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 第7期 2021年2月18日現在 | 第8期中間計算期間末 2021年8月18日現在 |
|--------------|---------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,3337円 | 1,3610円 |
| (1万口当たり純資産額) | (13,337円) | (13,610円) |

【グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | 第7期 2021年2月18日現在 | 第8期中間計算期間末 2021年8月18日現在 |
|-----------------|---------------------|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 56,510,565 | 53,398,573 |
| 親投資信託受益証券 | 1,956,331,824 | 2,055,704,032 |
| 流動資産合計 | 2,012,842,389 | 2,109,102,605 |
| 資産合計 | 2,012,842,389 | 2,109,102,605 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 8,011,379 | 3,774,207 |
| 未払受託者報酬 | 322,894 | 323,010 |
| 未払委託者報酬 | 19,914,394 | 19,921,415 |
| その他未払費用 | 28,747 | 28,660 |
| 流動負債合計 | 28,277,414 | 24,047,292 |
| 負債合計 | 28,277,414 | 24,047,292 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,316,110,531 | 1,307,580,164 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 668,454,444 | 777,475,149 |
| (分配準備積立金) | 458,358,386 | 399,196,020 |
| 元本等合計 | 1,984,564,975 | 2,085,055,313 |
| 純資産合計 | 1,984,564,975 | 2,085,055,313 |
| 負債純資産合計 | 2,012,842,389 | 2,109,102,605 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第7期中間計算期間 自 2020年2月19日 至 2020年8月18日 | 第8期中間計算期間 自 2021年2月19日 至 2021年8月18日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | - | 23 |
| 有価証券売買等損益 | 26,044,531 | 126,572,208 |
| 営業収益合計 | 26,044,531 | 126,572,231 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 7,566 | 5,140 |
| 受託者報酬 | 320,735 | 323,010 |
| 委託者報酬 | 19,781,219 | 19,921,415 |
| その他費用 | 28,882 | 28,660 |
| 営業費用合計 | 20,138,402 | 20,278,225 |
| 営業利益又は営業損失() | 5,906,129 | 106,294,006 |
| 経常利益又は経常損失() | 5,906,129 | 106,294,006 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 5,906,129 | 106,294,006 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額() | 12,053,861 | 7,719,268 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 519,288,222 | 668,454,444 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,647,819 | 99,194,542 |
| 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 | 5,647,819 | 99,194,542 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 69,666,447 | 88,748,575 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 69,666,447 | 88,748,575 |
| 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() | 473,229,584 | 777,475,149 |

(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8期中間計算期間 | |
|--------------------|---|--------------|
| | 自 2021年2月19日 | 至 2021年8月18日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 | |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第7期 | 第8期中間計算期間末 |
|-----------|----------------|----------------|
| | 2021年2月18日現在 | 2021年8月18日現在 |
| 1. 期首元本額 | 1,679,127,820円 | 1,316,110,531円 |
| 期中追加設定元本額 | 91,469,027円 | 165,643,368円 |
| 期中一部解約元本額 | 454,486,316円 | 174,173,735円 |
| 2. 受益権の総数 | 1,316,110,531口 | 1,307,580,164口 |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第7期中間計算期間 | 第8期中間計算期間 |
|---------|--|--|
| | 自 2020年2月19日 至 2020年8月18日 | 自 2021年2月19日 至 2021年8月18日 |
| 1. 委託費用 | 信託財産の運用の指図にかかわる権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 (注)当該金額は、親投資信託の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額のうち、信託財産に属する額となっております。 8,019,433円 | 信託財産の運用の指図にかかわる権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 (注)当該金額は、親投資信託の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額のうち、信託財産に属する額となっております。 8,076,262円 |

(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7期 | 第8期中間計算期間末 |
|------------------------|--|--|
| | 2021年2月18日現在 | 2021年8月18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 | <p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載していません。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(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7期 2021年2月18日現在 | 第8期中間計算期間末 2021年8月18日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1,5079円 (15,079円) | 1,5946円 (15,946円) |

(参考)

「グローバルドライブ(年1回決算型)限定為替ヘッジ」、「グローバルドライブ(年1回決算型)為替ヘッジなし」は、「グローバルドライブ・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。

グローバルドライブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年8月18日現在

| | |
|-------------|---------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 23,531 |
| コール・ローン | 99,980,114 |
| 投資信託受益証券 | 12,103,084 |
| 投資証券 | 6,439,124,983 |
| 流動資産合計 | 6,551,231,712 |
| 資産合計 | 6,551,231,712 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 流動負債合計 | - |
| 負債合計 | - |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 3,497,147,671 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 3,054,084,041 |
| 元本等合計 | 6,551,231,712 |
| 純資産合計 | 6,551,231,712 |
| 負債純資産合計 | 6,551,231,712 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 項目 | 自 2021年2月19日 至 2021年8月18日 |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | 2021年8月18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 | 3,701,094,219円 |
| 同期中追加設定元本額 | 94,578,003円 |
| 同期中一部解約元本額 | 298,524,551円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| グローバルドライブ（3ヵ月決算型）限定為替ヘッジ | 205,560,971円 |
| グローバルドライブ（3ヵ月決算型）為替ヘッジなし | 2,037,824,317円 |
| グローバルドライブ（年1回決算型）限定為替ヘッジ | 156,391,950円 |
| グローバルドライブ（年1回決算型）為替ヘッジなし | 1,097,370,433円 |
| 計 | 3,497,147,671円 |
| 2. 受益権の総数 | 3,497,147,671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 | 2021年8月18日現在 |
|----------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

| | |
|----------------------------|---|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
|----------------------------|---|

(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)

| | 2021年8月18日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.8733円 |
| (1万口当たり純資産額) | (18,733円) |

「グローバルドライブ・マザーファンド」は、「ブラックロック・グローバル・ファンズ-グローバル・アロケーション・ファンド-クラスX」投資証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、すべて同投資証券であります。

同投資証券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。

「ブラックロック・グローバル・ファンズ-グローバル・アロケーション・ファンド-クラスX」は、「ブラックロック・グローバル・ファンズ-グローバル・アロケーション・ファンド」を構成する個別クラスとなっております。

「ブラックロック・グローバル・ファンズ-グローバル・アロケーション・ファンド」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

純資産計算書

2020年8月31日現在

| 区分 | 金額(米ドル) |
|----------------------|----------------|
| 資産 | |
| 有価証券ポートフォリオ(取得価額) | 11,915,869,329 |
| 未実現利益 | 2,298,622,529 |
| 有価証券ポートフォリオ(市場価額) | 14,214,491,858 |
| 銀行預金 | 210,298,839 |
| ブローカーによる債権 | 17,894,000 |
| 未收利息及び未収配当金 | 25,703,271 |
| 投資売却による未収入金 | 24,522,536 |
| ファンド投資証券発行による未収入金 | 16,394,940 |
| 外国為替予約取引にかかる未実現利益 | 36,772,516 |
| 差金決済取引にかかる未実現利益 | 803,481 |
| スワップの市場価額 | 12,071,045 |
| 買建オプション/スワップションの市場価額 | 223,264,093 |
| その他の資産 | 1,885,386 |
| 資産合計 | 14,784,101,965 |
| 負債 | |
| 銀行への債務 | 13,131,300 |
| ブローカーへの債務 | 39,244,891 |
| 未払収益分配金 | 11,372,861 |
| 投資購入による未払金 | 91,993,564 |
| ファンド投資証券償還による未払金 | 31,392,030 |
| 先物取引にかかる未実現損失 | 17,079,160 |
| 売建オプション/スワップションの市場価額 | 195,044,231 |
| その他の負債 | 20,060,776 |
| 負債合計 | 419,318,813 |
| 純資産合計 | 14,364,783,152 |

投資有価証券明細表

2020年8月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたは他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券及びマネー・マーケット商品

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|--------------------|---|--------------------|-------------|
| ファンド | | | |
| アイルランド | | | |
| 1,474,946 | iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF~ | 9,069,074 | 0.06 |
| 193,167 | iShares USD Corp Bond UCITS ETF~ | 25,015,126 | 0.18 |
| 1,847,702 | iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF~ | 187,264,598 | 1.30 |
| | | <u>221,348,798</u> | <u>1.54</u> |
| 米国 | | | |
| 1,882,564 | SPDR Gold Shares - ETF | 348,104,909 | 2.42 |
| 267,192 | SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF | 93,530,560 | 0.65 |
| | | <u>441,635,469</u> | <u>3.07</u> |
| ファンド合計 | | <u>662,984,267</u> | <u>4.61</u> |
| 普通ノ優先株式(証券) | | | |
| オーストラリア | | | |
| 22,674 | BHP Group Ltd | 633,193 | 0.01 |
| 43,608 | Brambles Ltd | 356,248 | 0.00 |
| 698 | CSL Ltd | 147,059 | 0.00 |
| 16,638 | Goodman Group (Reit) | 224,411 | 0.00 |
| 286,418 | Newcrest Mining Ltd | 6,743,128 | 0.05 |
| 4,472 | Rio Tinto Ltd | 322,836 | 0.00 |
| 17,697 | Wesfarmers Ltd | 619,484 | 0.00 |
| | | <u>9,046,359</u> | <u>0.06</u> |
| バミューダ | | | |
| 1,794,000 | Brilliance China Automotive Holdings Ltd | 1,606,486 | 0.01 |
| 418,000 | CK Infrastructure Holdings Ltd* | 2,211,339 | 0.02 |
| 69,700 | Jardine Matheson Holdings Ltd | 2,927,400 | 0.02 |
| 180,000 | Kunlun Energy Co Ltd | 134,244 | 0.00 |
| 374,226 | Marvell Technology Group Ltd | 14,276,722 | 0.10 |
| | | <u>21,156,191</u> | <u>0.15</u> |
| ブラジル | | | |
| 51,665 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao | 564,775 | 0.01 |
| 27,321 | Banco do Brasil SA | 164,552 | 0.00 |
| 22,645 | Banco Santander Brasil SA | 118,766 | 0.00 |
| 19,351 | Centrais Eletricas Brasileiras SA (Pref) | 128,250 | 0.00 |
| 15,435 | Centrais Eletricas Brasileiras SA | 101,676 | 0.00 |
| 63,568 | Engie Brasil Energia SA | 500,499 | 0.00 |
| 602,461 | Itau Unibanco Holding SA (Pref) | 2,655,666 | 0.02 |
| 480,010 | JBS SA | 1,967,706 | 0.01 |
| 240,333 | Vale SA ADR 'B' | 2,672,503 | 0.02 |
| | | <u>8,874,393</u> | <u>0.06</u> |
| カナダ | | | |
| 396,901 | Barrick Gold Corp | 11,703,553 | 0.08 |
| 7,483 | Brookfield Asset Management Inc 'A'* | 257,047 | 0.00 |
| 1,479 | CGI Inc* | 104,396 | 0.00 |
| 244 | Constellation Software Inc/Canada | 281,344 | 0.00 |
| 2,476,514 | Enbridge Inc* | 80,119,737 | 0.56 |
| 1,218 | Fairfax Financial Holdings Ltd | 377,477 | 0.00 |
| 1,080,969 | First Quantum Minerals Ltd | 10,812,627 | 0.08 |
| 5,917 | Loblaw Cos Ltd* | 310,432 | 0.00 |
| 9,606 | Manulife Financial Corp | 143,688 | 0.00 |
| 5,730 | Nutrien Ltd* | 211,313 | 0.00 |
| 4,229 | Restaurant Brands International Inc | 231,395 | 0.00 |
| 383 | Shopify Inc 'A' | 399,259 | 0.00 |
| 7,135 | Thomson Reuters Corp | 548,604 | 0.01 |
| 263,204 | Wheaton Precious Metals Corp | 14,042,705 | 0.10 |
| | | <u>119,543,577</u> | <u>0.83</u> |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|-----------|---|--------------------|-------------|
| | ケイマン諸島 | | |
| 5,012 | 58.com Inc ADR | 279,068 | 0.00 |
| 435,000 | AAC Technologies Holdings Inc | 2,744,690 | 0.02 |
| 90,000 | Agile Group Holdings Ltd* | 124,257 | 0.00 |
| 128,100 | Alibaba Group Holding Ltd* | 4,674,376 | 0.03 |
| 167,909 | Alibaba Group Holding Ltd ADR † | 47,909,475 | 0.33 |
| 470,000 | ANTA Sports Products Ltd* | 4,642,353 | 0.03 |
| 3,359 | Baidu Inc ADR | 425,014 | 0.00 |
| 229,000 | China Feihe Ltd | 463,906 | 0.00 |
| 220,000 | China Resources Cement Holdings Ltd | 320,772 | 0.00 |
| 47,379 | Country Garden Services Holdings Co Ltd* | 330,428 | 0.00 |
| 368,500 | Dali Foods Group Co Ltd | 225,853 | 0.00 |
| 344,000 | Haidilao International Holding Ltd | 2,219,339 | 0.02 |
| 92,000 | Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd | 436,255 | 0.00 |
| 107,088 | Huazhu Group Ltd ADR | 4,786,834 | 0.03 |
| 15,035 | JD.com Inc ADR | 1,187,915 | 0.01 |
| 226,905 | KE Holdings Inc ADR* | 11,293,062 | 0.08 |
| 4,411,000 | Kingdee International Software Group Co Ltd* | 11,246,545 | 0.08 |
| 452,382 | Li Auto Inc ADR | 8,197,162 | 0.06 |
| 24,500 | Li Ning Co Ltd | 103,690 | 0.00 |
| 132,600 | Meituan Dianping | 4,373,202 | 0.03 |
| 27,912 | Momo Inc ADR | 581,686 | 0.00 |
| 13,459 | NetEase Inc ADR † | 6,661,532 | 0.05 |
| 21,460 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 3,207,197 | 0.02 |
| 82,000 | Silergy Corp | 5,212,073 | 0.04 |
| 1,142,800 | Tencent Holdings Ltd* | 78,225,935 | 0.55 |
| 188,000 | Tingyi Cayman Islands Holding Corp | 353,195 | 0.00 |
| 212,002 | Trip.com Group Ltd ADR | 6,455,461 | 0.05 |
| 15,418 | Vipshop Holdings Ltd ADR | 261,952 | 0.00 |
| 2,951,000 | Want Want China Holdings Ltd* | 2,025,704 | 0.02 |
| 2,709,000 | WH Group Ltd | 2,338,462 | 0.02 |
| 170,500 | Wuxi Biologics Cayman Inc | 4,430,768 | 0.03 |
| 152,000 | Yihai International Holding Ltd* | 2,388,834 | 0.02 |
| | | <u>218,126,995</u> | <u>1.52</u> |
| | チリ | | |
| 30,129 | Cia Cervecerias Unidas SA ADR | 405,536 | 0.00 |
| | 中国 | | |
| 614,608 | Aier Eye Hospital Group Co Ltd | 4,663,756 | 0.03 |
| 197,300 | Amoy Diagnostics Co Ltd | 2,506,577 | 0.02 |
| 30,500 | Anhui Conch Cement Co Ltd 'H' | 221,173 | 0.00 |
| 10,900 | Anhui Gujing Distillery Co Ltd | 138,394 | 0.00 |
| 87,530 | Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd | 3,501,808 | 0.02 |
| 136,300 | Autobio Diagnostics Co Ltd | 3,207,885 | 0.02 |
| 276,000 | China CITIC Bank Corp Ltd 'H' | 115,385 | 0.00 |
| 715,000 | China Merchants Bank Co Ltd 'H'* | 3,413,524 | 0.02 |
| 168,000 | China National Building Material Co Ltd 'H' | 236,282 | 0.00 |
| 994,000 | China Oilfield Services Ltd 'H' | 781,086 | 0.01 |
| 2,028,000 | China Telecom Corp Ltd 'H' | 664,656 | 0.01 |
| 692,000 | CRRC Corp Ltd 'H' | 312,514 | 0.00 |
| 319,492 | Glodon Co Ltd | 3,250,521 | 0.02 |
| 279,200 | Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai | 2,221,758 | 0.02 |
| 186,600 | Guangdong Marubi Biotechnology Co Ltd | 2,097,912 | 0.02 |
| 908,180 | Guangzhou Automobile Group Co Ltd | 1,376,430 | 0.01 |
| 2,060,000 | Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H' | 1,770,258 | 0.01 |
| 1,813,200 | Guangzhou Baiyun International Airport Co Ltd | 4,029,445 | 0.03 |
| 572,299 | Haier Smart Home Co Ltd | 1,863,428 | 0.01 |
| 207,200 | Haitong Securities Co Ltd 'H' | 188,216 | 0.00 |
| 1,365,800 | Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd | 7,462,352 | 0.05 |
| 614,300 | Hangzhou Robam Appliances Co Ltd | 3,498,082 | 0.02 |
| 127,679 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd | 2,087,961 | 0.02 |
| 192,000 | Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd 'H' | 3,143,822 | 0.02 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|-----------|---|--------------------|-------------|
| 703,482 | Han's Laser Technology Industry Group Co Ltd | 3,816,924 | 0.03 |
| 123,209 | Hundsun Technologies Inc | 2,004,788 | 0.01 |
| 4,992,000 | Industrial & Commercial Bank of China Ltd 'H' | 2,795,500 | 0.02 |
| 422,891 | Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd | 2,589,654 | 0.02 |
| 312,700 | Inspur Electronic Information Industry Co Ltd | 1,648,238 | 0.01 |
| 129,000 | Jiangxi Copper Co Ltd 'H' | 152,136 | 0.00 |
| 13,400 | Kweichow Moutai Co Ltd | 3,495,366 | 0.02 |
| 23,900 | Offcn Education Technology Co Ltd | 124,616 | 0.00 |
| 404,000 | PICC Property & Casualty Co Ltd 'H' | 312,251 | 0.00 |
| 273,800 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd | 3,063,095 | 0.02 |
| 380,782 | Shanghai International Airport Co Ltd | 4,247,708 | 0.03 |
| 3,400 | Shenzhen Goodix Technology Co Ltd | 88,837 | 0.00 |
| 367,100 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd | 2,990,911 | 0.02 |
| 366,500 | Venus MedTech Hangzhou Inc 'H' | 2,965,082 | 0.02 |
| 633,407 | Venustech Group Inc | 3,527,349 | 0.03 |
| 331,186 | Wuhan Raycus Fiber Laser Technologies Co Ltd | 3,701,707 | 0.03 |
| 20,900 | Wuhu Sanqi Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd | 139,124 | 0.00 |
| 138,835 | WuXi AppTec Co Ltd | 2,228,030 | 0.02 |
| 255,840 | Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd | 3,765,424 | 0.03 |
| 344,360 | Yonyou Network Technology Co Ltd | 2,107,246 | 0.02 |
| 167,800 | Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd | 271,222 | 0.00 |
| 25,200 | Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd 'H' | 80,964 | 0.00 |
| | | <u>98,869,397</u> | <u>0.69</u> |
| | キュラソー | | |
| 17,558 | Schlumberger NV | 335,533 | 0.00 |
| | デンマーク | | |
| 191 | AP Moller - Maersk A/S 'B'* | 293,682 | 0.00 |
| 72,501 | DSV PANALPINA A/S | 11,275,536 | 0.08 |
| 8,487 | Genmab A/S | 3,168,568 | 0.02 |
| | | <u>14,737,786</u> | <u>0.10</u> |
| | フィンランド | | |
| 29,496 | Fortum Oyj | 627,948 | 0.00 |
| 754,346 | Neste Oyj | 40,279,143 | 0.28 |
| 517,159 | Nokia Oyj | 2,527,660 | 0.02 |
| | | <u>43,434,751</u> | <u>0.30</u> |
| | フランス | | |
| 217,283 | Arkema SA* | 24,183,715 | 0.17 |
| 18,011 | AXA SA | 367,931 | 0.00 |
| 55,581 | Carrefour SA | 897,568 | 0.01 |
| 95,126 | Cie de Saint-Gobain | 3,868,799 | 0.03 |
| 1,146,779 | Danone SA | 75,362,252 | 0.53 |
| 48,529 | Eiffage SA | 4,503,016 | 0.03 |
| 25,772 | Engie SA | 358,401 | 0.00 |
| 257,625 | EssilorLuxottica SA | 34,674,652 | 0.24 |
| 14,523 | Kering SA | 8,923,901 | 0.06 |
| 77,593 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 36,559,239 | 0.26 |
| 30,000 | Orange SA* | 335,834 | 0.00 |
| 15,516 | Pernod Ricard SA | 2,669,427 | 0.02 |
| 476,043 | Safran SA | 56,367,723 | 0.39 |
| 697,564 | Sanofi | 70,292,972 | 0.49 |
| 4,611 | Schneider Electric SE* | 573,316 | 0.00 |
| 4,330 | TOTAL SE* | 172,358 | 0.00 |
| 21,891 | Vivendi SA* | 623,741 | 0.00 |
| | | <u>320,734,845</u> | <u>2.23</u> |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|------------|--|-------------|------------|
| | ドイツ | | |
| 206,152 | adidas AG | 62,894,205 | 0.44 |
| 10,058 | Bayer AG | 669,493 | 0.01 |
| 5,325 | Deutsche Boerse AG | 1,004,728 | 0.01 |
| 20,691 | Deutsche Post AG | 940,713 | 0.01 |
| 3,584,389 | Deutsche Telekom AG* | 63,526,727 | 0.44 |
| 8,910 | Evonik Industries AG* | 259,399 | 0.00 |
| 9,031 | Fresenius SE & Co KGaA | 416,948 | 0.00 |
| 3,562 | Henkel AG & Co KGaA | 323,509 | 0.00 |
| 26,288 | Infineon Technologies AG | 726,451 | 0.01 |
| 1,042,355 | Siemens AG | 144,981,046 | 1.01 |
| 2,175 | Volkswagen AG (Pref)* | 363,948 | 0.00 |
| 143,919 | Vonovia SE | 10,312,657 | 0.07 |
| | | 286,419,824 | 2.00 |
| | 香港 | | |
| 7,185,400 | AIA Group Ltd | 73,985,904 | 0.52 |
| 44,500 | Beijing Enterprises Holdings Ltd | 141,538 | 0.00 |
| 116,000 | China Mobile Ltd* | 810,497 | 0.01 |
| 726,500 | China Resources Pharmaceutical Group Ltd | 411,524 | 0.00 |
| 250,000 | China Resources Power Holdings Co Ltd | 296,772 | 0.00 |
| 534,000 | China Unicom Hong Kong Ltd | 378,276 | 0.00 |
| 297,500 | CLP Holdings Ltd | 2,923,156 | 0.02 |
| 177,000 | CNOOC Ltd | 201,436 | 0.00 |
| 1,978,000 | Hang Lung Properties Ltd | 5,576,643 | 0.04 |
| 1,937,000 | HKT Trust & HKT Ltd | 2,769,265 | 0.02 |
| 457,000 | Hysan Development Co Ltd* | 1,444,699 | 0.01 |
| 336,000 | Lenovo Group Ltd | 224,577 | 0.00 |
| 1,864,582 | Sun Hung Kai Properties Ltd | 25,069,424 | 0.18 |
| | | 114,233,711 | 0.80 |
| | インド | | |
| 2,911 | HDFC Asset Management Co Ltd | 95,345 | 0.00 |
| 58,871 | Hindustan Unilever Ltd | 1,693,449 | 0.01 |
| 95,726 | NTPC Ltd | 125,367 | 0.00 |
| 446,267 | Petronet LNG Ltd | 1,457,192 | 0.01 |
| 1,991,986 | Reliance Industries Ltd | 56,308,464 | 0.39 |
| 190,427 | Reliance Industries Ltd | 3,087,656 | 0.02 |
| 211,457 | Vedanta Ltd | 369,581 | 0.01 |
| 24,833 | Wipro Ltd | 91,529 | 0.00 |
| 947,185 | Zee Entertainment Enterprises Ltd | 2,619,292 | 0.02 |
| | | 65,847,875 | 0.46 |
| | インドネシア | | |
| 2,073,500 | Bank Central Asia Tbk PT | 4,467,369 | 0.03 |
| | アイルランド | | |
| 2,332 | Aon Plc | 466,587 | 0.00 |
| 5,834 | Eaton Corp Plc | 596,643 | 0.01 |
| 8,231 | Medtronic Plc | 882,857 | 0.01 |
| 609 | Willis Towers Watson Plc | 125,119 | 0.00 |
| | | 2,071,206 | 0.02 |
| | イタリア | | |
| 13,264,912 | Enel SpA* | 120,079,449 | 0.84 |
| 2,369,964 | RAI Way SpA | 15,348,436 | 0.11 |
| 949,765 | Snam SpA | 4,908,258 | 0.03 |
| 9,582,214 | UniCredit SpA* | 95,244,937 | 0.66 |
| | | 235,581,080 | 1.64 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|-----------|--------------------------------------|--------------------|-------------|
| | 日本 | | |
| 1,991,700 | Ajinomoto Co Inc* | 37,103,791 | 0.26 |
| 25,400 | Asahi Kasei Corp | 213,123 | 0.00 |
| 2,649,600 | Astellas Pharma Inc* | 41,578,760 | 0.29 |
| 35,300 | Canon Inc* | 609,688 | 0.01 |
| 349,661 | East Japan Railway Co* | 22,736,041 | 0.16 |
| 1,700 | Eisai Co Ltd* | 148,491 | 0.00 |
| 10,900 | FamilyMart Co Ltd* | 241,491 | 0.00 |
| 5,400 | FUJIFILM Holdings Corp* | 256,891 | 0.00 |
| 1,300 | Fujitsu Ltd | 169,379 | 0.00 |
| 9,800 | Hitachi Ltd* | 326,143 | 0.00 |
| 413,391 | Hoya Corp | 40,590,810 | 0.28 |
| 281,500 | KDDI Corp | 8,168,728 | 0.06 |
| 19,300 | Keyence Corp | 7,947,808 | 0.06 |
| 49,199 | Maeda Road Construction Co Ltd* | 907,262 | 0.01 |
| 40,700 | Marubeni Corp | 245,420 | 0.00 |
| 14,600 | Mitsubishi Corp* | 345,833 | 0.00 |
| 451,000 | Mitsubishi Estate Co Ltd | 7,064,547 | 0.05 |
| 32,100 | Mitsubishi Heavy Industries Ltd* | 796,977 | 0.01 |
| 534,120 | Murata Manufacturing Co Ltd | 31,623,207 | 0.22 |
| 3,900 | NEC Corp* | 205,534 | 0.00 |
| 600 | Nintendo Co Ltd | 320,958 | 0.00 |
| 295,160 | Nippon Telegraph & Telephone Corp | 6,710,458 | 0.05 |
| 21,000 | Nomura Holdings Inc | 107,801 | 0.00 |
| 26,400 | NTT Data Corp* | 301,657 | 0.00 |
| 5,100 | Olympus Corp* | 100,923 | 0.00 |
| 4,600 | Otsuka Holdings Co Ltd | 201,963 | 0.00 |
| 29,900 | Panasonic Corp | 275,660 | 0.00 |
| 38,600 | Rakuten Inc* | 339,529 | 0.00 |
| 7,600 | Sekisui House Ltd | 150,180 | 0.00 |
| 16,400 | Seven & i Holdings Co Ltd* | 530,793 | 0.01 |
| 374,794 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd* | 45,528,619 | 0.32 |
| 3,000 | Shionogi & Co Ltd | 166,390 | 0.00 |
| 4,900 | Shiseido Co Ltd | 285,075 | 0.00 |
| 5,800 | Sompo Holdings Inc* | 217,630 | 0.00 |
| 1,041,710 | Subaru Corp* | 21,630,680 | 0.15 |
| 720,248 | Suzuki Motor Corp* | 29,531,050 | 0.21 |
| 1,300 | Tokyo Electron Ltd* | 332,752 | 0.00 |
| | | <u>308,012,042</u> | <u>2.15</u> |
| | ジャージー | | |
| 581,389 | Aptiv Plc | 50,133,173 | 0.35 |
| 81,781 | Aptiv Plc (Pref) | 9,118,582 | 0.07 |
| 3,898 | Experian Plc | 144,872 | 0.00 |
| 76,160 | Ferguson Plc | 7,483,154 | 0.05 |
| 98,867 | Glencore Plc | 222,811 | 0.00 |
| | | <u>67,102,592</u> | <u>0.47</u> |
| | メキシコ | | |
| 41,747 | Fomento Economico Mexicano SAB de CV | 243,750 | 0.00 |
| 161,626 | Grupo Bimbo SAB de CV | 302,836 | 0.00 |
| | | <u>546,586</u> | <u>0.00</u> |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|---------------|----------------------------------|-------------|------------|
| オランダ | | | |
| 19,713 | Adyen NV | 33,162,583 | 0.23 |
| 827,989 | Akzo Nobel NV | 81,569,378 | 0.57 |
| 211,832 | ASML Holding NV | 79,305,886 | 0.55 |
| 25,123 | Fiat Chrysler Automobiles NV | 279,680 | 0.00 |
| 7,152,948 | ING Groep NV | 58,975,844 | 0.41 |
| 1,350,254 | Koninklijke Philips NV | 64,078,443 | 0.45 |
| 387,467 | NXP Semiconductors NV | 48,619,359 | 0.34 |
| 1,705 | Prosus NV | 171,588 | 0.00 |
| 50,800 | STMicroelectronics NV | 1,524,393 | 0.01 |
| 1,080,510 | Unilever NV | 63,094,679 | 0.44 |
| 1,746 | Wolters Kluwer NV | 144,061 | 0.00 |
| | | 430,925,894 | 3.00 |
| ポーランド | | | |
| 11,381 | Polski Koncern Naftowy ORLEN SA | 158,285 | 0.00 |
| ポルトガル | | | |
| 169,111 | Jeronimo Martins SGPS SA* | 2,778,344 | 0.02 |
| シンガポール | | | |
| 11,601,550 | CapitaLand Ltd | 23,616,019 | 0.16 |
| 1,762,400 | ComfortDelGro Corp Ltd* | 1,916,801 | 0.01 |
| 282,700 | DBS Group Holdings Ltd | 4,335,699 | 0.03 |
| 411,900 | Singapore Telecommunications Ltd | 696,195 | 0.01 |
| 490,300 | United Overseas Bank Ltd | 7,047,606 | 0.05 |
| | | 37,612,320 | 0.26 |
| 南アフリカ | | | |
| 4,229 | Anglo American Platinum Ltd* | 320,748 | 0.00 |
| 8,753 | AngloGold Ashanti Ltd | 260,160 | 0.00 |
| 117,426 | MTN Group Ltd* | 425,988 | 0.01 |
| | | 1,006,896 | 0.01 |
| 韓国 | | | |
| 800 | Celltrion Inc | 200,017 | 0.00 |
| 853 | Hyundai Mobis Co Ltd | 160,849 | 0.00 |
| 30,253 | Kakao Corp | 10,365,326 | 0.07 |
| 3,938 | KB Financial Group Inc | 122,161 | 0.00 |
| 11,932 | Kia Motors Corp | 426,394 | 0.01 |
| 14,002 | LG Chem Ltd | 8,722,519 | 0.06 |
| 5,156 | LG Electronics Inc | 365,464 | 0.00 |
| 12,042 | LG Uplus Corp | 121,140 | 0.00 |
| 8,802 | NCSOFT Corp | 6,113,015 | 0.04 |
| 12,681 | POSCO | 1,969,563 | 0.02 |
| 278 | Samsung Biologics Co Ltd | 182,073 | 0.00 |
| 8,644 | Shinhan Financial Group Co Ltd | 215,754 | 0.00 |
| 1,076 | SK Telecom Co Ltd | 224,638 | 0.00 |
| | | 29,188,913 | 0.20 |
| スペイン | | | |
| 787,976 | Cellnex Telecom SA | 50,392,086 | 0.35 |
| 4,890 | Grifols SA* | 131,983 | 0.00 |
| 84,714 | Repsol SA | 680,985 | 0.01 |
| 132,914 | Telefonica SA* | 530,102 | 0.00 |
| | | 51,735,156 | 0.36 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|-----------|---|-------------|------------|
| | スウェーデン | | |
| 21,613 | Assa Abloy AB | 502,807 | 0.00 |
| 76,873 | Atlas Copco AB | 3,582,108 | 0.03 |
| 5,203 | Essity AB* | 180,631 | 0.00 |
| 116,771 | Hexagon AB | 8,464,789 | 0.06 |
| 12,303 | Sandvik AB | 242,267 | 0.00 |
| 572,921 | Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 6,684,157 | 0.05 |
| 3,826,009 | Volvo AB | 73,789,991 | 0.51 |
| | | <hr/> | |
| | | 93,446,750 | 0.65 |
| | スイス | | |
| 9,832 | Alcon Inc* | 563,759 | 0.00 |
| 97,560 | Alcon Inc* | 5,596,042 | 0.04 |
| 197,359 | Chubb Ltd | 24,612,641 | 0.17 |
| 5,220 | LafargeHolcim Ltd | 249,021 | 0.00 |
| 174 | Lonza Group AG | 107,593 | 0.00 |
| 476,584 | Nestle SA | 57,683,137 | 0.40 |
| 14,878 | Novartis AG | 1,282,933 | 0.01 |
| 271,517 | Roche Holding AG | 94,003,649 | 0.66 |
| 157 | SGS SA | 409,082 | 0.00 |
| 45,091 | Sika AG* | 10,825,261 | 0.08 |
| | | <hr/> | |
| | | 195,333,118 | 1.36 |
| | 台湾 | | |
| 63,000 | ASE Technology Holding Co Ltd | 131,404 | 0.00 |
| 41,000 | Asustek Computer Inc | 339,553 | 0.00 |
| 1,698,000 | Cathay Financial Holding Co Ltd | 2,306,130 | 0.02 |
| 871,000 | Chunghwa Telecom Co Ltd | 3,220,815 | 0.02 |
| 758,000 | Formosa Chemicals & Fibre Corp | 1,751,527 | 0.01 |
| 404,000 | Formosa Petrochemical Corp | 1,129,050 | 0.01 |
| 673,000 | Formosa Plastics Corp | 1,793,658 | 0.01 |
| 1,847,000 | Fubon Financial Holding Co Ltd | 2,694,192 | 0.02 |
| 965,600 | Hon Hai Precision Industry Co Ltd | 2,530,704 | 0.02 |
| 135,000 | MediaTek Inc | 2,558,152 | 0.02 |
| 919,000 | Nan Ya Plastics Corp | 1,926,231 | 0.01 |
| 153,000 | Nanya Technology Corp | 270,631 | 0.00 |
| 8,751,000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 127,202,177 | 0.89 |
| 1,357,000 | Uni-President Enterprises Corp | 3,080,150 | 0.02 |
| 954,000 | United Microelectronics Corp | 689,290 | 0.01 |
| 311,000 | Yageo Corp | 3,529,575 | 0.02 |
| | | <hr/> | |
| | | 155,153,239 | 1.08 |
| | タイ | | |
| 525,900 | Advanced Info Service PCL | 3,092,286 | 0.02 |
| 1,692,600 | Intouch Holdings PCL | 2,963,986 | 0.02 |
| 2,001,900 | Thai Beverage PCL | 904,749 | 0.01 |
| | | <hr/> | |
| | | 6,961,021 | 0.05 |
| | トルコ | | |
| 10,211 | BIM Birllesik Magazalar AS | 94,321 | 0.00 |
| 41,123 | Tupras Turkiye Petrol Rafinerileri AS* | 453,427 | 0.00 |
| | | <hr/> | |
| | | 547,748 | 0.00 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|------------|---|-------------|------------|
| | 英国 | | |
| 116,612 | Anglo American Plc | 2,846,740 | 0.02 |
| 19,968 | AstraZeneca Plc | 2,218,388 | 0.01 |
| 134,999 | Berkeley Group Holdings Plc | 8,198,549 | 0.06 |
| 192,036 | BHP Group Plc | 4,381,533 | 0.03 |
| 3,828 | Coca-Cola European Partners Plc | 159,053 | 0.00 |
| 29,496 | Diageo Plc | 986,023 | 0.01 |
| 40,685 | GlaxoSmithKline Plc | 797,772 | 0.01 |
| 52,222 | HSBC Holdings Plc* | 229,669 | 0.00 |
| 21,474 | Imperial Brands Plc | 358,427 | 0.00 |
| 252,854 | RELX Plc | 5,734,477 | 0.04 |
| 69,859 | Rio Tinto Plc | 4,313,293 | 0.03 |
| 20,513 | Royal Dutch Shell Plc | 302,437 | 0.00 |
| 29,705 | Royal Dutch Shell Plc | 420,629 | 0.00 |
| 522,164 | Unilever Plc | 31,022,630 | 0.22 |
| 41,616,792 | Vodafone Group Plc | 61,779,805 | 0.43 |
| | | 123,749,425 | 0.86 |
| | 米国 | | |
| 20,940 | 2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust (Pref) | 22,928,253 | 0.16 |
| 627,039 | Abbott Laboratories | 69,494,732 | 0.48 |
| 834,163 | AbbVie Inc | 79,095,336 | 0.55 |
| 56,542 | Adobe Inc | 28,950,069 | 0.20 |
| 3,428 | Advanced Micro Devices Inc | 294,328 | 0.00 |
| 467,130 | Agilent Technologies Inc* | 46,783,069 | 0.33 |
| 373,334 | Air Products & Chemicals Inc | 109,969,263 | 0.77 |
| 35,237 | Alaska Air Group Inc | 1,407,013 | 0.01 |
| 28,412 | Alexion Pharmaceuticals Inc | 3,262,266 | 0.02 |
| 5,725 | Allstate Corp/The | 534,543 | 0.00 |
| 2,682 | Alphabet Inc | 4,407,170 | 0.03 |
| 132,635 | Alphabet Inc | 217,951,137 | 1.52 |
| 160,775 | Altair Engineering Inc 'A' * | 6,829,722 | 0.05 |
| 90,545 | Amazon.com Inc† | 310,696,113 | 2.16 |
| 5,795 | American Electric Power Co Inc | 456,994 | 0.00 |
| 42,885 | American Tower Corp (Reit) | 10,683,940 | 0.08 |
| 34,497 | American Water Works Co Inc | 4,895,124 | 0.03 |
| 1,096 | Amgen Inc | 276,324 | 0.00 |
| 16,594 | Analog Devices Inc | 1,951,620 | 0.01 |
| 270,411 | Anthem Inc | 75,285,127 | 0.52 |
| 79,156 | Apellis Pharmaceuticals Inc* | 2,328,770 | 0.02 |
| 2,339,228 | Apple Inc | 299,631,715 | 2.09 |
| 761,941 | Applied Materials Inc | 47,087,954 | 0.33 |
| 196,118 | Autodesk Inc | 47,744,927 | 0.33 |
| 296 | AutoZone Inc | 352,530 | 0.00 |
| 2,907,946 | Bank of America Corp | 75,286,722 | 0.52 |
| 15,487 | Bank of New York Mellon Corp/The | 570,773 | 0.00 |
| 71,273 | Baxter International Inc | 6,177,944 | 0.04 |
| 192,066 | Becton Dickinson and Co | 46,614,418 | 0.33 |
| 206,700 | Becton Dickinson and Co (Pref) | 11,143,197 | 0.08 |
| 86,956 | Berkshire Hathaway Inc 'B' | 18,947,712 | 0.13 |
| 37,943 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 2,925,785 | 0.02 |
| 234 | Booking Holdings Inc | 447,174 | 0.00 |
| 855,362 | Boston Scientific Corp* | 34,958,645 | 0.24 |
| 54,071 | Boston Scientific Corp (Pref) | 6,340,906 | 0.05 |
| 787,986 | Bristol-Myers Squibb Co | 48,996,969 | 0.34 |
| 12,727 | Broadcom Inc | 4,400,488 | 0.03 |
| 79,093 | Cadence Design Systems Inc | 8,754,804 | 0.06 |
| 897,017 | Capital One Financial Corp | 62,961,623 | 0.44 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|-----------|---|-------------|------------|
| 7,204 | Cardinal Health Inc | 362,505 | 0.00 |
| 5,690 | Cerner Corp | 412,525 | 0.00 |
| 78,222 | CH Robinson Worldwide Inc* | 7,682,183 | 0.05 |
| 608,300 | Charles Schwab Corp/The* | 21,637,231 | 0.15 |
| 189,500 | Charter Communications Inc† | 117,368,720 | 0.82 |
| 16,941 | Ciena Corp | 953,609 | 0.01 |
| 2,349 | Cigna Corp | 424,629 | 0.00 |
| 387,410 | Citigroup Capital XIII (Pref) | 10,452,322 | 0.07 |
| 619,766 | Citigroup Inc | 31,871,467 | 0.22 |
| 3,150 | CME Group Inc | 556,006 | 0.00 |
| 3,759 | Cognizant Technology Solutions Corp | 251,703 | 0.00 |
| 130,265 | Colgate-Palmolive Co | 10,330,015 | 0.07 |
| 2,599,612 | Comcast Corp | 116,852,559 | 0.81 |
| 2,262 | Constellation Brands Inc 'A' | 417,633 | 0.00 |
| 4,646 | Corteva Inc | 134,223 | 0.00 |
| 109,210 | Costco Wholesale Corp | 37,960,304 | 0.27 |
| 124,650 | Crowdstrike Holdings Inc | 15,391,782 | 0.11 |
| 3,480 | Crown Castle International Corp (Reit)* | 569,258 | 0.00 |
| 784 | Cummins Inc | 162,758 | 0.00 |
| 18,259 | Deckers Outdoor Corp | 3,804,080 | 0.03 |
| 8,528 | DexCom Inc* | 3,557,285 | 0.03 |
| 1,827 | Dollar General Corp | 369,310 | 0.00 |
| 1,190,414 | DR Horton Inc* | 85,483,629 | 0.60 |
| 4,716 | DuPont de Nemours Inc | 264,190 | 0.00 |
| 18,725 | eBay Inc | 1,009,839 | 0.01 |
| 178,799 | Edwards Lifesciences Corp | 15,070,968 | 0.11 |
| 2,419 | Electronic Arts Inc | 338,563 | 0.00 |
| 3,985 | Eli Lilly and Co | 589,621 | 0.00 |
| 866,572 | Emerson Electric Co | 60,382,737 | 0.42 |
| 4,350 | Exelon Corp | 161,211 | 0.00 |
| 263,452 | Facebook Inc 'A' | 77,204,609 | 0.54 |
| 663 | FedEx Corp | 147,120 | 0.00 |
| 12,025 | FirstEnergy Corp | 341,630 | 0.00 |
| 3,080 | Fiserv Inc | 308,277 | 0.00 |
| 25,227 | FleetCor Technologies Inc | 6,432,885 | 0.05 |
| 68,932 | Fortinet Inc | 9,034,917 | 0.06 |
| 826,535 | Fortive Corp | 59,477,459 | 0.41 |
| 80,995 | Fortune Brands Home & Security Inc* | 6,849,747 | 0.05 |
| 746,657 | Freeport-McMoRan Inc* | 11,647,849 | 0.08 |
| 5,395 | General Motors Co | 161,796 | 0.00 |
| 435,024 | Gilead Sciences Inc | 28,537,574 | 0.20 |
| 278,073 | Global Payments Inc* | 49,152,183 | 0.34 |
| 428,665 | GMAC Capital Trust I (Pref) | 10,502,293 | 0.07 |
| 4,838 | Goldman Sachs Group Inc/The | 991,016 | 0.01 |
| 77,971 | Guardant Health Inc* | 7,556,170 | 0.05 |
| 465,658 | HCA Healthcare Inc | 63,427,276 | 0.44 |
| 181,299 | Hess Corp | 8,332,502 | 0.06 |
| 51,445 | Hewlett Packard Enterprise Co | 503,904 | 0.00 |
| 274,819 | Home Depot Inc/The | 78,117,301 | 0.54 |
| 26,476 | HP Inc | 527,137 | 0.00 |
| 6,980 | Humana Inc | 2,856,844 | 0.02 |
| 7,242 | Illumina Inc* | 2,568,448 | 0.02 |
| 1,758 | Incyte Corp | 166,852 | 0.00 |
| 8,416 | Inphi Corp | 936,701 | 0.01 |
| 9,747 | Insulet Corp* | 2,101,648 | 0.02 |
| 66,915 | Intel Corp | 3,383,892 | 0.02 |
| 1,688 | Intercontinental Exchange Inc | 178,227 | 0.00 |
| 455,499 | International Flavors & Fragrances Inc* | 56,568,421 | 0.39 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|-----------|-------------------------------------|-------------|------------|
| 45,635 | Intuit Inc | 15,724,908 | 0.11 |
| 26,791 | Intuitive Surgical Inc* † | 19,376,323 | 0.14 |
| 52,745 | Iovance Biotherapeutics Inc | 1,714,213 | 0.01 |
| 5,220 | IQVIA Holdings Inc | 845,431 | 0.01 |
| 624,940 | Johnson & Johnson | 95,659,566 | 0.67 |
| 1,069,882 | JPMorgan Chase & Co | 108,427,191 | 0.76 |
| 35,534 | Kinder Morgan Inc | 495,344 | 0.00 |
| 7,752 | Kroger Co/The | 273,878 | 0.00 |
| 652,552 | L3Harris Technologies Inc | 117,903,095 | 0.82 |
| 335,184 | Lennar Corp | 25,098,578 | 0.18 |
| 10,706 | Liberty Broadband Corp | 1,518,967 | 0.01 |
| 344,314 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | 12,636,324 | 0.09 |
| 606,918 | Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM | 22,122,161 | 0.15 |
| 27,364 | Live Nation Entertainment Inc* | 1,587,112 | 0.01 |
| 590,048 | Lowe's Cos Inc | 97,399,223 | 0.68 |
| 1,424 | Madison Square Garden Sports Corp | 242,052 | 0.00 |
| 638,372 | Marsh & McLennan Cos Inc | 72,825,478 | 0.51 |
| 208,982 | Masco Corp | 12,196,190 | 0.09 |
| 377,828 | Mastercard Inc | 137,049,550 | 0.95 |
| 348,051 | McDonald's Corp | 74,385,460 | 0.52 |
| 1,375 | McKesson Corp | 210,004 | 0.00 |
| 761,442 | Merck & Co Inc | 65,118,520 | 0.45 |
| 51,985 | MGM Resorts International* | 1,197,215 | 0.01 |
| 319,182 | Microchip Technology Inc* | 34,934,470 | 0.24 |
| 351,292 | Micron Technology Inc | 15,924,066 | 0.11 |
| 1,392,652 | Microsoft Corp | 316,633,359 | 2.21 |
| 130,891 | Mondelez International Inc* | 7,630,945 | 0.05 |
| 1,079 | Moody's Corp | 316,406 | 0.00 |
| 2,388,301 | Morgan Stanley* | 125,218,621 | 0.87 |
| 80,088 | Motorola Solutions Inc | 12,281,495 | 0.09 |
| 4,980 | NCB Warrant Holding | - | 0.00 |
| 835 | Netflix Inc | 433,507 | 0.00 |
| 14,851 | Nevro Corp* | 2,046,022 | 0.02 |
| 50,139 | New Relic Inc* | 3,088,061 | 0.02 |
| 188,520 | Newmont Goldcorp Corp | 12,625,184 | 0.09 |
| 416,722 | NextEra Energy Inc | 117,826,062 | 0.82 |
| 1,344 | Northern Trust Corp | 110,719 | 0.00 |
| 220,030 | NortonLifeLock Inc | 5,248,816 | 0.04 |
| 142,028 | NVIDIA Corp | 74,556,178 | 0.52 |
| 46,167 | Okta Inc* | 9,834,033 | 0.07 |
| 210,071 | Oracle Corp | 12,076,982 | 0.08 |
| 261 | O'Reilly Automotive Inc | 121,934 | 0.00 |
| 16,253 | Otis Worldwide Corp | 1,030,115 | 0.01 |
| 42,787 | Palo Alto Networks Inc | 10,962,029 | 0.08 |
| 10,745 | Paycom Software Inc | 3,235,534 | 0.02 |
| 266,912 | PayPal Holdings Inc | 54,185,805 | 0.38 |
| 413,700 | Peloton Interactive Inc | 31,830,078 | 0.22 |
| 71,001 | PepsiCo Inc | 10,002,621 | 0.07 |
| 1,294,174 | Pfizer Inc | 48,777,418 | 0.34 |
| 573,824 | PPG Industries Inc | 69,031,027 | 0.48 |
| 7,955 | Procter & Gamble Co/The | 1,100,733 | 0.01 |
| 30,750 | Proofpoint Inc* | 3,400,643 | 0.02 |
| 5,360 | Prudential Financial Inc | 365,123 | 0.00 |
| 172,934 | PTC Inc | 15,731,806 | 0.11 |
| 26,186 | PTC Therapeutics Inc* | 1,280,495 | 0.01 |
| 1,955 | Public Storage (Reit) | 417,197 | 0.00 |
| 61,184 | QUALCOMM Inc | 7,261,929 | 0.05 |
| 29,635 | ResMed Inc* | 5,283,921 | 0.04 |
| 853 | Rockwell Automation Inc | 195,909 | 0.00 |
| 434,801 | salesforce.com Inc | 117,657,151 | 0.82 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % |
|-----------|------------------------------------|---------------|------------|
| 23,757 | Sarepta Therapeutics Inc* | 3,492,754 | 0.03 |
| 8,981 | SBA Communications Corp (Reit) 'A' | 2,758,514 | 0.02 |
| 34,874 | Seattle Genetics Inc | 5,358,041 | 0.04 |
| 2,488 | Sempra Energy* | 307,517 | 0.00 |
| 72,321 | ServiceNow Inc* | 35,281,077 | 0.25 |
| 209 | Sherwin-Williams Co/The | 140,655 | 0.00 |
| 132,586 | Simply Good Foods Co/The* | 3,317,302 | 0.02 |
| 55,967 | Simply Good Foods Co/The* | 1,400,294 | 0.01 |
| 7,013 | Southern Co/The (Unit) | 367,271 | 0.00 |
| 74,877 | Southwest Airlines Co | 2,869,287 | 0.02 |
| 62,452 | Splunk Inc* | 13,597,049 | 0.10 |
| 3,219 | Stanley Black & Decker Inc* | 520,802 | 0.00 |
| 998,690 | Starbucks Corp | 84,479,187 | 0.59 |
| 28,837 | Stryker Corp | 5,668,777 | 0.04 |
| 5,063 | Target Corp | 767,120 | 0.01 |
| 610 | Tesla Inc | 277,815 | 0.00 |
| 159,017 | Thermo Fisher Scientific Inc† | 67,951,144 | 0.47 |
| 1,771 | Thor Industries Inc | 173,168 | 0.00 |
| 994,514 | TJX Cos Inc/The | 55,304,924 | 0.39 |
| 71,288 | T-Mobile US Inc | 8,319,310 | 0.06 |
| 57,766 | Travelers Cos Inc/The | 6,648,289 | 0.05 |
| 5,795 | Tyson Foods Inc 'A' | 364,563 | 0.00 |
| 1,198,825 | Uber Technologies Inc* | 40,256,544 | 0.28 |
| 639,091 | Union Pacific Corp* | 124,207,336 | 0.87 |
| 2,715 | United Parcel Service Inc 'B' | 439,857 | 0.00 |
| 456,892 | UnitedHealth Group Inc | 144,286,494 | 1.01 |
| 287,225 | US Bancorp | 10,523,924 | 0.07 |
| 737 | Vail Resorts Inc | 159,037 | 0.00 |
| 3,254 | VeriSign Inc | 687,147 | 0.01 |
| 115,995 | Verizon Communications Inc | 6,887,783 | 0.05 |
| 104,879 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 28,612,040 | 0.20 |
| 89,209 | Visa Inc 'A'* | 19,095,186 | 0.13 |
| 311,808 | Vistra Corp* | 6,036,603 | 0.04 |
| 302,462 | VMware Inc* | 45,290,660 | 0.32 |
| 472,569 | Walmart Inc | 64,647,439 | 0.45 |
| 223,674 | Walt Disney Co/The | 29,941,002 | 0.21 |
| 195,354 | Wells Fargo & Co | 4,751,986 | 0.03 |
| 3,520 | Wells Fargo & Co (Pref) | 4,843,520 | 0.03 |
| 106,252 | Western Digital Corp | 4,037,576 | 0.03 |
| 192,182 | Weyerhaeuser Co (Reit) | 5,875,004 | 0.04 |
| 4,952 | Williams Cos Inc/The* | 103,398 | 0.00 |
| 2,779 | Winnebago Industries Inc* | 161,015 | 0.00 |
| 2,575 | Workday Inc 'A' | 631,545 | 0.01 |
| 79,059 | Wynn Resorts Ltd | 7,087,639 | 0.05 |
| 224,851 | Xilinx Inc | 23,393,498 | 0.16 |
| 101,166 | Yum China Holdings Inc* | 5,946,537 | 0.04 |
| 3,124 | Yum! Brands Inc | 301,279 | 0.00 |
| 75,523 | Zillow Group Inc 'C'* | 6,442,867 | 0.05 |
| 1,008 | Zimmer Biomet Holdings Inc | 141,614 | 0.00 |
| 53,054 | Zoetis Inc | 8,472,193 | 0.06 |
| 1,375 | Zoom Video Communications Inc | 419,334 | 0.00 |
| 67,588 | Zscaler Inc | 9,763,087 | 0.07 |
| | | 5,674,133,923 | 39.50 |
| | 普通/優先株式(証券)合計 | 8,742,278,680 | 60.86 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|----------------|-------------|---|--------------------|----------------|
| 債券 | | | | |
| アルゼンチン | | | | |
| EUR | 7,137,000 | Argentine Republic Government International Bond (Restricted) 3.375% 15/1/2023 | 3,968,780 | 0.03 |
| EUR | 1,681,000 | Argentine Republic Government International Bond (Restricted) 5.25% 15/1/2028 | 872,127 | 0.01 |
| USD | 19,781,000 | Argentine Republic Government International Bond (Restricted) 5.875% 11/1/2028 | 8,851,997 | 0.06 |
| USD | 20,155,000 | Argentine Republic Government International Bond (Restricted) 6.875% 26/1/2027 | 9,079,198 | 0.06 |
| EUR | 7,575,568 | Argentine Republic Government International Bond (Restricted) 7.82% 31/12/2033 | 4,585,364 | 0.03 |
| | | | <u>27,357,466</u> | <u>0.19</u> |
| オーストラリア | | | | |
| AUD | 112,085,000 | Australia Government Bond 3% 21/3/2047 | 103,105,105 | 0.72 |
| USD | 246,000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.75% 15/5/2022 | 254,850 | 0.00 |
| USD | 168,000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15/3/2023 | 177,588 | 0.00 |
| USD | 253,000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15/5/2024 | 274,848 | 0.00 |
| | | | <u>103,812,391</u> | <u>0.72</u> |
| オーストリア | | | | |
| USD | 250,000 | JBS Investments II GmbH '144A' 5.75% 15/1/2028 | 264,465 | 0.00 |
| USD | 341,000 | JBS Investments II GmbH '144A' 7% 15/1/2026 | 369,448 | 0.01 |
| | | | <u>633,913</u> | <u>0.01</u> |
| バーレーン | | | | |
| USD | 1,644,000 | Bahrain Government International Bond 6.75% 20/9/2029 | 1,861,573 | 0.01 |
| ブラジル | | | | |
| BRL | 706,490 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027 | 15,130,713 | 0.11 |
| USD | 1,857,000 | Brazilian Government International Bond 3.875% 12/6/2030 | 1,901,568 | 0.01 |
| USD | 1,669,000 | Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island 3.25% 24/1/2025 | 1,711,247 | 0.01 |
| | | | <u>18,743,528</u> | <u>0.13</u> |
| カナダ | | | | |
| USD | 789,000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 5% 15/10/2025 | 810,062 | 0.01 |
| USD | 451,000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.5% 1/11/2025 | 465,770 | 0.01 |
| USD | 134,000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.75% 15/8/2027 | 144,681 | 0.00 |
| USD | 1,369,000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 6.25% 15/2/2029 | 1,418,887 | 0.01 |
| USD | 206,000 | Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US Corp '144A' 6.25% 15/9/2027 | 209,567 | 0.00 |
| USD | 433,000 | Masonite International Corp '144A' 5.375% 1/2/2028 | 465,124 | 0.00 |
| USD | 2,854,000 | Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 1/3/2030 | 2,951,664 | 0.02 |
| USD | 1,560,000 | MEGlobal Canada ULC 5.875% 18/5/2030 | 1,883,213 | 0.01 |
| | | | <u>8,348,968</u> | <u>0.06</u> |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|---|-------------------|----------------|
| | ケイマン諸島 | | |
| USD | 15,900,000 China Milk Products Group Ltd (Restricted) (Defaulted) 5/1/2012 (Zero Coupon) | 23,850 | 0.00 |
| USD | 1,719,000 Fibria Overseas Finance Ltd 5.5% 17/1/2027 | 1,911,044 | 0.02 |
| USD | 247,000 MGM China Holdings Ltd '144A' 5.375% 15/5/2024 | 257,189 | 0.00 |
| USD | 250,000 MGM China Holdings Ltd '144A' 5.875% 15/5/2026 | 265,000 | 0.00 |
| USD | 318,609 Tryon Park CLO Ltd FRN 15/4/2029 | 316,921 | 0.00 |
| USD | 200,000 Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 1/10/2024 | 201,250 | 0.00 |
| | | <u>2,975,254</u> | <u>0.02</u> |
| | チリ | | |
| USD | 756,000 Corp Nacional del Cobre de Chile 4.25% 17/7/2042 | 859,359 | 0.01 |
| USD | 2,515,000 Corp Nacional del Cobre de Chile 4.25% 17/7/2042 | 2,858,848 | 0.02 |
| USD | 1,748,000 Empresa Nacional del Petroleo 4.5% 14/9/2047 | 1,931,267 | 0.01 |
| USD | 1,605,000 Falabella SA 4.375% 27/1/2025 | 1,726,378 | 0.01 |
| | | <u>7,375,852</u> | <u>0.05</u> |
| | 中国 | | |
| CNY | 1,118,260,000 China Government Bond 3.29% 23/5/2029 | 165,267,178 | 1.15 |
| | コロンビア | | |
| USD | 1,559,000 Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029 | 1,755,824 | 0.01 |
| USD | 3,279,000 Ecopetrol SA 6.875% 29/4/2030 | 3,957,753 | 0.03 |
| | | <u>5,713,577</u> | <u>0.04</u> |
| | ドミニカ共和国 | | |
| USD | 1,924,000 Dominican Republic International Bond 4.5% 30/1/2030 | 1,901,453 | 0.02 |
| USD | 1,686,000 Dominican Republic International Bond 5.5% 27/1/2025 | 1,768,456 | 0.01 |
| USD | 1,322,000 Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026 | 1,463,289 | 0.01 |
| | | <u>5,133,198</u> | <u>0.04</u> |
| | エジプト | | |
| USD | 1,851,000 Egypt Government International Bond 7.6003% 1/3/2029 | 1,949,913 | 0.01 |
| | フランス | | |
| USD | 6,979,000 BNP Paribas SA '144A' FRN 12/8/2035 | 6,929,966 | 0.05 |
| EUR | 14,300,000 Quatrim SASU 5.875% 15/1/2024 | 17,076,588 | 0.12 |
| | | <u>24,006,554</u> | <u>0.17</u> |
| | ドイツ | | |
| EUR | 15,130,249 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/8/2050 (Zero Coupon) | 17,648,486 | 0.13 |
| EUR | 2,518,000 Vertical Holdco GmbH '144A' 6.625% 15/7/2028 | 3,136,688 | 0.02 |
| EUR | 3,802,000 Vertical Midco GmbH '144A' 4.375% 15/7/2027 | 4,660,321 | 0.03 |
| | | <u>25,445,495</u> | <u>0.18</u> |
| | ギリシャ | | |
| EUR | 27,204,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 2% 22/4/2027 | 35,044,452 | 0.24 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|----------------|---|--------------------|----------------|
| | | インドネシア | | |
| USD | 1,568,000 | Indonesia Government International Bond 4.2% 15/10/2050 | 1,856,120 | 0.01 |
| USD | 1,536,000 | Indonesia Government International Bond 6.625% 17/2/2037 | 2,191,270 | 0.02 |
| USD | 3,336,000 | Pertamina Persero PT 3.65% 30/7/2029 | 3,578,076 | 0.02 |
| | | | <u>7,625,466</u> | <u>0.05</u> |
| | | アイルランド | | |
| EUR | 250,000 | Anchorage Capital Europe CLO 2 DAC FRN 15/5/2031 | 297,433 | 0.00 |
| EUR | 275,000 | Aqueduct European CLO 4-2019 DAC FRN 15/7/2032 | 328,055 | 0.00 |
| EUR | 250,000 | Arbour CLO II DAC 'Series 2014-2X B2R' FRN 15/5/2030 | 295,954 | 0.00 |
| EUR | 116,000 | Avoca CLO XV DAC FRN 15/4/2031 | 133,794 | 0.00 |
| EUR | 250,000 | Avoca CLO XVII Designated Activity Co FRN 15/10/2032 | 298,798 | 0.00 |
| EUR | 249,000 | Avoca CLO XVII Designated Activity Co FRN 15/10/2032 | 297,120 | 0.00 |
| EUR | 280,000 | Cairn CLO XII DAC FRN 15/4/2033 | 333,949 | 0.01 |
| EUR | 404,000 | Harvest CLO XVIII DAC FRN 15/10/2030 | 471,500 | 0.01 |
| EUR | 280,000 | OAK Hill European Credit Partners VI DAC FRN 20/1/2032 | 327,236 | 0.00 |
| EUR | 472,000 | OCP Euro CLO 2017-2 DAC FRN 15/1/2032 | 555,650 | 0.01 |
| EUR | 280,000 | Sound Point Euro CLO II Funding DAC FRN 26/10/2032 | 333,624 | 0.00 |
| EUR | 148,000 | Voya Euro CLO II DAC FRN 15/7/2032 | 175,199 | 0.00 |
| | | | <u>3,848,312</u> | <u>0.03</u> |
| | | イスラエル | | |
| USD | 1,855,873 | Leviathan Bond Ltd '144A' 5.75% 30/6/2023 | 1,927,788 | 0.01 |
| | | イタリア | | |
| EUR | 75,754,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.95% 1/8/2030 | 89,981,904 | 0.63 |
| EUR | 90,725,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.35% 1/4/2030* | 111,669,150 | 0.78 |
| EUR | 45,666,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.85% 1/9/2049* | 76,908,896 | 0.53 |
| USD | 3,614,000 | UniCredit SpA '144A' FRN 30/6/2035 | 3,739,852 | 0.03 |
| | | | <u>282,299,802</u> | <u>1.97</u> |
| | | 日本 | | |
| JPY | 13,657,150,000 | Japan Government Thirty Year Bond 0.4% 20/9/2049 | 122,171,425 | 0.85 |
| JPY | 3,701,100,000 | Japan Treasury Discount Bill 7/9/2020 (Zero Coupon) | 34,893,361 | 0.24 |
| JPY | 8,168,600,000 | Japan Treasury Discount Bill 14/9/2020 (Zero Coupon) | 77,013,293 | 0.54 |
| JPY | 9,355,750,000 | Japan Treasury Discount Bill 12/10/2020 (Zero Coupon) | 88,213,333 | 0.61 |
| USD | 4,132,000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.175% 9/7/2050 | 4,212,008 | 0.03 |
| | | | <u>326,503,420</u> | <u>2.27</u> |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|---|------------|----------------|
| | ルクセンブルグ | | |
| USD | 13,594,000 Intelsat Jackson Holdings SA '144A' 8% 15/2/2024 | 13,820,476 | 0.10 |
| USD | 502,000 JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc '144A' 6.5% 15/4/2029 | 572,185 | 0.00 |
| | | 14,392,661 | 0.10 |
| | マレーシア | | |
| USD | 1,364,000 Petronas Capital Ltd '144A' 4.55% 21/4/2050 | 1,801,333 | 0.01 |
| | メキシコ | | |
| USD | 3,324,000 Comision Federal de Electricidad 4.75% 23/2/2027 | 3,570,184 | 0.03 |
| USD | 4,373,000 Mexico Government International Bond 4.75% 27/4/2032 | 4,994,102 | 0.03 |
| USD | 3,599,000 Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027 | 3,562,043 | 0.03 |
| | | 12,126,329 | 0.09 |
| | オランダ | | |
| EUR | 103,000 Ares European CLO X BV FRN 15/10/2031 | 121,694 | 0.00 |
| USD | 1,646,000 MDGH - GMTN BV '144A' 3.7% 7/11/2049 | 1,810,600 | 0.01 |
| USD | 565,000 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc '144A' 3.15% 1/5/2027 | 617,487 | 0.01 |
| USD | 380,000 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc '144A' 3.4% 1/5/2030 | 420,262 | 0.00 |
| USD | 1,605,000 Petrobras Global Finance BV 5.299% 27/1/2025 | 1,755,720 | 0.01 |
| USD | 3,284,000 Petrobras Global Finance BV 5.6% 3/1/2031 | 3,503,617 | 0.03 |
| EUR | 25,365,000 Ziggo BV 2.875% 15/1/2030 | 29,926,868 | 0.21 |
| | | 38,156,248 | 0.27 |
| | パナマ | | |
| USD | 1,247,000 Panama Government International Bond 6.7% 26/1/2036 | 1,851,210 | 0.01 |
| | パラグアイ | | |
| USD | 1,559,000 Paraguay Government International Bond '144A' 4.95% 28/4/2031 | 1,824,030 | 0.01 |
| | ペルー | | |
| USD | 1,824,000 Orazul Energy Egenor SCA 5.625% 28/4/2027 | 1,910,355 | 0.01 |
| | カタール | | |
| USD | 1,376,000 Qatar Government International Bond '144A' 4.4% 16/4/2050 | 1,781,920 | 0.01 |
| | ルーマニア | | |
| USD | 4,278,000 Romanian Government International Bond '144A' 4% 14/2/2051 | 4,342,170 | 0.03 |
| USD | 1,310,000 Romanian Government International Bond '144A' 6.125% 22/1/2044 | 1,734,522 | 0.01 |
| | | 6,076,692 | 0.04 |
| | ロシア連邦 | | |
| USD | 1,400,000 Russian Foreign Bond - Eurobond 5.25% 23/6/2047 | 1,902,688 | 0.01 |
| | サウジアラビア | | |
| USD | 1,801,000 Saudi Arabian Oil Co 4.25% 16/4/2039 | 2,089,164 | 0.02 |
| USD | 1,553,000 Saudi Government International Bond 4.625% 4/10/2047 | 1,909,220 | 0.01 |
| | | 3,998,384 | 0.03 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|------------|---|-------------|----------------|
| | | シンガポール | | |
| SGD | 9,000,000 | CapitaLand Ltd 1.95% 17/10/2023 | 6,569,192 | 0.05 |
| | | スペイン | | |
| USD | 1,800,000 | Banco Santander SA 2.746% 28/5/2025 | 1,912,098 | 0.01 |
| USD | 600,000 | Banco Santander SA 3.49% 28/5/2030 | 655,466 | 0.01 |
| EUR | 80,105,000 | Spain Government Bond '144A' 0.6% 31/10/2029 | 98,270,773 | 0.68 |
| EUR | 19,158,000 | Spain Government Bond '144A' 1% 31/10/2050 | 21,618,398 | 0.15 |
| EUR | 10,928,000 | Spain Government Bond '144A' 1.25% 31/10/2030 | 14,174,979 | 0.10 |
| EUR | 8,500,000 | Spain Government Bond '144A' 2.7% 31/10/2048 | 13,853,121 | 0.10 |
| | | | 150,484,835 | 1.05 |
| | | スイス | | |
| USD | 5,770,000 | UBS Group AG 4.125% 24/9/2025* | 6,621,183 | 0.05 |
| | | ウクライナ | | |
| USD | 2,974,000 | Ukraine Government International Bond '144A' 7.253% 15/3/2033* | 2,985,152 | 0.02 |
| USD | 1,628,000 | Ukraine Government International Bond '144A' 7.75% 1/9/2025 | 1,724,907 | 0.01 |
| | | | 4,710,059 | 0.03 |
| | | アラブ首長国連邦 | | |
| USD | 1,340,000 | DP World Plc 6.85% 2/7/2037 | 1,713,106 | 0.01 |
| | | 英国 | | |
| EUR | 9,839,000 | Ellaktor Value Plc '144A' 6.375% 15/12/2024 | 9,232,659 | 0.06 |
| USD | 3,870,000 | Ferguson Finance Plc '144A' 3.25% 2/6/2030 | 4,124,781 | 0.03 |
| USD | 2,010,000 | HSBC Holdings Plc 4.95% 31/3/2030 | 2,474,806 | 0.02 |
| USD | 292,000 | International Game Technology Plc '144A' 6.25% 15/2/2022 | 301,757 | 0.00 |
| USD | 398,000 | International Game Technology Plc '144A' 6.5% 15/2/2025 | 434,065 | 0.00 |
| GBP | 9,199,000 | Lloyds Bank Plc FRN 22/1/2029 (Perpetual) | 21,172,073 | 0.15 |
| USD | 3,802,000 | Natwest Group Plc FRN 28/11/2035 | 3,776,641 | 0.03 |
| | | | 41,516,782 | 0.29 |
| | | 米国 | | |
| USD | 2,640,000 | 1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 'Series 2015-1211 D' '144A' FRN 10/8/2035 | 2,758,302 | 0.02 |
| USD | 3,859,000 | AbbVie Inc '144A' 4.25% 21/11/2049 | 4,597,107 | 0.03 |
| USD | 1,700,000 | Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.5% 1/7/2028 | 1,768,000 | 0.01 |
| USD | 940,000 | AGL CLO 7 Ltd 'Series 2020-7A A1' '144A' FRN 15/7/2031 | 940,000 | 0.01 |
| USD | 950,000 | AGL Core CLO 5 Ltd 'Series 2020-5A A2' '144A' FRN 20/7/2030 | 951,284 | 0.01 |
| USD | 1,250,000 | AGL Core CLO 5 Ltd 'Series 2020-5A B' '144A' FRN 20/7/2030 | 1,258,544 | 0.01 |
| USD | 278,501 | AIMCO CLO Series 2018-A 'Series 2018-AA B' '144A' FRN 17/4/2031 | 274,063 | 0.00 |
| USD | 261,000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.5% 15/2/2023 | 266,611 | 0.00 |
| USD | 1,204,000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 5.75% 15/3/2025 | 1,242,101 | 0.01 |
| USD | 413,000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 6.625% 15/6/2024 | 427,579 | 0.00 |
| USD | 215,000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 7.5% 15/3/2026 | 241,509 | 0.00 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|---|------------|----------------|
| USD | 281,664 ALM XVIII Ltd 'Series 2016-18A A2R' '144A' FRN 15/1/2028 | 275,964 | 0.00 |
| USD | 259,000 AMC Networks Inc 4.75% 1/8/2025 | 268,924 | 0.00 |
| USD | 327,000 AMC Networks Inc 5% 1/4/2024 | 333,744 | 0.00 |
| USD | 5,545,000 American Express Co FRN 15/12/2020 (Perpetual) | 5,151,416 | 0.04 |
| USD | 5,874,000 American Tower Corp 3.1% 15/6/2050 | 5,992,933 | 0.04 |
| USD | 1,085,000 Apidos CLO XV 'Series 2013- 15A A1RR' '144A' ' FRN 20/4/2031 | 1,069,245 | 0.01 |
| USD | 165,000 Aramark Services Inc 4.75% 1/6/2026 | 163,829 | 0.00 |
| USD | 385,000 Aramark Services Inc '144A' 5% 1/2/2028 | 383,885 | 0.00 |
| USD | 500,000 Ares XXIX CLO Ltd 'Series 2014-1A BR' '144A' ' FRN 17/4/2026 | 496,889 | 0.00 |
| USD | 418,056 Atrium XII '144A' FRN 22/4/2027 | 408,264 | 0.00 |
| USD | 400,000 Atrium XIII '144A' FRN 21/11/2030 | 391,225 | 0.00 |
| USD | 1,820,000 AutoNation Inc 4.75% 1/6/2030 | 2,126,461 | 0.02 |
| USD | 2,150,000 Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15/7/2028 | 2,287,062 | 0.02 |
| USD | 510,000 Avantor Inc '144A' 6% 1/10/2024 | 535,066 | 0.00 |
| USD | 975,000 Bain Capital Credit CLO 2020- 2 Ltd 'Series 2020-2A B1' '144A' FRN 19/7/2031 | 976,036 | 0.01 |
| USD | 1,805,000 Ball Corp 2.875% 15/8/2030 | 1,802,744 | 0.01 |
| USD | 951,190 BANK 2017-BNK8 'Series 2017-BNK8 B' FRN 15/11/2050 | 1,059,668 | 0.01 |
| USD | 1,210,000 BANK 2017-BNK9 'Series 2017-BNK9 A4' 3.538% 15/11/2054 | 1,376,839 | 0.01 |
| USD | 11,300,000 Bank of America Corp FRN 29/4/2031 | 11,997,455 | 0.08 |
| USD | 4,493,000 Bank of America Corp 4% 22/1/2025 | 5,026,849 | 0.04 |
| USD | 2,951,000 BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 'Series 2018- TALL C' '144A' FRN 15/3/2037 | 2,780,505 | 0.02 |
| USD | 1,109,000 Becton Dickinson and Co 2.823% 20/5/2030 | 1,200,692 | 0.01 |
| USD | 1,415,000 Becton Dickinson and Co 3.794% 20/5/2050 | 1,582,251 | 0.01 |
| USD | 1,391,000 Bemis Co Inc 2.63% 19/6/2030 | 1,493,143 | 0.01 |
| USD | 692,631 Benefit Street Partners CLO II Ltd 'Series 2013-IIA A1R' '144A' FRN 15/7/2029 | 688,379 | 0.01 |
| USD | 688,158 Benefit Street Partners Clo XII Ltd 'Series 2017-12A A1' '144A' FRN 15/10/2030 | 684,625 | 0.01 |
| USD | 277,299 BlueMountain CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1R' '144A' FRN 22/10/2030 | 273,596 | 0.00 |
| USD | 279,432 BlueMountain CLO 2014-2 Ltd 'Series 2014-2A BR2' '144A' FRN 20/10/2030 | 276,266 | 0.00 |
| USD | 459,000 Boise Cascade Co '144A' 4.875% 1/7/2030 | 497,005 | 0.00 |
| USD | 1,882,000 BorgWarner Inc 2.65% 1/7/2027 | 1,991,555 | 0.01 |
| USD | 825,000 Boyd Gaming Corp '144A' 8.625% 1/6/2025 | 912,664 | 0.01 |
| USD | 2,773,000 BP Capital Markets America Inc 1.749% 10/8/2030 | 2,746,370 | 0.02 |
| USD | 990,000 Broadcom Inc 3.15% 15/11/2025 | 1,073,688 | 0.01 |
| USD | 2,650,000 Broadcom Inc 4.15% 15/11/2030 | 2,979,960 | 0.02 |
| USD | 3,544,000 Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 1/3/2025 | 3,570,509 | 0.03 |
| USD | 718,000 Buckeye Partners LP 4.35% 15/10/2024 | 716,654 | 0.01 |
| USD | 1,225,000 BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013- 1515 D' '144A' 3.633% 10/3/2033 | 1,244,175 | 0.01 |
| USD | 800,000 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA 'Series 2018-BIOA D' '144A' FRN 15/3/2037 | 786,667 | 0.01 |
| USD | 1,900,128 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA 'Series 2018-BIOA F' '144A' FRN 15/3/2037 | 1,839,620 | 0.01 |
| USD | 1,542,800 BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND 'Series 2018-IND G' '144A' FRN 15/11/2035 | 1,529,736 | 0.01 |
| USD | 679,000 BY Crown Parent LLC / BY Bond Finance Inc ' 144A' 4.25% 31/1/2026 | 695,313 | 0.01 |
| USD | 12,945,000 Caesars Entertainment Inc '144A' 6.25% 1/7/2025 | 13,673,092 | 0.10 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|-----------|--|------------|----------------|
| USD | 4,918,000 | Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 1/7/2027 | 5,206,662 | 0.04 |
| USD | 2,648,000 | Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A' 5.75% 1/7/2025 | 2,763,850 | 0.02 |
| USD | 368,556 | California Street CLO XII Ltd 'Series 2013-12A CR' '144A' FRN 15/10/2025 | 362,862 | 0.00 |
| USD | 789,000 | Calpine Corp '144A' 5.125% 15/3/2028 | 831,539 | 0.01 |
| USD | 2,641,000 | Carrier Global Corp '144A' 3.577% 5/4/2050 | 2,780,235 | 0.02 |
| USD | 541,794 | Catskill Park CLO Ltd 'Series 2017-1A A1B' ' 144A' FRN 20/4/2029 | 535,092 | 0.00 |
| USD | 527,428 | CD 2017-CD6 Mortgage Trust 'Series 2017-CD6 B ' FRN 13/11/2050 | 567,758 | 0.00 |
| USD | 166,000 | Cedar Fair LP 5.25% 15/7/2029 | 161,716 | 0.00 |
| USD | 169,000 | Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15/4/2027 | 169,000 | 0.00 |
| USD | 825,000 | Centene Corp 4.25% 15/12/2027 | 868,160 | 0.01 |
| USD | 4,819,000 | Centene Corp 4.75% 15/1/2025 | 4,969,594 | 0.04 |
| USD | 369,000 | Centene Corp '144A' 5.25% 1/4/2025 | 382,930 | 0.00 |
| USD | 5,392,000 | Centene Corp '144A' 5.375% 1/6/2026 | 5,702,040 | 0.04 |
| USD | 249,000 | Centene Corp '144A' 5.375% 15/8/2026 | 263,862 | 0.00 |
| USD | 2,012,625 | CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC ' Series 2017-BIOC E' '144A' FRN 15/7/2032 | 1,972,537 | 0.01 |
| USD | 171,000 | Charles River Laboratories International Inc ' 144A' 5.5% 1/4/2026 | 180,902 | 0.00 |
| USD | 9,634,000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.8% 1/4/2031 | 10,141,262 | 0.07 |
| USD | 692,352 | Chenango Park CLO Ltd 'Series 2018-1A A2' ' 144A' FRN 15/4/2030 | 678,662 | 0.01 |
| USD | 1,281,000 | Cheniere Energy Partners LP 5.25% 1/10/2025 | 1,311,103 | 0.01 |
| USD | 369,000 | Cheniere Energy Partners LP 5.625% 1/10/2026 | 386,310 | 0.00 |
| USD | 201,000 | Churchill Downs Inc '144A' 5.5% 1/4/2027 | 211,013 | 0.00 |
| USD | 1,152,231 | CIFC Funding 2017-III Ltd 'Series 2017-3A A1' '144A' FRN 20/7/2030 | 1,148,460 | 0.01 |
| USD | 387,293 | CIFC Funding 2017-III Ltd 'Series 2017-3A A2' '144A' FRN 20/7/2030 | 384,283 | 0.00 |
| USD | 852,528 | CIFC Funding 2017-IV Ltd 'Series 2017-4A A1' '144A' FRN 24/10/2030 | 850,298 | 0.01 |
| USD | 315,306 | CIFC Funding 2018-II Ltd 'Series 2018-2A A1' '144A' FRN 20/4/2031 | 312,402 | 0.00 |
| USD | 3,402,740 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23 'Series 2014-GC23 AS' 3.863% 10/7/2047 | 3,676,103 | 0.03 |
| USD | 1,223,900 | Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C6 ' Series 2018-C6 A4' 4.412% 10/11/2051 | 1,477,938 | 0.01 |
| USD | 7,657,000 | Citigroup Inc FRN 15/11/2020 (Perpetual) | 7,584,373 | 0.05 |
| USD | 5,332,000 | Citigroup Inc FRN 31/3/2031 | 6,467,168 | 0.05 |
| USD | 3,316,000 | Citigroup Inc FRN 26/3/2041 | 4,621,940 | 0.03 |
| USD | 1,014,000 | Clark Equipment Co '144A' 5.875% 1/6/2025 | 1,070,404 | 0.01 |
| USD | 177,000 | Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15/7/2027 | 185,551 | 0.00 |
| USD | 250,000 | Clear Creek CLO 'Series 2015- 1A AR' '144A' FRN 20/10/2030 | 247,656 | 0.00 |
| USD | 205,000 | Colfax Corp '144A' 6% 15/2/2024 | 213,734 | 0.00 |
| USD | 2,434,721 | COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 'Series 2014- CR21 A3' 3.528% 10/12/2047 | 2,633,731 | 0.02 |
| USD | 1,320,000 | CommScope Inc '144A' 7.125% 1/7/2028 | 1,409,192 | 0.01 |
| USD | 692,561 | Cook Park CLO Ltd 'Series 2018-1A B' '144A' FRN 17/4/2030 | 673,871 | 0.01 |
| USD | 6,139,000 | Crown Castle International Corp 4.15% 1/7/2050 | 7,201,280 | 0.05 |

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|--|------------|----------------|
| USD | 381,000 CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15/10/2025 | 379,095 | 0.00 |
| USD | 2,013,000 CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15/2/2031 | 1,987,837 | 0.01 |
| USD | 5,785,000 CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 1/12/2030 | 6,023,863 | 0.04 |
| USD | 11,186,000 CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 1/12/2030 | 11,509,108 | 0.08 |
| USD | 804,000 CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 1/2/2028 | 864,626 | 0.01 |
| USD | 2,350,000 CSC Holdings LLC '144A' 5.5% 15/5/2026 | 2,467,500 | 0.02 |
| USD | 2,310,000 CVS Health Corp 2.7% 21/8/2040 | 2,236,153 | 0.02 |
| USD | 3,923,000 CVS Health Corp 3.75% 1/4/2030 | 4,517,578 | 0.03 |
| USD | 3,908,000 CVS Health Corp 5.05% 25/3/2048 | 5,048,330 | 0.04 |
| USD | 169,000 Darling Ingredients Inc '144A' 5.25% 15/4/2027 | 179,842 | 0.00 |
| USD | 18,836,000 DaVita Inc '144A' 3.75% 15/2/2031 | 18,777,137 | 0.13 |
| USD | 8,340,000 DaVita Inc '144A' 4.625% 1/6/2030 | 8,806,414 | 0.06 |
| USD | 1,010,000 DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 'Series 2018- GLKS C' '144A' FRN 19/12/2030 | 945,562 | 0.01 |
| USD | 4,184,000 Dow Chemical Co/The 3.625% 15/5/2026 | 4,677,907 | 0.03 |
| USD | 164,000 Elanco Animal Health Inc 4.912% 27/8/2021 | 169,227 | 0.00 |
| USD | 254,000 Elanco Animal Health Inc 5.272% 28/8/2023 | 281,464 | 0.00 |
| USD | 228,000 Emergent BioSolutions Inc '144A' 3.875% 15/8/2028 | 233,449 | 0.00 |
| USD | 163,000 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.5% 30/1/2026 | 162,931 | 0.00 |
| USD | 334,000 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.75% 30/1/2028 | 341,036 | 0.00 |
| USD | 1,205,000 Energizer Holdings Inc '144A' 4.75% 15/6/2028 | 1,260,936 | 0.01 |
| USD | 2,568,000 Energy Transfer Operating LP 4.05% 15/3/2025 | 2,742,134 | 0.02 |
| USD | 3,957,000 ERAC USA Finance LLC '144A' 3.8% 1/11/2025 | 4,422,656 | 0.03 |
| USD | 425,000 ESH Hospitality Inc '144A' 5.25% 1/5/2025 | 431,471 | 0.00 |
| USD | 4,484,000 Exxon Mobil Corp 3.452% 15/4/2051 | 4,986,300 | 0.04 |
| USD | 1,335,000 Fannie Mae-Aces 'Series 2018- M13 A2' FRN 25/9/2030 | 1,633,236 | 0.01 |
| USD | 750,000 Figueroa CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A CR' '144A' FRN 15/1/2027 | 730,248 | 0.01 |
| USD | 312,587 Flatiron CLO 18 Ltd 'Series 2018-1A A' '144A' ' FRN 17/4/2031 | 307,549 | 0.00 |
| USD | 3,842,000 FLIR Systems Inc 2.5% 1/8/2030 | 3,925,379 | 0.03 |
| USD | 2,571,000 Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17/8/2027* | 2,581,220 | 0.02 |
| USD | 1,426,000 Ford Motor Credit Co LLC 5.125% 16/6/2025 | 1,499,453 | 0.01 |
| USD | 6,116,000 Forestar Group Inc '144A' 5% 1/3/2028 | 6,222,082 | 0.04 |
| USD | 1,648,000 Forestar Group Inc '144A' 8% 15/4/2024 | 1,754,947 | 0.01 |
| USD | 1,361,000 Freeport-McMoRan Inc 4.625% 1/8/2030 | 1,457,257 | 0.01 |
| USD | 789,000 Freeport-McMoRan Inc 5% 1/9/2027 | 837,508 | 0.01 |
| USD | 1,545,000 General Electric Co 4.35% 1/5/2050 | 1,561,765 | 0.01 |
| USD | 6,575,000 General Mills Inc 2.875% 15/4/2030 | 7,247,976 | 0.05 |
| USD | 2,765,000 General Motors Co 6.8% 1/10/2027 | 3,378,925 | 0.02 |
| USD | 5,238,000 General Motors Financial Co Inc 2.7% 20/8/2027 | 5,230,593 | 0.04 |
| USD | 4,896,000 General Motors Financial Co Inc 3.6% 21/6/2030 | 5,097,763 | 0.04 |
| USD | 2,625,000 General Motors Financial Co Inc 5.2% 20/3/2023 | 2,860,109 | 0.02 |
| USD | 5,790,000 Georgia-Pacific LLC '144A' 2.3% 30/4/2030 | 6,135,212 | 0.04 |
| USD | 4,023,000 Global Payments Inc 2.9% 15/5/2030 | 4,318,580 | 0.03 |
| USD | 5,273,000 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4% 15/1/2031 | 5,480,809 | 0.04 |
| USD | 8,832,000 Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2/10/2020 (Perpetual) | 8,794,742 | 0.06 |
| USD | 3,945,000 Goldman Sachs Group Inc/The 2.6% 7/2/2030 | 4,192,437 | 0.03 |
| USD | 905,000 Goldman Sachs Group Inc/The 4.75% 21/10/2045 | 1,199,058 | 0.01 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|------------|---|------------|----------------|
| USD | 2,125,000 | GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ' Series 2014-GRCE B ' ' 144A ' 3.52% 10/6/2028 | 2,140,521 | 0.02 |
| USD | 351,000 | Graham Packaging Co Inc ' 144A ' 7.125% 15/8/2028 | 368,769 | 0.00 |
| USD | 2,114,000 | Great Western Petroleum LLC / Great Western Finance Corp ' 144A ' 9% 30/9/2021 | 1,215,550 | 0.01 |
| USD | 319,000 | H&E Equipment Services Inc 5.625% 1/9/2025 | 331,961 | 0.00 |
| USD | 299,000 | Hanesbrands Inc ' 144A ' 4.625% 15/5/2024 | 316,161 | 0.00 |
| USD | 11,838,000 | HCA Inc 3.5% 1/9/2030 | 12,431,223 | 0.09 |
| USD | 2,630,000 | HCA Inc 5.25% 15/6/2049 | 3,277,611 | 0.02 |
| USD | 254,000 | HD Supply Inc ' 144A ' 5.375% 15/10/2026 | 268,073 | 0.00 |
| USD | 499,000 | Hilton Domestic Operating Co Inc 5.125% 1/5/2026 | 517,124 | 0.00 |
| USD | 294,000 | Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.625% 1/4/2025 | 299,114 | 0.00 |
| USD | 201,000 | Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 1/4/2027 | 207,495 | 0.00 |
| USD | 5,833,000 | Home Depot Inc/The 3.3% 15/4/2040 | 6,595,549 | 0.05 |
| USD | 1,444,000 | Host Hotels & Resorts LP 3.5% 15/9/2030 | 1,432,445 | 0.01 |
| USD | 331,000 | Howard Hughes Corp/The ' 144A ' 5.375% 15/3/2025 | 336,943 | 0.00 |
| USD | 1,612,000 | Howard Hughes Corp/The ' 144A ' 5.375% 1/8/2028 | 1,635,172 | 0.01 |
| USD | 546,920 | Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust ' Series 2016- 10HY E ' ' 144A ' FRN 10/8/2038 | 519,826 | 0.00 |
| USD | 1,519,000 | Hughes Satellite Systems Corp 7.625% 15/6/2021 | 1,581,249 | 0.01 |
| USD | 1,318,000 | iHeartCommunications Inc ' 144A ' 4.75% 15/1/2028 | 1,264,160 | 0.01 |
| USD | 1,570,000 | iHeartCommunications Inc ' 144A ' 5.25% 15/8/2027 | 1,571,272 | 0.01 |
| USD | 10,010,172 | iHeartCommunications Inc 6.375% 1/5/2026 | 10,533,103 | 0.07 |
| USD | 3,037,789 | iHeartCommunications Inc 8.375% 1/5/2027 | 3,034,858 | 0.02 |
| USD | 6,284,000 | International Business Machines Corp 1.95% 15/5/2030 | 6,483,331 | 0.05 |
| USD | 1,845,000 | International Business Machines Corp 2.95% 15/5/2050 | 1,893,355 | 0.01 |
| USD | 351,000 | IQVIA Inc ' 144A ' 5% 15/10/2026 | 367,234 | 0.00 |
| USD | 370,000 | IQVIA Inc ' 144A ' 5% 15/5/2027 | 390,470 | 0.00 |
| USD | 5,968,000 | Iron Mountain Inc ' 144A ' 4.5% 15/2/2031 | 6,143,310 | 0.04 |
| USD | 6,320,000 | Iron Mountain Inc ' 144A ' 5.25% 15/7/2030 | 6,686,086 | 0.05 |
| USD | 435,000 | Jaguar Holding Co II / PPD Development LP ' 144A ' 5% 15/6/2028 | 461,100 | 0.00 |
| USD | 1,133,000 | JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ' 144A ' 5.75% 15/6/2025 | 1,174,071 | 0.01 |
| USD | 321,000 | JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ' 144A ' 6.75% 15/2/2028 | 357,815 | 0.00 |
| USD | 907,000 | Joseph T Ryerson & Son Inc ' 144A ' 8.5% 1/8/2028 | 985,229 | 0.01 |
| USD | 772,280 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT ' Series 2018-WPT DFL ' ' 144A ' FRN 5/7/2033 | 732,795 | 0.01 |
| USD | 1,333,108 | JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT ' Series 2018-WPT DFX ' ' 144A ' 5.35% 5/7/2033 | 1,320,872 | 0.01 |
| USD | 5,116,000 | JPMorgan Chase & Co FRN 22/4/2051 | 5,486,234 | 0.04 |
| USD | 789,000 | KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC ' 144A ' 5.25% 1/6/2026 | 826,324 | 0.01 |
| USD | 1,991,000 | Kronos Acquisition Holdings Inc ' 144A ' 9% 15/8/2023 | 2,025,842 | 0.01 |
| USD | 532,000 | L Brands Inc 5.25% 1/2/2028 | 513,340 | 0.00 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|------------|--|------------|----------------|
| USD | 1,330,000 | L Brands Inc '144A' 6.875% 1/7/2025 | 1,441,042 | 0.01 |
| USD | 995,000 | Lam Research Corp 3.125% 15/6/2060 | 1,086,077 | 0.01 |
| USD | 640,000 | Lamar Media Corp '144A' 4.875% 15/1/2029 | 670,400 | 0.01 |
| USD | 222,000 | Lamar Media Corp 5.75% 1/2/2026 | 232,384 | 0.00 |
| USD | 276,000 | Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.625% 1/11/2024 | 288,046 | 0.00 |
| USD | 278,000 | Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 1/11/2026 | 292,168 | 0.00 |
| USD | 194,000 | Lennar Corp 4.125% 15/1/2022 | 199,708 | 0.00 |
| USD | 221,000 | Lennar Corp 4.5% 30/4/2024 | 238,725 | 0.00 |
| USD | 163,000 | Lennar Corp 4.75% 1/4/2021 | 165,408 | 0.00 |
| USD | 5,704,000 | Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15/1/2029 | 5,727,757 | 0.04 |
| USD | 10,871,000 | Level 3 Financing Inc '144A' 4.25% 1/7/2028 | 11,194,412 | 0.08 |
| USD | 792,000 | Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15/9/2027 | 829,062 | 0.01 |
| USD | 226,000 | Level 3 Financing Inc 5.125% 1/5/2023 | 226,679 | 0.00 |
| USD | 257,000 | Level 3 Financing Inc 5.25% 15/3/2026 | 269,097 | 0.00 |
| USD | 3,460,000 | Lowe's Cos Inc 5.125% 15/4/2050 | 4,728,116 | 0.03 |
| USD | 697,327 | Madison Park Funding XI Ltd 'Series 2013-11A AR' '144A' FRN 23/7/2029 | 691,394 | 0.01 |
| USD | 337,806 | Madison Park Funding XII Ltd 'Series 2014-12A B1R' '144A' FRN 20/7/2026 | 336,058 | 0.00 |
| USD | 450,000 | Madison Park Funding XIII Ltd 'Series 2014-13A BR2' '144A' FRN 19/4/2030 | 444,254 | 0.00 |
| USD | 948,725 | Madison Park Funding XVIII Ltd 'Series 2015- 18A A1R' '144A' FRN 21/10/2030 | 946,198 | 0.01 |
| USD | 3,408,000 | Marathon Petroleum Corp 4.7% 1/5/2025 | 3,890,039 | 0.03 |
| USD | 5,727,000 | Marriott International Inc/MD 3.5% 15/10/2032 | 5,753,072 | 0.04 |
| USD | 810,000 | Marriott International Inc/MD 4.625% 15/6/2030 | 884,691 | 0.01 |
| USD | 4,530,000 | Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 6.125% 15/9/2025 | 4,832,944 | 0.03 |
| USD | 261,000 | Marriott Ownership Resorts Inc / ILG LLC 6.5% 15/9/2026 | 270,584 | 0.00 |
| USD | 1,323,000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.25% 15/4/2025 | 1,291,579 | 0.01 |
| USD | 3,979,000 | McDonald's Corp 4.2% 1/4/2050 | 4,818,282 | 0.03 |
| USD | 3,492,000 | McDonald's Corp 4.45% 1/9/2048 | 4,326,826 | 0.03 |
| USD | 1,037,000 | Meritor Inc '144A' 6.25% 1/6/2025 | 1,102,124 | 0.01 |
| USD | 639,000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc '144A' 4.625% 15/6/2025 | 671,589 | 0.01 |
| USD | 363,000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024 | 391,171 | 0.00 |
| USD | 3,729,000 | Microchip Technology Inc 4.333% 1/6/2023 | 4,021,470 | 0.03 |
| USD | 237,000 | Molina Healthcare Inc 5.375% 15/11/2022 | 247,872 | 0.00 |
| USD | 2,765,000 | Mondelez International Inc 2.75% 13/4/2030 | 3,019,649 | 0.02 |
| USD | 6,379,000 | Morgan Stanley FRN 15/10/2020 (Perpetual) | 6,104,747 | 0.04 |
| USD | 14,974,000 | Morgan Stanley FRN 1/4/2031 | 17,286,506 | 0.12 |
| USD | 395,094 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 'Series 2015-C24 C' FRN 15/5/2048 | 388,220 | 0.00 |
| USD | 2,057,000 | Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 'Series 2016-C32 A4' 3.72% 15/12/2049 | 2,310,430 | 0.02 |
| USD | 4,998,000 | Motorola Solutions Inc 2.3% 15/11/2030 | 4,985,199 | 0.04 |
| USD | 470,000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5% 15/10/2027 | 498,151 | 0.00 |
| USD | 1,204,000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.5% 15/8/2028 | 1,266,457 | 0.01 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|------------|---|------------|----------------|
| USD | 6,454,000 | NBCUniversal Enterprise Inc '144A' 5.25% 19/3/2021 (Perpetual) | 6,558,877 | 0.05 |
| USD | 237,000 | Netflix Inc 5.5% 15/2/2022 | 250,035 | 0.00 |
| USD | 250,000 | Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A BR' '144A' FRN 15/1/2028 | 241,914 | 0.00 |
| USD | 250,000 | Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 Ltd ' Series 2020-37A B' '144A' FRN 20/7/2031 | 250,068 | 0.00 |
| USD | 461,000 | Newell Brands Inc 4.35% 1/4/2023 | 488,187 | 0.00 |
| USD | 2,810,000 | Norfolk Southern Corp 3.05% 15/5/2050 | 2,954,944 | 0.02 |
| USD | 249,000 | NRG Energy Inc '144A' 5.25% 15/6/2029 | 271,986 | 0.00 |
| USD | 278,000 | NRG Energy Inc 5.75% 15/1/2028 | 302,969 | 0.00 |
| USD | 414,000 | NRG Energy Inc 6.625% 15/1/2027 | 442,549 | 0.00 |
| USD | 344,000 | NRG Energy Inc 7.25% 15/5/2026 | 369,076 | 0.00 |
| USD | 2,925,000 | NVIDIA Corp 3.5% 1/4/2050 | 3,297,346 | 0.02 |
| USD | 281,000 | OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity Co 'Series 2016-5X B1' FRN 21/2/2030 | 332,905 | 0.00 |
| USD | 692,672 | OCF CLO 2017-13 Ltd 'Series 2017-13A A1A' ' 144A' FRN 15/7/2030 | 692,431 | 0.01 |
| USD | 689,061 | OCF CLO 2017-13 Ltd 'Series 2017-13A A2A' ' 144A' FRN 15/7/2030 | 684,281 | 0.01 |
| USD | 275,000 | OCF CLO 2020-19 Ltd 'Series 2020-19A B' ' 144A' FRN 20/7/2031 | 275,448 | 0.00 |
| USD | 289,561 | Octagon Investment Partners 32 Ltd 'Series 2017-1A B1' '144A' FRN 15/7/2029 | 286,676 | 0.00 |
| USD | 3,685,000 | ONEOK Inc 2.75% 1/9/2024 | 3,793,172 | 0.03 |
| USD | 5,974,000 | ONEOK Partners LP 4.9% 15/3/2025 | 6,519,195 | 0.05 |
| USD | 2,169,000 | Oracle Corp 2.95% 1/4/2030 | 2,419,925 | 0.02 |
| USD | 11,535,000 | Oracle Corp 3.6% 1/4/2040 | 12,911,557 | 0.09 |
| USD | 1,037,000 | Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A' 7.375% 1/6/2025 | 1,084,852 | 0.01 |
| USD | 220,000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5% 15/8/2027 | 216,522 | 0.00 |
| USD | 600,000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 6.25% 15/6/2025 | 622,500 | 0.00 |
| USD | 250,000 | Palmer Square CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 18/4/2031 | 246,186 | 0.00 |
| USD | 1,075,000 | Palmer Square Loan Funding 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A A2' '144A' FRN 15/7/2026 | 1,061,664 | 0.01 |
| USD | 370,796 | Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2016-1 'Series 2016-1A A2R' '144A' FRN 23/8/2031 | 368,367 | 0.00 |
| USD | 4,258,000 | Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A' 5.25% 15/8/2025 | 4,310,778 | 0.03 |
| USD | 2,013,000 | Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A' 5.375% 15/1/2025 | 2,057,266 | 0.01 |
| USD | 236,000 | Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ' 144A' 5.625% 15/10/2027 | 244,530 | 0.00 |
| USD | 4,160,000 | PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 9.25% 15/5/2025 | 4,550,728 | 0.03 |
| USD | 5,275,000 | PG&E Corp 5% 1/7/2028 | 5,273,101 | 0.04 |
| USD | 624,000 | PG&E Corp 5.25% 1/7/2030 | 621,660 | 0.00 |
| USD | 1,297,000 | Picasso Finance Sub Inc '144A' 6.125% 15/6/2025 | 1,392,913 | 0.01 |
| USD | 289,000 | Pilgrim's Pride Corp '144A' 5.875% 30/9/2027 | 306,701 | 0.00 |
| USD | 9,515,000 | Pioneer Natural Resources Co 1.9% 15/8/2030 | 9,249,081 | 0.07 |
| USD | 711,000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31/8/2027 | 708,369 | 0.01 |
| USD | 4,860,000 | Prudential Financial Inc FRN 15/9/2042 | 5,197,750 | 0.04 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|-----------|--|------------|----------------|
| USD | 3,415,000 | Prudential Financial Inc FRN 15/6/2043 | 3,660,145 | 0.03 |
| USD | 4,226,000 | Prudential Financial Inc 3.7% 13/3/2051 | 4,671,353 | 0.03 |
| USD | 1,656,000 | Quicken Loans LLC '144A' 5.25% 15/1/2028 | 1,771,589 | 0.01 |
| USD | 392,000 | Quicken Loans LLC '144A' 5.75% 1/5/2025 | 403,515 | 0.00 |
| USD | 3,053,000 | Regeneron Pharmaceuticals Inc 2.8% 15/9/2050 | 2,889,077 | 0.02 |
| USD | 1,298,000 | Reliance Steel & Aluminum Co 2.15% 15/8/2030 | 1,284,327 | 0.01 |
| USD | 789,000 | Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu '144A' 5.125% 15/7/2023 | 801,821 | 0.01 |
| USD | 1,225,000 | RR 10 Ltd 'Series 2020-10A A2A' '144A' FRN 15/7/2033 | 1,226,738 | 0.01 |
| USD | 1,225,000 | RR 10 Ltd 'Series 2020-10A A2B' '144A' FRN 15/7/2033 | 1,228,850 | 0.01 |
| USD | 525,000 | RR 11 Ltd 'Series 2020-11A A2' '144A' FRN 15/10/2031 | 525,000 | 0.00 |
| USD | 696,412 | RR 2 Ltd 'Series 2017-2A A2' '144A' FRN 15/10/2029 | 685,077 | 0.01 |
| USD | 582,000 | SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 9.5% 1/8/2025 | 617,647 | 0.00 |
| USD | 6,052,000 | Select Medical Corp '144A' 6.25% 15/8/2026 | 6,477,395 | 0.05 |
| USD | 297,000 | Sensata Technologies Inc '144A' 3.75% 15/2/2031 | 300,712 | 0.00 |
| USD | 5,285,000 | Service Properties Trust 4.5% 15/6/2023 | 5,215,634 | 0.04 |
| USD | 4,441,000 | Service Properties Trust 5% 15/8/2022 | 4,463,205 | 0.03 |
| USD | 815,000 | Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025 | 886,677 | 0.01 |
| USD | 3,945,000 | Sherwin-Williams Co/The 3.8% 15/8/2049 | 4,522,246 | 0.03 |
| USD | 326,000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 1/8/2022 | 330,075 | 0.00 |
| USD | 5,563,000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 1/7/2030 | 5,862,011 | 0.04 |
| USD | 467,000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 4.625% 15/7/2024 | 486,702 | 0.00 |
| USD | 505,000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 5% 1/8/2027 | 536,575 | 0.00 |
| USD | 334,000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 5.375% 15/7/2026 | 351,634 | 0.00 |
| USD | 424,000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 5.5% 1/7/2029 | 467,490 | 0.00 |
| USD | 328,000 | Six Flags Entertainment Corp '144A' 4.875% 31/7/2024 | 318,695 | 0.00 |
| USD | 2,753,134 | SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ' Series 2005-B A4' FRN 15/6/2039 | 2,604,033 | 0.02 |
| USD | 4,182,237 | SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A ' Series 2006-A A5' FRN 15/6/2039 | 3,952,433 | 0.03 |
| USD | 4,466,323 | SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A ' Series 2007-A A4A' FRN 16/12/2041 | 4,265,916 | 0.03 |
| USD | 9,742,000 | SLM Private Education Loan Trust 2010-C ' Series 2010-C A5' '144A' FRN 15/10/2041 | 10,590,575 | 0.07 |
| USD | 2,906,000 | SM Energy Co 1.5% 1/7/2021 | 2,749,006 | 0.02 |
| USD | 775,000 | SM Energy Co 6.125% 15/11/2022 | 599,474 | 0.00 |
| USD | 3,452,000 | SM Energy Co '144A' 10% 15/1/2025 | 3,417,480 | 0.02 |
| USD | 3,606,000 | SMB Private Education Loan Trust 2019-A ' Series 2019-A A2A' '144A' 3.44% 15/7/2036 | 3,794,592 | 0.03 |
| USD | 2,320,000 | SMB Private Education Loan Trust 2020-B ' Series 2020-BA B' '144A' 2.76% 15/7/2053 | 2,300,285 | 0.02 |
| USD | 1,061,000 | Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust ' Series 2018-B A2FX' '144A' 3.34% 25/8/2047 | 1,096,439 | 0.01 |
| USD | 590,000 | Spectrum Brands Inc '144A' 5.5% 15/7/2030 | 620,975 | 0.00 |
| USD | 563,000 | Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15/1/2031 | 565,956 | 0.00 |
| USD | 969,000 | Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15/7/2030 | 1,029,180 | 0.01 |
| USD | 156,000 | Standard Industries Inc/NJ '144A' 5% 15/2/2027 | 163,428 | 0.00 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|------------|--|------------|----------------|
| USD | 3,945,000 | Starbucks Corp 3.5% 15/11/2050 | 4,149,909 | 0.03 |
| USD | 510,000 | Steel Dynamics Inc 3.25% 15/1/2031 | 549,805 | 0.00 |
| USD | 527,000 | Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.25% 15/1/2029 | 556,127 | 0.00 |
| USD | 1,315,000 | Sunoco Logistics Partners Operations LP 4% 1/10/2027 | 1,349,955 | 0.01 |
| USD | 323,000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023 | 328,638 | 0.00 |
| USD | 263,000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.5% 15/2/2026 | 271,926 | 0.00 |
| USD | 201,000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6% 15/4/2027 | 212,011 | 0.00 |
| USD | 4,815,000 | Talen Energy Supply LLC '144A' 7.625% 1/6/2028 | 4,984,801 | 0.04 |
| USD | 166,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.125% 1/2/2025 | 170,048 | 0.00 |
| USD | 169,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.375% 1/2/2027 | 174,884 | 0.00 |
| USD | 337,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15/4/2026 | 356,972 | 0.00 |
| USD | 272,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.5% 15/7/2027 | 295,528 | 0.00 |
| USD | 193,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.75% 15/3/2024 | 197,094 | 0.00 |
| USD | 275,000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.875% 15/1/2029 | 303,703 | 0.00 |
| USD | 166,000 | Teleflex Inc 4.625% 15/11/2027 | 176,967 | 0.00 |
| USD | 198,000 | Tempur Sealy International Inc 5.5% 15/6/2026 | 207,804 | 0.00 |
| USD | 1,393,000 | Tenet Healthcare Corp 4.625% 15/7/2024 | 1,426,404 | 0.01 |
| USD | 198,000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 1/9/2024 | 204,522 | 0.00 |
| USD | 484,000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15/6/2028 | 502,063 | 0.00 |
| USD | 683,000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 1/1/2026 | 712,751 | 0.01 |
| USD | 457,000 | Tenet Healthcare Corp 5.125% 1/5/2025 | 470,139 | 0.00 |
| USD | 510,000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 6.25% 1/2/2027 | 537,486 | 0.00 |
| USD | 199,000 | Terex Corp '144A' 5.625% 1/2/2025 | 202,582 | 0.00 |
| USD | 819,804 | TIAA CLO II Ltd 'Series 2017- 1A A' '144A' FRN 20/4/2029 | 819,752 | 0.01 |
| USD | 8,534,000 | T-Mobile USA Inc '144A' 2.55% 15/2/2031 | 8,902,242 | 0.06 |
| USD | 3,716,000 | T-Mobile USA Inc '144A' 3.875% 15/4/2030 | 4,261,212 | 0.03 |
| USD | 380,000 | TRI Pointe Group Inc 5.7% 15/6/2028 | 420,850 | 0.00 |
| USD | 3,945,000 | Union Pacific Corp 3.25% 5/2/2050 | 4,333,898 | 0.03 |
| USD | 243,000 | United Rentals North America Inc 4.625% 15/10/2025 | 248,923 | 0.00 |
| USD | 547,000 | United Rentals North America Inc 4.875% 15/1/2028 | 579,136 | 0.00 |
| USD | 343,000 | United Rentals North America Inc 5.5% 15/5/2027 | 367,653 | 0.00 |
| USD | 343,000 | United Rentals North America Inc 5.875% 15/9/2026 | 365,341 | 0.00 |
| USD | 33,000,000 | United States Cash Management Bill 10/11/2020 (Zero Coupon) | 32,994,793 | 0.23 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産 比率 % |
|-----|-------------|--|-------------|----------------|
| USD | 50,000,000 | United States Cash Management Bill 8/12/2020 (Zero Coupon) | 49,984,187 | 0.35 |
| USD | 100,000,000 | United States Treasury Bill 10/9/2020 (Zero Coupon) | 99,998,021 | 0.70 |
| USD | 116,750,000 | United States Treasury Bill 22/9/2020 (Zero Coupon) | 116,743,936 | 0.81 |
| USD | 30,000,000 | United States Treasury Bill 24/9/2020 (Zero Coupon) | 29,998,450 | 0.21 |
| USD | 280,500,000 | United States Treasury Bill 6/10/2020 (Zero Coupon) | 280,478,962 | 1.95 |
| USD | 240,000,000 | United States Treasury Bill 8/10/2020 (Zero Coupon) | 239,980,366 | 1.67 |
| USD | 149,900,000 | United States Treasury Bill 13/10/2020 (Zero Coupon) | 149,885,676 | 1.04 |
| USD | 120,000,000 | United States Treasury Bill 27/10/2020 (Zero Coupon) | 119,984,801 | 0.84 |
| USD | 194,000,000 | United States Treasury Bill 12/11/2020 (Zero Coupon) | 193,967,546 | 1.35 |
| USD | 65,000,000 | United States Treasury Bill 19/11/2020 (Zero Coupon) | 64,988,444 | 0.45 |
| USD | 14,000,000 | United States Treasury Bill 27/11/2020 (Zero Coupon) | 13,996,834 | 0.10 |
| USD | 60,000,000 | United States Treasury Bill 14/1/2021 (Zero Coupon) | 59,977,333 | 0.42 |
| USD | 78,000,000 | United States Treasury Bill - WI Post Auction 3/12/2020 (Zero Coupon) | 77,982,689 | 0.54 |
| USD | 170,604,300 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2024 | 183,430,137 | 1.28 |
| USD | 250,125,700 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2025 | 268,273,406 | 1.87 |
| USD | 72,096,700 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/1/2030* | 80,562,340 | 0.56 |
| USD | 53,094,900 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/4/2023 | 58,013,857 | 0.40 |
| USD | 22,122,400 | United States Treasury Note/ Bond 1.125% 15/5/2040 † | 21,671,311 | 0.15 |
| USD | 248,717,300 | United States Treasury Note/ Bond 1.75% 15/11/2029* | 272,947,807 | 1.90 |

| | 数量 | 銘柄 | 時価（米ドル） | 純資産 比率 % |
|-----|-----------|--|-----------------------|----------------|
| USD | 4,951,200 | United States Treasury Note/ Bond 2.375% 15/11/2049 | 5,997,915 | 0.04 |
| USD | 198,000 | US Concrete Inc 6.375% 1/6/2024 | 205,051 | 0.00 |
| USD | 2,381,000 | USB Capital IX FRN 2/10/2020 (Perpetual) | 2,126,221 | 0.02 |
| USD | 2,253,000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3.5% 15/2/2025 | 2,255,242 | 0.02 |
| USD | 2,170,000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3.75% 15/2/2027 | 2,166,268 | 0.02 |
| USD | 2,585,000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.125% 15/8/2030 | 2,591,462 | 0.02 |
| USD | 436,000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 5% 31/7/2027 | 464,462 | 0.00 |
| USD | 338,000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 5.5% 1/9/2026 | 354,477 | 0.00 |
| USD | 7,813,000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 5.625% 15/2/2027 | 8,273,654 | 0.06 |
| USD | 1,350,000 | VNDO Trust 2016-350P 'Series 2016-350P D' ' 144A' FRN 10/1/2035 | 1,389,267 | 0.01 |
| USD | 6,181,000 | Wells Fargo & Co FRN 30/4/2041 | 6,494,946 | 0.05 |
| USD | 2,000,000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28 'Series 2015-C28 AS' FRN 15/5/2048 | 2,191,658 | 0.02 |
| USD | 1,318,000 | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 'Series 2018-1745 A' '144A' FRN 15/6/2036 | 1,468,976 | 0.01 |
| USD | 795,000 | WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15/6/2025 | 878,654 | 0.01 |
| USD | 985,000 | WESCO Distribution Inc '144A' 7.25% 15/6/2028 | 1,097,196 | 0.01 |
| USD | 170,000 | William Carter Co/The '144A' 5.625% 15/3/2027 | 181,255 | 0.00 |
| USD | 354,000 | Williams Scotsman International Inc '144A' 4.625% 15/8/2028 | 359,974 | 0.00 |
| USD | 166,000 | WPX Energy Inc 5.75% 1/6/2026 | 169,216 | 0.00 |
| USD | 2,524,000 | Wyndham Destinations Inc '144A' 6.625% 31/7/2026 | 2,694,370 | 0.02 |
| USD | 791,000 | Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15/8/2028 | 799,642 | 0.01 |
| USD | 168,000 | Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 5.375% 15/4/2026 | 175,035 | 0.00 |
| USD | 2,597,000 | Xerox Holdings Corp '144A' 5% 15/8/2025 | 2,634,332 | 0.02 |
| USD | 1,571,000 | XHR LP '144A' 6.375% 15/8/2025 | 1,606,347 | 0.01 |
| USD | 177,000 | XPO Logistics Inc '144A' 6.125% 1/9/2023 | 180,429 | 0.00 |
| USD | 2,075,000 | XPO Logistics Inc '144A' 6.25% 1/5/2025 | 2,224,141 | 0.02 |
| USD | 350,000 | XPO Logistics Inc '144A' 6.75% 15/8/2024 | 373,047 | 0.00 |
| USD | 278,501 | York CLO 1 Ltd 'Series 2014-1A BRR' '144A' FRN 22/10/2029 | 275,330 | 0.00 |
| | | | <u>3,197,406,174</u> | <u>22.26</u> |
| | | ウルグアイ | | |
| USD | 2,820,626 | Uruguay Government International Bond 5.1% 18/6/2050 | 3,897,753 | 0.03 |
| | | 債券合計Total Bonds | <u>4,554,615,034</u> | <u>31.71</u> |
| | | 公認の証券取引所に上場されているまたは他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券及びマネー・マーケット商品合計 | <u>13,959,877,981</u> | <u>97.18</u> |

その他の譲渡性のある有価証券

| 数量 | 銘柄 | 時価(米ドル) | 純資産比率 % | |
|----------------------|---|--|----------------|--------|
| 普通ノ優先株式(証券)およびワラント | | | | |
| 9,488,465 | オーストラリア Quintis Ltd** | 10,554,247 | 0.07 | |
| ケイマン諸島 | | | | |
| 609 | Marco Polo Investment Holdings Ltd Npv | - | 0.00 | |
| 中国 | | | | |
| 24,969 | Epic Games, Inc.** | 14,357,175 | 0.10 | |
| 米国 | | | | |
| 2,825,976 | C3.ai, Inc** | 15,429,829 | 0.11 | |
| 324,584 | C3.ai, Inc** | 1,772,229 | 0.01 | |
| 162,919 | Databricks Inc** | 7,820,112 | 0.06 | |
| 157,436 | Farmer's Business Network Inc** | 5,204,299 | 0.04 | |
| 4,185,730 | Grand Rounds, Inc (Pref)** | 17,035,921 | 0.12 | |
| 1,924,865 | Grand Rounds, Inc (Pref)** | 7,757,206 | 0.05 | |
| 10,375 | Mount Sinai Genomics, Inc.** | 6,366,871 | 0.04 | |
| 6,026 | Neon Payments Ltd (Wts 8/4/2021)** | 115,880 | 0.00 | |
| 3,269,720 | Palantir Technologies, Inc (Pref)** | 17,493,002 | 0.12 | |
| 134,315 | SambaNova Systems Inc** | 7,541,787 | 0.05 | |
| 3,059,237 | Vertiv Pipe Lockup** | 49,804,378 | 0.35 | |
| 337,227 | Zero Mass Water, Inc.** | 5,338,303 | 0.04 | |
| 337,227 | Zero Mass Water, Inc. (Wts 8/11/2021)** | 347,344 | 0.00 | |
| | | 142,027,161 | 0.99 | |
| 英国 | | | | |
| 22,688 | The Hut Group, Inc. 'B' ** | 26,197,023 | 0.18 | |
| 107,909 | Lookout, Inc** | 621,556 | 0.00 | |
| 1,919,121 | Lookout, Inc Series F (Pref)** | 22,319,377 | 0.16 | |
| 12,052 | Neon Payments Ltd (Pref)** | 3,998,492 | 0.03 | |
| 652,238 | NMC Health Plc*,** | - | 0.00 | |
| | | 53,136,448 | 0.37 | |
| 普通ノ優先株式(証券)およびワラント合計 | | 220,075,031 | 1.53 | |
| 債券 | | | | |
| オーストラリア | | | | |
| USD | 17,943,829 | Quintis Australia Pty Ltd 1/10/2028 (Zero Coupon)** | 17,943,829 | 0.12 |
| USD | 16,595,015 | Quintis Australia Pty Ltd 7.5% 1/10/2026** | 16,595,015 | 0.12 |
| | | | 34,538,844 | 0.24 |
| ケイマン諸島 | | | | |
| CNY | 103,700,000 | Fresh Express Delivery Holding Group Co Ltd (Defaulted) 18/10/2010 (Zero Coupon)** | - | 0.00 |
| インド | | | | |
| USD | 19,051,000 | REI Agro Ltd (Defaulted) 5.5% 13/11/2014** | 2 | 0.00 |
| 米国 | | | | |
| USD | 2,090,000 | Calpine Escrow Corp 31/12/2049 (Zero Coupon) | - | 0.00 |
| 債券合計 | | | 34,538,846 | 0.24 |
| その他の譲渡性のある有価証券合計 | | | 254,613,877 | 1.77 |
| ポートフォリオ合計 | | | 14,214,491,858 | 98.95 |
| その他の純資産 | | | 150,291,294 | 1.05 |
| 純資産合計(米ドル) | | | 14,364,783,152 | 100.00 |

* 当該有価証券は貸付有価証券です。

~ 当該投資は関連当事者のファンドへの投資です。

** 当該有価証券は公正価値修正の対象です。

† 当該有価証券は、担保として差し入れられたものまたは保証が付与されたものです。

'A'、'B'、'C'、'H'：議決権や転売権等に特定の規定が設けられた株式です。

(Pref) 優先株式(優先証券)です。

(Defaulted) デフォルト銘柄です。

(Restricted) 取引等の制限がかかっている銘柄です。

(FRN) 変動利付債です。

(Perpetual) 永久債です。なお、記号の直前にある日付は発行体が債券を償還する可能性のある日を表します。

'144A'：米国の適格機関投資家向け私募証券市場において発行された証券です。

はアセットマネジメントOneにて追記しました。

外国為替予約取引明細表

2020年8月31日現在

| 通貨 | 買建金額 | 通貨 | 売建金額 | 契約相手 | 満期日 | 未実現利益/(損失)(米ドル) |
|-----|----------------|-----|---------------|-----------------|------------|-----------------|
| AUD | 19,193,008 | JPY | 1,441,856,108 | HSBC Bank Plc | 3/9/2020 | 544,737 |
| EUR | 11,827,651 | USD | 13,322,705 | HSBC Bank Plc | 3/9/2020 | 784,159 |
| EUR | 17,653,118 | USD | 19,744,190 | JP Morgan | 3/9/2020 | 1,310,721 |
| INR | 2,149,626,000 | USD | 29,366,475 | Bank of America | 3/9/2020 | (163,541) |
| JPY | 1,435,917,024 | AUD | 19,193,008 | Morgan Stanley | 3/9/2020 | (600,730) |
| JPY | 3,570,598,953 | USD | 32,924,170 | JP Morgan | 3/9/2020 | 738,954 |
| USD | 28,188,120 | INR | 2,149,626,000 | Bank of America | 3/9/2020 | (1,014,815) |
| USD | 13,220,148 | JPY | 1,437,466,263 | HSBC Bank Plc | 3/9/2020 | (332,089) |
| EUR | 17,820,115 | USD | 20,188,556 | JP Morgan | 4/9/2020 | 1,065,994 |
| USD | 19,925,885 | JPY | 2,181,292,621 | Deutsche Bank | 4/9/2020 | (639,327) |
| AUD | 57,476,573 | JPY | 4,302,149,077 | Morgan Stanley | 10/9/2020 | 1,776,843 |
| AUD | 38,447,688 | JPY | 2,934,154,149 | JP Morgan | 10/9/2020 | 657,493 |
| EUR | 17,602,308 | USD | 19,918,854 | Morgan Stanley | 10/9/2020 | 1,078,649 |
| JPY | 3,374,485,520 | AUD | 45,086,903 | Morgan Stanley | 10/9/2020 | (1,396,568) |
| USD | 20,017,696 | JPY | 2,185,504,056 | Citibank | 10/9/2020 | (588,902) |
| USD | 168,451 | CNH | 1,198,000 | Goldman Sachs | 11/9/2020 | (6,341) |
| USD | 61,294,404 | CNH | 436,008,000 | HSBC Bank Plc | 11/9/2020 | (2,320,741) |
| USD | 13,561,062 | INR | 1,033,258,000 | BNP Paribas | 11/9/2020 | (472,164) |
| GBP | 17,822,250 | EUR | 19,891,000 | HSBC Bank Plc | 17/9/2020 | 12,347 |
| GBP | 8,926,138 | EUR | 9,913,000 | Morgan Stanley | 17/9/2020 | 64,949 |
| JPY | 3,554,025,541 | AUD | 48,630,216 | Morgan Stanley | 17/9/2020 | (2,311,745) |
| JPY | 2,534,195,885 | EUR | 20,957,000 | Bank of America | 17/9/2020 | (1,106,457) |
| NOK | 187,720,000 | USD | 19,717,607 | JP Morgan | 18/9/2020 | 1,746,889 |
| USD | 3,963,077 | NOK | 38,227,764 | HSBC Bank Plc | 18/9/2020 | (408,006) |
| USD | 2,600,757 | NOK | 25,063,236 | JP Morgan | 18/9/2020 | (265,052) |
| JPY | 17,424,063,416 | USD | 163,295,883 | JP Morgan | 24/9/2020 | 1,022,758 |
| USD | 60,678,905 | CNH | 431,542,000 | UBS | 24/9/2020 | (2,217,838) |
| USD | 26,465,338 | INR | 2,042,039,000 | BNP Paribas | 24/9/2020 | (1,256,757) |
| USD | 33,240,105 | JPY | 3,549,528,038 | JP Morgan | 24/9/2020 | (233,924) |
| EUR | 19,546,631 | USD | 22,071,927 | Citibank | 25/9/2020 | 1,252,531 |
| EUR | 6,724,369 | USD | 7,593,010 | Deutsche Bank | 25/9/2020 | 430,995 |
| JPY | 4,309,149,718 | EUR | 35,786,000 | JP Morgan | 25/9/2020 | (2,064,211) |
| CAD | 24,566,000 | USD | 18,042,706 | JP Morgan | 1/10/2020 | 774,171 |
| GBP | 57,269,000 | USD | 70,863,458 | JP Morgan | 1/10/2020 | 5,440,631 |
| USD | 209,566 | AUD | 303,963 | Citibank | 1/10/2020 | (14,371) |
| USD | 36,943,572 | AUD | 53,568,037 | Bank of America | 1/10/2020 | (2,521,207) |
| USD | 32,867,034 | ZAR | 574,157,495 | JP Morgan | 1/10/2020 | (1,111,983) |
| GBP | 35,835,000 | USD | 45,012,584 | JP Morgan | 8/10/2020 | 2,734,795 |
| JPY | 7,002,967,000 | USD | 65,210,910 | Goldman Sachs | 8/10/2020 | 842,922 |
| EUR | 47,599,183 | USD | 54,514,226 | HSBC Bank Plc | 9/10/2020 | 2,301,684 |
| USD | 61,672,975 | CNH | 433,450,000 | JP Morgan | 14/10/2020 | (1,417,572) |
| EUR | 47,599,183 | USD | 54,510,927 | Morgan Stanley | 15/10/2020 | 2,312,244 |
| GBP | 86,097,000 | USD | 109,715,138 | Barclays | 22/10/2020 | 5,009,115 |
| USD | 55,842,724 | AUD | 78,742,000 | HSBC Bank Plc | 22/10/2020 | (2,171,372) |
| USD | 20,746,840 | AUD | 29,011,000 | Bank of America | 23/10/2020 | (627,409) |
| EUR | 17,695,767 | AUD | 29,118,243 | Morgan Stanley | 29/10/2020 | (322,345) |
| JPY | 10,185,150,000 | USD | 96,937,865 | Morgan Stanley | 29/10/2020 | (844,583) |
| USD | 2,118,034 | JPY | 224,126,000 | JP Morgan | 29/10/2020 | 3,485 |
| JPY | 7,258,848,822 | EUR | 58,635,000 | Bank of America | 30/10/2020 | (1,534,435) |
| EUR | 19,318,000 | USD | 22,985,862 | JP Morgan | 5/11/2020 | 85,955 |
| JPY | 10,593,975,000 | USD | 99,913,497 | JP Morgan | 5/11/2020 | 45,496 |
| MXN | 747,551,000 | USD | 32,389,558 | Citibank | 5/11/2020 | 1,522,955 |
| USD | 69,371,759 | CNH | 484,312,000 | Citibank | 5/11/2020 | (1,030,516) |
| USD | 570,885 | CNH | 3,986,000 | Bank of America | 5/11/2020 | (8,542) |
| USD | 66,893,714 | HKD | 518,540,000 | HSBC Bank Plc | 5/11/2020 | 14,389 |
| CHF | 29,636,000 | USD | 32,447,768 | JP Morgan | 6/11/2020 | 433,622 |
| JPY | 13,146,600,000 | USD | 123,628,218 | UBS | 6/11/2020 | 417,517 |
| USD | 67,798,578 | HKD | 525,500,000 | HSBC Bank Plc | 6/11/2020 | 21,906 |
| EUR | 17,882,969 | USD | 21,200,086 | Barclays | 12/11/2020 | 160,983 |
| JPY | 11,867,450,000 | USD | 112,062,054 | JP Morgan | 12/11/2020 | (77,454) |
| EUR | 69,779,000 | USD | 82,574,822 | JP Morgan | 13/11/2020 | 777,405 |
| USD | 38,414,609 | ZAR | 664,611,158 | Bank of America | 13/11/2020 | (744,344) |
| BRL | 31,062,245 | USD | 5,624,467 | Citibank | 16/11/2020 | 36,616 |

| | | | | | | |
|--------|----------------|-----|---------------|-----------------|------------|------------------|
| KRW | 49,010,559,000 | USD | 41,412,241 | Deutsche Bank | 16/11/2020 | (96,063) |
| RUB | 3,359,453,000 | USD | 45,601,371 | BNP Paribas | 16/11/2020 | (708,940) |
| USD | 45,447,760 | RUB | 3,359,453,000 | BNP Paribas | 16/11/2020 | 555,330 |
| MYR | 160,466,000 | USD | 38,242,612 | Barclays | 17/11/2020 | 225,795 |
| MXN | 591,490,000 | USD | 26,351,689 | JP Morgan | 19/11/2020 | 437,826 |
| USD | 14,252,792 | EUR | 11,953,756 | BNP Paribas | 19/11/2020 | (27,973) |
| EUR | 18,202,676 | USD | 21,692,926 | Citibank | 4/12/2020 | 60,289 |
| USD | 29,074,538 | INR | 2,149,626,000 | Bank of America | 8/12/2020 | 99,739 |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>6,144,572</u> |

| 通貨 | 買建金額 | 通貨 | 売建金額 | 契約相手 | 満期日 | 未実現利益/(損失)(米ドル) |
|---|---------------|-----|---------------|------------|-----------|-------------------|
| AUD Hedged Share Class | | | | | | |
| AUD | 264,421,038 | USD | 189,904,018 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 4,888,387 |
| USD | 1,692,249 | AUD | 2,353,809 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (41,744) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>4,846,643</u> |
| CHF Hedged Share Class | | | | | | |
| CHF | 28,232,035 | USD | 30,988,210 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 287,261 |
| USD | 413,398 | CHF | 375,664 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (2,764) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>284,497</u> |
| CNH Hedged Share Class | | | | | | |
| CNY | 26,210,678 | USD | 3,770,053 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 52,988 |
| USD | 335,632 | CNY | 2,321,943 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (3,040) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>49,948</u> |
| EUR Hedged Share Class | | | | | | |
| EUR | 1,695,884,601 | USD | 2,000,923,537 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 22,282,884 |
| USD | 31,171,130 | EUR | 26,255,833 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (152,382) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>22,130,502</u> |
| GBP Hedged Share Class | | | | | | |
| GBP | 91,879,175 | USD | 120,293,808 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 2,109,788 |
| USD | 2,619,586 | GBP | 1,987,572 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (28,306) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>2,081,482</u> |
| HKD Hedged Share Class | | | | | | |
| HKD | 136,178,763 | USD | 17,573,007 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (3,471) |
| USD | 1,113,873 | HKD | 8,633,145 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 40 |
| 未実現純損失 | | | | | | <u>(3,431)</u> |
| JPY Hedged Share Class | | | | | | |
| JPY | 1,825,495,117 | USD | 17,205,640 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 7,689 |
| USD | 287,893 | JPY | 30,589,105 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (544) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>7,145</u> |
| PLN Hedged Share Class | | | | | | |
| PLN | 25,514,832 | USD | 6,835,873 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 79,199 |
| USD | 42,251 | PLN | 156,467 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (155) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>79,044</u> |
| SGD Hedged Share Class | | | | | | |
| SGD | 210,283,918 | USD | 153,372,668 | BNY Mellon | 15/9/2020 | 1,158,978 |
| USD | 1,290,814 | SGD | 1,765,858 | BNY Mellon | 15/9/2020 | (6,864) |
| 未実現純利益 | | | | | | <u>1,152,114</u> |
| 未実現純利益合計 (米ドル原資産エクスポージャー - 5,769,278,172米ドル) | | | | | | <u>36,772,516</u> |

先物取引明細表

2020年8月31日現在

| 契約数量 | 通貨 | 銘柄 | 満期日 | 原資産エクスポージャー (米ドル) | 未実現利益/ (損失) (米ドル) |
|---------|-----|-----------------------------------|----------------|----------------------|-------------------------|
| 435 | AUD | Australian 10 Year Bond | September 2020 | 47,254,469 | (474,773) |
| 3,034 | EUR | EURO STOXX 50 Index | September 2020 | 118,906,521 | 2,955,166 |
| 906 | EUR | Euro-BTP | September 2020 | 158,216,269 | 4,189,275 |
| 692 | EUR | Euro-OAT | September 2020 | 138,152,307 | 1,780,695 |
| 188 | EUR | FTSE MIB Market Index | September 2020 | 22,108,399 | 263,547 |
| 130 | EUR | Dax Index | September 2020 | 50,363,434 | 2,810,181 |
| (74) | EUR | Euro Bund | September 2020 | 15,487,520 | (119,148) |
| (31) | GBP | FTSE 100 Index | September 2020 | 2,461,807 | 98,082 |
| 166 | HKD | Hang Seng China Enterprises Index | September 2020 | 10,637,845 | (360,914) |
| (61) | JPY | US Long Bond (CBT) | September 2020 | 6,642,312 | (24,367) |
| 1,338 | USD | Russell 2000 E-Mini Index | September 2020 | 104,638,290 | 670,092 |
| 726 | USD | MSCI Emerging Markets Index | September 2020 | 39,831,990 | 3,268,890 |
| (471) | USD | NASDAQ 100 E-Mini Index | September 2020 | 113,374,410 | (9,399,425) |
| (3,132) | USD | S&P 500 E-Mini Index | September 2020 | 548,100,000 | (23,020,285) |
| 2,028 | USD | US Ultra 10 Year Note | December 2020 | 322,515,375 | 495,623 |
| 1,786 | USD | US Treasury 10 Year Note (CBT) | December 2020 | 248,449,344 | 285,726 |
| 263 | USD | US Long Bond (CBT) | December 2020 | 46,025,000 | (395,776) |
| (292) | USD | US Long Bond (CBT) | December 2020 | 63,984,500 | 30,788 |
| (742) | USD | US Treasury 5 Year Note (CBT) | December 2020 | 93,480,406 | (132,537) |
| 合計 | | | | 2,150,630,198 | (17,079,160) |

スワップ明細表

2020年8月31日現在

| 種類 | 額面価額 | 銘柄 | 契約相手 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) | |
|-----|------|---------------|--|-----------------|-------------------------|-------------|-----------|
| CDS | USD | 38,909,000 | Fund receives default protection on CDX.NA.IG.34.V1; and pays Fixed 1% | Bank of America | 20/6/2025 | (71,629) | (616,659) |
| CDS | EUR | (28,840,566) | Fund provides default protection on ITRAXX.X0.33.V1; and receives Fixed 5% | Bank of America | 20/6/2025 | 2,267,142 | 2,654,121 |
| CDS | USD | (108,404,735) | Fund provides default protection on CDX.NA.HY.34.V8; and receives Fixed 5% | Bank of America | 20/6/2025 | 4,237,944 | 6,039,263 |
| CDS | USD | (2,269,083) | Fund provides default protection on CDX.NA.IG.33.V1; and receives Fixed 1% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | 1,303 | 35,051 |
| CDS | EUR | (13,216,123) | Fund provides default protection on ITRAXX.X0.32.V1; and receives Fixed 5% | Goldman Sachs | 20/12/2024 | (766,356) | 1,224,941 |
| IRS | USD | 99,273,000 | Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month; and pays Fixed 0.345% | Goldman Sachs | 27/8/2025 | (13,678) | (13,678) |
| IRS | USD | 16,041,067 | Fund receives Fixed 1.076%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month | Goldman Sachs | 17/8/2030 | 560,284 | 560,284 |
| IRS | USD | 34,193,502 | Fund receives Fixed 0.6305%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month | Goldman Sachs | 21/8/2030 | (299,999) | (299,999) |
| IRS | USD | 23,263,000 | Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month; and pays Fixed 0.8815% | Goldman Sachs | 2/7/2050 | 1,450,733 | 1,450,733 |
| IRS | USD | 15,276,421 | Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month; and pays Fixed 0.872% | Goldman Sachs | 21/7/2050 | 992,811 | 992,811 |

| | | | | | | | |
|-------------------------------------|-----|------------|--|------------------|------------|------------------|-------------------|
| IRS | USD | 18,688,000 | Fund receives Fixed 0.956%; and pays Floating USD LIBOR 3 Month | Goldman Sachs | 28/10/2050 | (824,886) | (824,886) |
| TRS | USD | 354 | Fund receives S&P 500 Annual Dividend Index December 21 + 0bps; and pays Fixed 0% | BNP Paribas | 17/12/2021 | 243,375 | 243,375 |
| TRS | USD | 282 | Fund receives S&P 500 Annual Dividend Index December 20 + 0bps; and pays Fixed 0% | Goldman Sachs | 18/12/2020 | 625,688 | 625,688 |
| 合計(米ドル原資産エクスポージャー - 412,721,204米ドル) | | | | | | <u>8,402,732</u> | <u>12,071,045</u> |

CDS:クレジット・デフォルト・スワップ

IRS:金利スワップ

TRS:トータル・リターン・スワップ

買建スワップション明細表

2020年8月31日現在

| | 額面価額 | 銘柄 | 契約相手 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|-----|-------------|--|---------------|------------|-------------------------|-------------|
| USD | 20,705,288 | Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed semi-annually from 15/12/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/9/2021 | BNP Paribas | 11/6/2021 | 17,868 | 1,268,467 |
| USD | 22,914,632 | Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.72% Fixed semi-annually from 21/4/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 21/1/2021 | Citibank | 19/10/2020 | (362,488) | 207,486 |
| USD | 52,551,488 | Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/2/2021; and pays 0.81% Fixed semi-annually from 23/5/2021 | Citibank | 19/11/2020 | 105,967 | 484,338 |
| USD | 36,289,175 | Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/5/2021; and pays 0.8875% Fixed semi-annually from 10/8/2021 | Citibank | 8/2/2021 | 2,102,546 | 3,813,151 |
| USD | 111,575,000 | Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/1/2021; and pays 1.145% Fixed semi-annually from 28/4/2021 | Deutsche Bank | 26/10/2020 | 1,876,105 | 3,739,407 |
| USD | 56,314,558 | Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.58% Fixed semi-annually from 29/4/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/1/2021 | Goldman Sachs | 27/10/2020 | (713,437) | 409,348 |
| USD | 56,314,558 | Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/1/2021; and pays 0.98% Fixed semi-annually from 29/4/2021 | Goldman Sachs | 27/10/2020 | 2,473,954 | 3,515,454 |
| USD | 75,262,976 | Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.85% Fixed semi-annually from 22/6/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 22/3/2021 | Goldman Sachs | 18/12/2020 | (1,825,142) | 2,284,121 |
| USD | 39,298,098 | Fund purchases a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 6/1/2020; and pays 0.75% Fixed semi annually from 6/4/2021 | JP Morgan | 2/10/2020 | (517,888) | 236,367 |
| USD | 63,496,217 | Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1% Fixed semi-annually from 6/12/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 8/9/2021 | JP Morgan | 4/6/2021 | (111,264) | 3,847,725 |

| | | | | | | |
|-------------------------------------|------------|---|----------------|------------|----------------|-------------------|
| USD | 55,034,000 | Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.93% Fixed semi-annually from 23/4/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/1/2021 | Morgan Stanley | 21/10/2020 | (2,106,563) | 1,050,946 |
| 合計(米ドル原資産エクスポージャー - 233,246,252米ドル) | | | | | <u>939,658</u> | <u>20,856,810</u> |

売建スワップション明細表

2020年8月31日現在

| | 額面価額 | 銘柄 | 契約相手 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|-----|---------------|--|-------------|------------|-------------------------|-------------|
| EUR | (105,850,000) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 12/10/2022; and pays -0.021% Fixed annually from 12/4/2023 | Barclays | 8/4/2022 | (978,777) | (2,309,027) |
| EUR | (105,850,000) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0.021% Fixed annually from 12/4/2023; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 12/10/2022 | Barclays | 8/4/2022 | 676,929 | (653,320) |
| EUR | (27,931,744) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 21/10/2022; and pays -0.15% Fixed annually from 21/4/2023 | Barclays | 19/4/2022 | (109,813) | (456,436) |
| EUR | (27,931,744) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0.15% Fixed annually from 21/4/2023; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 21/10/2022 | Barclays | 19/4/2022 | 154,747 | (191,875) |
| EUR | (69,770,000) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives -0.127% Fixed annually from 21/4/2023; and pays Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 21/10/2022 | Barclays | 19/4/2022 | 412,394 | (452,869) |
| EUR | (69,770,000) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating EUR EURIBOR 6 Month semi-annually from 21/10/2022; and pays -0.127% Fixed annually from 21/4/2023 | Barclays | 19/4/2022 | (87,435) | (952,698) |
| USD | (20,705,288) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/9/2021; and pays 0.5% Fixed semi-annually from 15/12/2021 | BNP Paribas | 11/6/2021 | (214,606) | (711,533) |
| USD | (22,914,632) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.07% Fixed semi-annually from 21/4/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 21/1/2021 | Citibank | 19/10/2020 | (492,801) | (970,900) |
| USD | (52,551,488) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/2/2021; and pays 0.51% Fixed semi-annually from 23/5/2021 | Citibank | 19/11/2020 | 31,831 | (321,315) |
| USD | (328,343,000) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.485% Fixed semi-annually from 27/5/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 27/2/2021 | Citibank | 25/11/2020 | 142,107 | (588,456) |

| | | | | | | |
|-----|---------------|--|---------------|------------|-------------|-------------|
| USD | (199,590,465) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.385% Fixed semi-annually from 10/8/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/5/2021 | Citibank | 8/2/2021 | (437,386) | (1,189,713) |
| USD | (54,433,763) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.2375% Fixed semi-annually from 10/8/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 10/5/2021 | Citibank | 8/2/2021 | (1,293,801) | (2,266,037) |
| USD | (14,879,000) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.764% Fixed semi-annually from 29/3/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/12/2020 | Deutsche Bank | 25/9/2020 | 309,429 | (64,033) |
| USD | (14,879,000) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/12/2020; and pays 0.764% Fixed semi-annually from 29/3/2021 | Deutsche Bank | 25/9/2020 | 259,287 | (114,176) |
| USD | (111,575,000) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.405% Fixed semi-annually from 28/4/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 28/1/2021 | Deutsche Bank | 26/10/2020 | (198,374) | (795,300) |
| USD | (285,048,995) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.37% Fixed semi-annually from 29/4/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/1/2021 | Goldman Sachs | 27/10/2020 | (448,863) | (897,839) |
| USD | (285,048,995) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 29/1/2021; and pays 0.17% Fixed semi-annually from 29/4/2021 | Goldman Sachs | 27/10/2020 | 183,369 | (370,886) |
| USD | (75,262,976) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.2% Fixed semi-annually from 22/6/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 22/3/2021 | Goldman Sachs | 18/12/2020 | (923,573) | (3,018,131) |
| USD | (75,262,976) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 22/3/2021; and pays 0.6% Fixed semi-annually from 22/6/2021 | Goldman Sachs | 18/12/2020 | 851,834 | (1,405,981) |
| USD | (18,599,000) | Fund purchases a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.66% Fixed semi-annually from 25/3/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/12/2020 | JP Morgan | 23/9/2020 | 513,245 | (64,254) |
| USD | (18,599,000) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 25/12/2020; and pays 0.66% Fixed semi-annually from 25/3/2021 | JP Morgan | 23/9/2020 | 388,142 | (189,357) |

| | | | | | | | |
|-------------------------------------|---------------|--|----------------|------------|-----------|------------------|---------------------|
| USD | (63,496,217) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 8/9/2021; and pays 0.5% Fixed semi-annually from 8/12/2021 | JP Morgan | 4/6/2021 | (618,327) | (2,142,237) | |
| USD | (154,219,776) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 2% Fixed semi-annually from 15/8/2022; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 15/5/2022 | JP Morgan | 11/2/2022 | 2,125,253 | (858,899) | |
| USD | (12,403,763) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 0.675% Fixed semi-annually from 14/3/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 14/12/2020 | Morgan Stanley | 10/9/2020 | 232,504 | (86,893) | |
| USD | (12,403,763) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 14/12/2020; and pays 0.675% Fixed semi-annually from 14/3/2021 | Morgan Stanley | 10/9/2020 | 293,811 | (25,586) | |
| USD | (55,034,000) | Fund writes a call option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/1/2021; and pays 0.69% Fixed semi-annually from 23/4/2021 | Morgan Stanley | 21/10/2020 | 1,141,744 | (482,515) | |
| USD | (55,034,000) | Fund writes a put option to enter into an Interest Rate Swap. If exercised Fund receives 1.19% Fixed semi-annually from 23/4/2021; and pays Floating USD LIBOR 3 Month BBA quarterly from 23/1/2021 | Morgan Stanley | 21/10/2020 | 178,924 | (1,385,478) | |
| 合計(米ドル原資産エクスポージャー - 812,873,255米ドル) | | | | | | <u>2,091,794</u> | <u>(22,965,744)</u> |

買建オプション明細表

2020年8月31日現在

| 契約数量 | コール/ 銘柄 プット | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) | |
|-------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------|-------------------------|-------------|-----------|
| 28,198,551 | コール | OTC EUR/USD | Bank of America | EUR 1.185 | 22/9/2020 | (23,243) | 371,564 |
| 21,666,397 | プット | OTC USD/BRL | Bank of America | USD 5.25 | 8/10/2020 | (163,471) | 215,235 |
| 1,017,541 | プット | OTC USD/BRL | Bank of America | USD 4.9 | 8/10/2020 | (106,549) | 82,307 |
| 21,760,505 | プット | OTC USD/BRL | Bank of America | USD 5.2 | 13/10/2020 | (184,171) | 194,919 |
| 1,021,939 | プット | OTC USD/BRL | Bank of America | USD 4.9 | 13/10/2020 | (149,339) | 96,948 |
| 6,399,713 | プット | OTC NZD/USD | Bank of America | NZD 0.62 | 27/10/2020 | (367,359) | 119,733 |
| 86,387,868 | コール | OTC USD/CAD | Bank of America | USD 1.36 | 3/11/2020 | (532,806) | 140,328 |
| 2,608,099 | コール | OTC USD/CAD | Bank of America | USD 1.4 | 3/11/2020 | (245,883) | 39,182 |
| 7,568,192 | プット | OTC AUD/JPY | Bank of America | AUD 1 | 12/11/2020 | (783,989) | 163,276 |
| 12,967,056 | コール | OTC USD/RUB | BNP Paribas | USD 75 | 29/9/2020 | 12,826 | 182,953 |
| 66,414,000 | コール | OTC EUR/USD | BNP Paribas | EUR 1.215 | 27/1/2021 | 109,542 | 1,019,055 |
| 1,450,000 | プット | OTC EUR/USD | Citibank | EUR 1.2 | 4/9/2020 | 38,600 | 416,616 |
| 1,159,155 | プット | OTC USD/CNH | Citibank | USD 7.1 | 4/9/2020 | (384,840) | - |
| 12,967,056 | コール | OTC USD/MXN | Citibank | USD 23 | 29/9/2020 | (115,738) | 43,173 |
| 12,967,056 | コール | OTC USD/ZAR | Citibank | USD 17.2 | 29/9/2020 | (42,064) | 130,722 |
| 64,790,901 | コール | OTC USD/CNH | Citibank | USD 7.05 | 3/11/2020 | (497,785) | 171,829 |
| 7,568,192 | プット | OTC AUD/JPY | Deutsche Bank | AUD 71 | 12/10/2020 | (918,251) | 68,483 |
| 28,242,000 | プット | OTC USD/BRL | Deutsche Bank | USD 5.45 | 22/10/2020 | 191,131 | 783,733 |
| 14,121,000 | コール | OTC USD/BRL | Deutsche Bank | USD 6 | 22/10/2020 | (72,901) | 110,432 |
| 108,318,986 | コール | OTC EUR/AUD | Goldman Sachs | EUR 1.65 | 13/10/2020 | (793,157) | 519,796 |
| 3,600,065 | コール | OTC EUR/AUD | Goldman Sachs | EUR 1.7 | 13/10/2020 | (382,176) | 197,494 |
| 3,072,000 | プット | OTC USD/JPY | HSBC Bank Plc | USD 100 | 18/2/2021 | (133,958) | 847,546 |
| 28,924,403 | プット | OTC NZD/JPY | JP Morgan | NZD 68 | 10/9/2020 | (329,604) | 2,191 |
| 28,198,551 | コール | OTC EUR/USD | JP Morgan | EUR 1.165 | 22/10/2020 | 527,927 | 915,526 |
| 66,504,000 | プット | OTC USD/CAD | Morgan Stanley | USD 1.33 | 21/9/2020 | 1,020,682 | 1,330,524 |
| 12,967,056 | コール | OTC USD/BRL | Morgan Stanley | USD 5.4 | 29/9/2020 | 194,089 | 404,415 |
| 233,745,132 | プット | OTC AUD/JPY | Morgan Stanley | AUD 72.5 | 12/10/2020 | (2,315,293) | 134,937 |
| 117,450,634 | プット | OTC AUD/JPY | Morgan Stanley | AUD 73 | 13/10/2020 | (1,136,435) | 98,622 |
| 66,174,000 | コール | OTC USD/NOK | Morgan Stanley | USD 10.7 | 19/11/2020 | (682,857) | 19,580 |
| 539,634 | プット | OTC EUR/NOK | UBS | EUR 1 | 10/9/2020 | (60,877) | 2,908 |
| 27,235 | コール | Moelis & Co | Barclays | EUR 390 | 18/9/2020 | (130,091) | 384,740 |
| 450,949 | コール | SPDR Gold Trust | BNP Paribas | USD 200 | 18/12/2020 | (1,818,890) | 1,878,892 |
| 265,969 | コール | SPDR Gold Trust | BNP Paribas | USD 190 | 18/12/2020 | 282,590 | 1,777,336 |

| 契約数量 | コール/ 銘柄 プット | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---------|----------------|----------------------------|-----------------------------|------------|-------------------------|-------------|
| 208,801 | コール | Agilent Technologies Inc | Citibank USD 100 | 18/9/2020 | (107,791) | 487,292 |
| 6,012 | プット | Amazon.com Inc | Citibank USD 2,881.581 | 20/11/2020 | (895,098) | 634,651 |
| 13,550 | プット | ASML Holding NV | Credit Suisse EUR 265 | 18/9/2020 | (292,581) | 7,130 |
| 130,997 | プット | DR Horton Inc | Credit Suisse USD 70 | 20/11/2020 | 179,996 | 648,192 |
| 8,192 | コール | EURO STOXX 50 Index | Credit Suisse EUR 3,400 | 17/12/2021 | (20,096) | 1,918,681 |
| 333,145 | コール | SPDR Gold Trust | Goldman Sachs USD 188 | 20/11/2020 | 241,556 | 2,087,179 |
| 125,945 | プット | Tencent Holdings Ltd | JP Morgan HKD 392.2237 | 29/9/2020 | (347,630) | 5,961 |
| 266,477 | コール | SPDR Gold Trust | JP Morgan USD 187 | 16/10/2020 | (190,597) | 1,168,436 |
| 60,258 | プット | Lennar Corp | JP Morgan USD 76 | 20/11/2020 | 85,539 | 438,651 |
| 10,138 | プット | S&P 500 Index | JP Morgan USD 2,900 | 18/12/2020 | (274,685) | 95,352 |
| 425,032 | コール | SPDR Gold Trust | Morgan Stanley USD 187 | 18/9/2020 | (1,192,085) | 1,018,081 |
| 703,623 | コール | SPDR Gold Trust | Morgan Stanley USD 188 | 30/9/2020 | (1,673,942) | 2,065,463 |
| 186,193 | コール | SPDR Gold Trust | Morgan Stanley USD 191.1 | 19/3/2021 | (67,190) | 173,408 |
| 353,900 | コール | SPDR S&P 500 Trust | Morgan Stanley USD 360 | 18/6/2021 | 6,164,682 | 7,633,367 |
| 209,516 | コール | Boston Scientific Corp | Nomura USD 41 | 20/11/2020 | 79,881 | 505,848 |
| 94,516 | コール | Capital One Financial Corp | Nomura USD 55 | 20/11/2020 | 859,445 | 1,634,476 |
| 266,752 | コール | SPDR Gold Trust | Societe Generale USD 186 | 16/10/2020 | 327,924 | 1,278,601 |
| 182,533 | コール | SPDR Gold Trust | Societe Generale USD 198.21 | 18/12/2020 | (97,730) | 164,150 |
| 266,551 | コール | SPDR Gold Trust | Societe Generale USD 190 | 15/1/2021 | 137,247 | 2,002,491 |
| 324 | コール | Alibaba Group Holding Inc | Exchange Traded USD 270 | 20/11/2020 | 472,181 | 1,112,130 |
| 1,180 | コール | Alibaba Group Holding Inc | Exchange Traded USD 210 | 19/2/2021 | 7,500,586 | 9,723,200 |
| 173 | コール | Alphabet Inc | Exchange Traded USD 1,660 | 18/9/2020 | (174,904) | 732,655 |
| 89 | プット | Alphabet Inc | Exchange Traded USD 1,415 | 20/11/2020 | (332,884) | 391,155 |
| 77 | プット | Alphabet Inc | Exchange Traded USD 1,480 | 20/11/2020 | (159,824) | 473,550 |
| 94 | コール | Alphabet Inc | Exchange Traded USD 1,620 | 18/12/2020 | 788,680 | 1,438,670 |
| 86 | コール | Amazon.com Inc | Exchange Traded USD 3,600 | 18/9/2020 | (940,397) | 528,685 |
| 45 | コール | Amazon.com Inc | Exchange Traded USD 3,300 | 15/1/2021 | 915,878 | 2,047,275 |
| 22 | コール | Amazon.com Inc | Exchange Traded USD 2,350 | 15/1/2021 | 1,995,122 | 2,512,125 |
| 491 | プット | Anthem Inc | Exchange Traded USD 260 | 18/9/2020 | (979,417) | 126,432 |
| 503 | プット | Anthem Inc | Exchange Traded USD 250 | 18/12/2020 | (763,171) | 596,055 |
| 2,764 | コール | Apple Inc | Exchange Traded USD 420 | 18/9/2020 | 5,568,485 | 6,481,580 |
| 1,740 | コール | Apple Inc | Exchange Traded USD 75 | 16/10/2020 | 8,410,905 | 9,278,550 |

| 契約数量 | コール/ 銘柄 プット | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) | |
|-------|----------------|-------------------------------------|--------------------|----------|-------------------------|-------------|-----------|
| 1,228 | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 490 | 18/12/2020 | 1,108,855 | 1,884,980 |
| 2,304 | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 500 | 15/1/2021 | 928,952 | 3,490,560 |
| 583 | コール | Autodesk Inc | Exchange Traded | USD 260 | 15/1/2021 | (33,368) | 1,043,570 |
| 5,222 | コール | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 24 | 18/9/2020 | 314,684 | 1,052,233 |
| 5,430 | コール | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 28 | 18/12/2020 | (131,600) | 673,320 |
| 3,559 | コール | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 27 | 18/12/2020 | 61,759 | 571,219 |
| 5,413 | コール | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 27 | 15/1/2021 | 44,735 | 977,047 |
| 1,078 | プット | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Exchange Traded | USD 30 | 20/11/2020 | (225,020) | 40,425 |
| 1,746 | コール | Capital One Financial Corp | Exchange Traded | USD 72.5 | 18/9/2020 | (958,098) | 355,311 |
| 1,074 | プット | Carnival Corp | Exchange Traded | USD 12.5 | 18/9/2020 | (146,003) | 14,499 |
| 1,739 | プット | Carnival Corp | Exchange Traded | USD 15 | 16/10/2020 | (158,304) | 247,808 |
| 250 | プット | Charter Communications Inc | Exchange Traded | USD 500 | 18/12/2020 | (438,060) | 197,500 |
| 432 | プット | Chewy Inc | Exchange Traded | USD 45 | 16/10/2020 | (188,342) | 46,440 |
| 2,254 | コール | Citigroup Inc | Exchange Traded | USD 52.5 | 18/9/2020 | (526,847) | 289,639 |
| 2,820 | コール | Citigroup Inc | Exchange Traded | USD 52.5 | 18/12/2020 | 120,595 | 1,113,900 |
| 3,249 | コール | Comcast Corp | Exchange Traded | USD 45 | 15/1/2021 | 164,933 | 922,716 |
| 239 | コール | Costco Wholesale Corp | Exchange Traded | USD 315 | 16/10/2020 | 529,447 | 864,582 |
| 1,965 | コール | DR Horton Inc | Exchange Traded | USD 80 | 15/1/2021 | (255,764) | 820,388 |
| 432 | プット | Etsy Inc | Exchange Traded | USD 70 | 18/9/2020 | (258,126) | 2,160 |
| 4,262 | コール | EURO STOXX Bank Index | Exchange Traded | EUR 70 | 18/9/2020 | (549,771) | 82,602 |
| 2,158 | プット | Exxon Mobil Corp | Exchange Traded | USD 37.5 | 16/10/2020 | (150,496) | 244,933 |
| 1,122 | コール | Facebook Inc | Exchange Traded | USD 265 | 18/9/2020 | 2,355,410 | 3,511,860 |
| 1,984 | コール | Fortive Corp | Exchange Traded | USD 75 | 18/12/2020 | (24,276) | 813,440 |
| 811 | コール | Global Payments Inc | Exchange Traded | USD 185 | 20/11/2020 | 26,048 | 673,130 |
| 835 | コール | Global Payments Inc | Exchange Traded | USD 180 | 18/12/2020 | 298,733 | 1,068,800 |
| 1,110 | コール | Home Depot Inc/The | Exchange Traded | USD 255 | 18/9/2020 | 2,164,790 | 3,249,525 |
| 1,702 | コール | JPMorgan Chase & Co | Exchange Traded | USD 95 | 18/9/2020 | 340,845 | 1,246,715 |
| 818 | コール | JPMorgan Chase & Co | Exchange Traded | USD 110 | 18/12/2020 | (97,546) | 351,740 |

| 契約数量 | コール/ 銘柄 プット | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|-----------|-------------------------------|--------------------|------------|------------|-------------------------|-------------|
| 427コール | L3Harris Technologies Inc | Exchange Traded | USD 165 | 16/10/2020 | 376,939 | 770,735 |
| 783コール | L3Harris Technologies Inc | Exchange Traded | USD 190 | 18/12/2020 | (68,306) | 579,420 |
| 1,175コール | Mastercard Inc | Exchange Traded | USD 335 | 15/1/2021 | 2,541,248 | 5,222,875 |
| 435コール | Mastercard Inc | Exchange Traded | USD 350 | 15/1/2021 | 768,977 | 1,529,025 |
| 681コール | McDonald's Corp | Exchange Traded | USD 220 | 18/12/2020 | 163,620 | 583,958 |
| 753コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 165 | 18/12/2020 | 3,898,922 | 4,902,030 |
| 681コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 220 | 18/12/2020 | 802,058 | 1,641,210 |
| 2,626コール | Morgan Stanley | Exchange Traded | USD 55 | 16/10/2020 | (320,999) | 413,595 |
| 2,727コール | Morgan Stanley | Exchange Traded | USD 55 | 15/1/2021 | 27,991 | 879,458 |
| 33コール | NASDAQ 100 Stock Index | Exchange Traded | USD 11,450 | 18/9/2020 | 1,700,528 | 2,363,790 |
| 63コール | NASDAQ 100 Stock Index | Exchange Traded | USD 11,950 | 16/10/2020 | 1,645,528 | 3,701,880 |
| 260プット | NVIDIA Corp | Exchange Traded | USD 470 | 20/11/2020 | (124,198) | 744,900 |
| 644コール | NXP Semiconductors NV | Exchange Traded | USD 110 | 18/9/2020 | 429,716 | 1,044,890 |
| 969コール | PayPal Holdings Inc | Exchange Traded | USD 200 | 18/9/2020 | 88,917 | 789,735 |
| 1,192コール | PPG Industries Inc | Exchange Traded | USD 125 | 15/1/2021 | (98,025) | 786,720 |
| 679コール | Russell 2000 E- Mini Index | Exchange Traded | USD 1,550 | 18/9/2020 | (91,785) | 2,912,910 |
| 10,953コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 342 | 18/9/2020 | 6,744,466 | 12,256,407 |
| 3,056コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 340 | 18/9/2020 | 2,554,001 | 3,916,264 |
| 1,751コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 345 | 18/9/2020 | 1,030,097 | 1,554,888 |
| 730コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 333 | 18/9/2020 | 1,001,386 | 1,378,240 |
| 10,649コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 350 | 16/10/2020 | 4,648,448 | 9,589,425 |
| 3,044コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 333 | 16/10/2020 | 4,197,029 | 6,540,034 |
| 2,221コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 350 | 20/11/2020 | 2,231,766 | 3,224,892 |
| 3,474コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 340 | 18/12/2020 | 4,729,021 | 8,294,175 |
| 2,184コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 360 | 18/12/2020 | 1,272,757 | 2,559,648 |
| 1,398コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 350 | 18/12/2020 | 1,028,599 | 2,419,938 |
| 1,078コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 350 | 31/12/2020 | 1,247,528 | 1,949,563 |
| 1,581コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 305 | 17/12/2021 | 7,638,224 | 9,896,269 |
| 777コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 360 | 17/12/2021 | 1,053,300 | 2,060,992 |

| 契約数量 | コール/ 銘柄 プット | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---------------------------------------|---------------------------------|--------------------|----------|------------|-------------------------|-------------|
| 846コール | Starbucks Corp | Exchange Traded | USD 77.5 | 16/10/2020 | 218,066 | 719,100 |
| 1,802コール | Starbucks Corp | Exchange Traded | USD 82.5 | 15/1/2021 | 651,899 | 1,414,570 |
| 786コール | Union Pacific Corp | Exchange Traded | USD 200 | 18/9/2020 | (5,294) | 207,111 |
| 740コール | Union Pacific Corp | Exchange Traded | USD 200 | 15/1/2021 | 127,846 | 895,400 |
| 435プット | Unitedhealth Group Inc | Exchange Traded | USD 280 | 18/9/2020 | (810,351) | 67,425 |
| 450プット | Unitedhealth Group Inc | Exchange Traded | USD 280 | 18/12/2020 | (731,132) | 484,875 |
| 1,144コール | VMware Inc | Exchange Traded | USD 160 | 16/10/2020 | (769,041) | 491,920 |
| 3,303プット | Walgreens Boots Alliance Inc | Exchange Traded | USD 42.5 | 15/1/2021 | 545,868 | 2,006,573 |
| 880コール | Walmart Inc | Exchange Traded | USD 140 | 18/9/2020 | 76,251 | 232,320 |
| 868コール | Walmart Inc | Exchange Traded | USD 135 | 18/9/2020 | 71,092 | 420,980 |
| 803コール | Walt Disney Co/The | Exchange Traded | USD 110 | 18/9/2020 | 1,386,860 | 1,935,230 |
| 1,091コール | Walt Disney Co/The | Exchange Traded | USD 140 | 15/1/2021 | 202,123 | 886,438 |
| 1,841コール | Wells Fargo & Co | Exchange Traded | USD 35 | 16/10/2020 | (319,853) | 11,966 |
| 合計(米ドル原資産エクスポージャー - 2,264,772,973米ドル) | | | | | 71,303,997 | 202,407,283 |

売建オプション明細表
2020年8月31日現在

| 契約数量 | コール/ 銘柄 プット | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|------------------|--------------------------|-----------------|---------------|------------|-------------------------|-------------|
| (28,198,551)コール | OTC EUR/USD | Bank of America | EUR 1.205 | 22/9/2020 | 68,214 | (123,288) |
| (32,499,595)プット | OTC USD/BRL | Bank of America | USD 5.05 | 8/10/2020 | 109,065 | (118,074) |
| (32,640,757)プット | OTC USD/BRL | Bank of America | USD 5 | 13/10/2020 | 112,565 | (110,306) |
| (66,414,000)プット | OTC EUR/USD | BNP Paribas | EUR 1.1 | 27/1/2021 | 147,283 | (100,829) |
| (99,622,000)コール | OTC EUR/USD | BNP Paribas | EUR 1.335 | 27/1/2021 | 26,321 | (142,150) |
| (14,121,000)コール | OTC USD/BRL | Deutsche Bank | USD 5.65 | 22/10/2020 | 153,073 | (280,484) |
| (108,318,986)コール | OTC EUR/AUD | Goldman Sachs | EUR 1.71 | 13/10/2020 | 360,461 | (91,433) |
| (3,072,000)プット | OTC USD/JPY | HSBC Bank Plc | USD 100 | 19/11/2020 | 102,897 | (516,111) |
| (36,155,503)プット | OTC NZD/JPY | JP Morgan | NZD 65 | 10/9/2020 | 191,743 | (133) |
| (28,198,551)コール | OTC EUR/USD | JP Morgan | EUR 1.185 | 22/10/2020 | (316,256) | (511,689) |
| (117,450,634)プット | OTC AUD/JPY | Morgan Stanley | AUD 69.5 | 13/10/2020 | 480,903 | (6,566) |
| (107,927)コール | OTC EUR/NOK | UBS | EUR 1 | 10/9/2020 | 28,506 | (37,671) |
| (18,152)プット | Moelis & Co | Barclays | EUR 355 | 18/9/2020 | 277,847 | (24,917) |
| (17,010)プット | Roche Holding AG | Barclays | CHF 305 | 18/9/2020 | 48,815 | (40,854) |
| (11,679)プット | Roche Holding AG | Barclays | CHF 300 | 16/10/2020 | (2,969) | (58,233) |
| (64,680)コール | Sanofi | Barclays | EUR 98 | 16/10/2020 | 43,290 | (6,031) |
| (64,680)プット | Sanofi | Barclays | EUR 80 | 16/10/2020 | (28,951) | (100,276) |
| (15,658)プット | Roche Holding AG | Barclays | CHF 350 | 20/11/2020 | 5,678 | (31,978) |
| (15,658)コール | Roche Holding AG | Barclays | CHF 285 | 20/11/2020 | (3,263) | (76,827) |
| (52,195)プット | Sanofi | Barclays | EUR 76 | 20/11/2020 | (13,508) | (84,771) |
| (52,195)コール | Sanofi | Barclays | EUR 98 | 20/11/2020 | 25,546 | (21,758) |
| (265,969)コール | SPDR Gold Trust | BNP Paribas | USD 210 | 18/12/2020 | (151,382) | (725,875) |
| (444,169)コール | SPDR Gold Trust | BNP Paribas | USD 225 | 18/12/2020 | 55,273 | (704,256) |
| (208,801)コール | Agilent Technologies Inc | Citibank | USD 110 | 18/9/2020 | 26,908 | (35,733) |
| (6,012)プット | Amazon.com Inc | Citibank | USD 2,426.594 | 20/11/2020 | 380,293 | (202,251) |
| (6,012)コール | Amazon.com Inc | Citibank | USD 3,397.232 | 20/11/2020 | (956,543) | (2,017,077) |
| (13,550)プット | ASML Holding NV | Credit Suisse | EUR 235 | 18/9/2020 | 141,251 | (1,226) |
| (13,550)コール | ASML Holding NV | Credit Suisse | EUR 305 | 18/9/2020 | (62,058) | (219,402) |
| (130,997)プット | DR Horton Inc | Credit Suisse | USD 60 | 20/11/2020 | (85,148) | (260,121) |
| (130,997)コール | DR Horton Inc | Credit Suisse | USD 85 | 20/11/2020 | 137,435 | (193,463) |
| (8,192)プット | EURO STOXX 50 Index | Credit Suisse | EUR 2,600 | 17/12/2021 | 193,399 | (1,289,551) |
| (132,752)プット | SPDR Gold Trust | Goldman Sachs | USD 170 | 20/11/2020 | 4,729 | (281,219) |
| (333,145)コール | SPDR Gold Trust | Goldman Sachs | USD 205 | 20/11/2020 | (124,974) | (824,579) |
| (125,945)コール | Tencent Holdings Ltd | JP Morgan | HKD 580 | 29/9/2020 | 105,090 | (166,530) |
| (125,945)プット | Tencent Holdings Ltd | JP Morgan | HKD 350.937 | 29/9/2020 | 158,902 | (1,455) |
| (266,477)コール | SPDR Gold Trust | JP Morgan | USD 197 | 16/10/2020 | 205,245 | (493,191) |
| (266,477)プット | SPDR Gold Trust | JP Morgan | USD 170 | 16/10/2020 | 191,321 | (261,690) |

| 契約数量 | コール/ 銘柄 プット | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|--------------|------------------------------|------------------|-----------|------------|-------------------------|-------------|
| (60,258)コール | Lennar Corp | JP Morgan | USD 86 | 20/11/2020 | 79,033 | (142,572) |
| (60,258)プット | Lennar Corp | JP Morgan | USD 62 | 20/11/2020 | (41,164) | (145,410) |
| (425,032)コール | SPDR Gold Trust | Morgan Stanley | USD 202 | 18/9/2020 | 678,632 | (143,805) |
| (398,281)プット | SPDR Gold Trust | Morgan Stanley | USD 165 | 30/9/2020 | 262,410 | (120,736) |
| (584,141)コール | SPDR Gold Trust | Morgan Stanley | USD 203 | 30/9/2020 | 819,066 | (390,106) |
| (78,316)コール | Autodesk Inc | Nomura | USD 260 | 20/11/2020 | 389,431 | (953,688) |
| (104,758)プット | Boston Scientific Corp | Nomura | USD 35 | 20/11/2020 | 11,987 | (87,533) |
| (209,516)コール | Boston Scientific Corp | Nomura | USD 45 | 20/11/2020 | (51,223) | (174,838) |
| (94,516)コール | Capital One Financial Corp | Nomura | USD 70 | 20/11/2020 | (323,468) | (649,548) |
| (133,453)コール | SPDR Gold Trust | Societe Generale | USD 196 | 16/10/2020 | (61,499) | (267,951) |
| (266,551)コール | SPDR Gold Trust | Societe Generale | USD 215 | 15/1/2021 | (62,515) | (760,958) |
| (266,551)プット | SPDR Gold Trust | Societe Generale | USD 170 | 15/1/2021 | 386,909 | (877,502) |
| (21,297)コール | ASML Holding NV | UBS Exchange | EUR 370 | 20/11/2020 | 152,689 | (64,696) |
| (727)コール | Abbott Laboratories | Traded Exchange | USD 110 | 20/11/2020 | (361,494) | (505,265) |
| (724)コール | AbbVie Inc | Traded Exchange | USD 100 | 18/9/2020 | 122,476 | (27,512) |
| (756)コール | Agilent Technologies Inc | Traded Exchange | USD 110 | 20/11/2020 | (39,091) | (145,530) |
| (268)コール | Air Products & Chemicals Inc | Traded Exchange | USD 270 | 18/9/2020 | (579,349) | (726,280) |
| (1,180)プット | Alibaba Group Holding Inc | Traded Exchange | USD 190 | 19/2/2021 | 1,771,835 | (480,850) |
| (1,194)コール | Alibaba Group Holding Inc | Traded Exchange | USD 350 | 19/2/2021 | 179,540 | (1,331,310) |
| (23)コール | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,425 | 18/9/2020 | (363,967) | (510,485) |
| (345)コール | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,760 | 18/9/2020 | 557,225 | (427,800) |
| (77)プット | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,280 | 20/11/2020 | 75,300 | (155,155) |
| (77)コール | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,740 | 20/11/2020 | (285,052) | (644,105) |
| (89)コール | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,660 | 20/11/2020 | (514,501) | (1,066,220) |
| (89)プット | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,200 | 20/11/2020 | 143,996 | (110,360) |
| (151)コール | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,840 | 20/11/2020 | (290,777) | (784,445) |
| (94)プット | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,300 | 18/12/2020 | 63,410 | (288,580) |
| (94)コール | Alphabet Inc | Traded Exchange | USD 1,800 | 18/12/2020 | (509,982) | (709,700) |
| (12)コール | Amazon.com Inc | Traded Exchange | USD 2,485 | 18/9/2020 | (981,602) | (1,143,210) |
| (173)コール | Amazon.com Inc | Traded Exchange | USD 4,000 | 18/9/2020 | 1,377,490 | (217,115) |
| (44)コール | Amazon.com Inc | Traded Exchange | USD 3,440 | 16/10/2020 | (552,121) | (942,480) |
| (70)コール | Amazon.com Inc | Traded Exchange | USD 3,850 | 20/11/2020 | (183,354) | (1,157,975) |

| 契約数量 | コール/ プット | 銘柄 | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---------|-------------|-------------------------------------|--------------------|-----------|------------|-------------------------|--------------|
| (103) | コール | Amazon.com Inc | Exchange Traded | USD 3,500 | 20/11/2020 | (1,373,914) | (3,007,342) |
| (22) | プット | Amazon.com Inc | Exchange Traded | USD 1,850 | 15/1/2021 | 163,002 | (33,550) |
| (44) | コール | Amazon.com Inc | Exchange Traded | USD 2,900 | 15/1/2021 | (2,761,378) | (3,088,360) |
| (45) | コール | Amazon.com Inc | Exchange Traded | USD 3,750 | 15/1/2021 | (626,349) | (1,158,413) |
| (45) | プット | Amazon.com Inc | Exchange Traded | USD 2,695 | 15/1/2021 | 50,258 | (483,188) |
| (368) | コール | Anthem Inc | Exchange Traded | USD 300 | 18/9/2020 | 282,529 | (23,920) |
| (368) | コール | Anthem Inc | Exchange Traded | USD 310 | 18/9/2020 | 185,012 | (5,520) |
| (491) | プット | Anthem Inc | Exchange Traded | USD 230 | 18/9/2020 | 487,434 | (22,095) |
| (503) | プット | Anthem Inc | Exchange Traded | USD 210 | 18/12/2020 | 471,679 | (201,200) |
| (503) | コール | Anthem Inc | Exchange Traded | USD 290 | 18/12/2020 | 18,976 | (784,680) |
| (260) | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 325 | 18/9/2020 | (1,123,348) | (1,219,400) |
| (5,524) | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 445 | 18/9/2020 | (8,769,865) | (9,749,860) |
| (5,892) | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 555 | 18/9/2020 | (508,539) | (1,475,946) |
| (3,476) | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 330 | 16/10/2020 | (15,144,471) | (15,972,220) |
| (1,228) | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 560 | 18/12/2020 | (696,250) | (1,003,890) |
| (1,228) | プット | Apple Inc | Exchange Traded | USD 390 | 18/12/2020 | 134,436 | (303,930) |
| (2,304) | プット | Apple Inc | Exchange Traded | USD 400 | 15/1/2021 | 76,452 | (817,920) |
| (4,608) | コール | Apple Inc | Exchange Traded | USD 600 | 15/1/2021 | (1,171,897) | (3,052,800) |
| (1,357) | コール | Applied Materials Inc | Exchange Traded | USD 70 | 16/10/2020 | 186,256 | (128,236) |
| (583) | コール | Autodesk Inc | Exchange Traded | USD 290 | 15/1/2021 | (61,071) | (508,668) |
| (583) | プット | Autodesk Inc | Exchange Traded | USD 210 | 15/1/2021 | 45,320 | (687,940) |
| (5,222) | コール | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 30 | 18/9/2020 | 61,415 | (28,721) |
| (5,430) | プット | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 22 | 18/12/2020 | 12,284 | (480,555) |
| (5,430) | コール | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 32 | 18/12/2020 | 61,159 | (214,485) |
| (5,413) | プット | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 22 | 15/1/2021 | 6,830 | (581,898) |
| (5,413) | コール | Bank of America Corp | Exchange Traded | USD 31 | 15/1/2021 | (20,229) | (359,965) |
| (1,078) | プット | BJ's Wholesale Club Holdings Inc | Exchange Traded | USD 25 | 20/11/2020 | 56,874 | (48,510) |
| (240) | コール | Charter Communications Inc | Exchange Traded | USD 600 | 18/9/2020 | (324,130) | (610,800) |
| (127) | コール | Charter Communications Inc | Exchange Traded | USD 660 | 18/12/2020 | (51,725) | (238,760) |

| 契約数量 | コール/ プット | 銘柄 | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|------------|-------------|----------------------------|-----------------|----------|------------|-------------------------|-------------|
| (250)プット | | Charter Communications Inc | Exchange Traded | USD 425 | 18/12/2020 | 187,560 | (61,875) |
| (250)コール | | Charter Communications Inc | Exchange Traded | USD 600 | 18/12/2020 | (830,568) | (1,200,000) |
| (432)プット | | Chewy Inc | Exchange Traded | USD 35 | 16/10/2020 | 74,779 | (11,448) |
| (539)コール | | Citigroup Inc | Exchange Traded | USD 60 | 18/9/2020 | 34,636 | (5,659) |
| (2,820)プット | | Citigroup Inc | Exchange Traded | USD 42.5 | 18/12/2020 | (13,365) | (458,250) |
| (2,820)コール | | Citigroup Inc | Exchange Traded | USD 60 | 18/12/2020 | (78,223) | (444,150) |
| (1,663)コール | | Comcast Corp | Exchange Traded | USD 47.5 | 16/10/2020 | (28,662) | (96,454) |
| (3,649)コール | | Comcast Corp | Exchange Traded | USD 40 | 16/10/2020 | (1,565,914) | (1,952,215) |
| (3,249)プット | | Comcast Corp | Exchange Traded | USD 37.5 | 15/1/2021 | 64,205 | (344,394) |
| (3,249)コール | | Comcast Corp | Exchange Traded | USD 52.5 | 15/1/2021 | 60,875 | (180,320) |
| (239)コール | | Costco Wholesale Corp | Exchange Traded | USD 345 | 16/10/2020 | (251,487) | (348,940) |
| (239)プット | | Costco Wholesale Corp | Exchange Traded | USD 280 | 16/10/2020 | 125,415 | (27,007) |
| (1,965)コール | | DR Horton Inc | Exchange Traded | USD 95 | 15/1/2021 | 31,260 | (238,748) |
| (1,965)プット | | DR Horton Inc | Exchange Traded | USD 60 | 15/1/2021 | (107,462) | (628,800) |
| (905)プット | | Edwards Lifesciences Corp | Exchange Traded | USD 70 | 20/11/2020 | 64,847 | (110,863) |
| (905)コール | | Edwards Lifesciences Corp | Exchange Traded | USD 85 | 20/11/2020 | (244,681) | (429,875) |
| (432)プット | | Etsy Inc | Exchange Traded | USD 60 | 18/9/2020 | 126,984 | (1,296) |
| (8,524)コール | | EURO STOXX Bank Index | Exchange Traded | EUR 80 | 18/9/2020 | 295,947 | (38,124) |
| (152)コール | | Facebook Inc | Exchange Traded | USD 215 | 18/9/2020 | (1,018,754) | (1,196,620) |
| (2,244)コール | | Facebook Inc | Exchange Traded | USD 285 | 18/9/2020 | (2,581,432) | (3,741,870) |
| (707)コール | | Facebook Inc | Exchange Traded | USD 290 | 20/11/2020 | (1,272,428) | (2,105,093) |
| (1,984)プット | | Fortive Corp | Exchange Traded | USD 65 | 18/12/2020 | (59,007) | (570,400) |
| (1,984)コール | | Fortive Corp | Exchange Traded | USD 85 | 18/12/2020 | (168,120) | (372,000) |
| (811)プット | | Global Payments Inc | Exchange Traded | USD 155 | 20/11/2020 | 66,493 | (405,500) |
| (835)プット | | Global Payments Inc | Exchange Traded | USD 150 | 18/12/2020 | 110,846 | (421,675) |
| (835)コール | | Global Payments Inc | Exchange Traded | USD 200 | 18/12/2020 | (189,747) | (421,675) |
| (758)プット | | Guardant Health Inc | Exchange Traded | USD 85 | 16/10/2020 | 50,034 | (242,560) |
| (758)コール | | Guardant Health Inc | Exchange Traded | USD 105 | 16/10/2020 | (70,606) | (310,780) |
| (618)コール | | HCA Healthcare Inc | Exchange Traded | USD 145 | 18/12/2020 | (72,462) | (528,390) |
| (1,110)プット | | Home Depot Inc/The | Exchange Traded | USD 220 | 18/9/2020 | 518,093 | (17,760) |

| 契約数量 | コール/ プット | 銘柄 | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---------|-------------|---------------------------|---------------------|---------|------------|-------------------------|-------------|
| (1,665) | コール | Home Depot Inc | The Exchange Traded | USD 275 | 18/9/2020 | (1,442,299) | (1,931,400) |
| (560) | コール | Home Depot Inc | The Exchange Traded | USD 320 | 15/1/2021 | (59,524) | (365,400) |
| (392) | コール | Intel Corp | Exchange Traded | USD 75 | 18/9/2020 | 37,146 | (1,176) |
| (102) | プット | Intuitive Surgical Inc | Exchange Traded | USD 600 | 20/11/2020 | 40,609 | (119,340) |
| (102) | コール | Intuitive Surgical Inc | Exchange Traded | USD 760 | 20/11/2020 | (155,149) | (330,990) |
| (165) | コール | Johnson & Johnson | Exchange Traded | USD 165 | 18/9/2020 | 18,028 | (2,640) |
| (3,411) | コール | JPMorgan Chase & Co | Exchange Traded | USD 115 | 18/9/2020 | 448,628 | (97,213) |
| (427) | コール | L3Harris Technologies Inc | Exchange Traded | USD 190 | 16/10/2020 | (74,615) | (139,842) |
| (427) | プット | L3Harris Technologies Inc | Exchange Traded | USD 135 | 16/10/2020 | 160,233 | (22,417) |
| (783) | コール | L3Harris Technologies Inc | Exchange Traded | USD 210 | 18/12/2020 | 4,118 | (174,218) |
| (783) | プット | L3Harris Technologies Inc | Exchange Traded | USD 155 | 18/12/2020 | 17,816 | (371,925) |
| (536) | コール | Lowe's Cos Inc | Exchange Traded | USD 175 | 16/10/2020 | (109,740) | (188,940) |
| (1,131) | コール | Lowe's Cos Inc | Exchange Traded | USD 180 | 15/1/2021 | (319,220) | (825,630) |
| (615) | コール | Marsh & McLennan Cos Inc | Exchange Traded | USD 120 | 16/10/2020 | 26,278 | (72,262) |
| (466) | コール | Mastercard Inc | Exchange Traded | USD 345 | 16/10/2020 | (773,291) | (1,203,445) |
| (435) | プット | Mastercard Inc | Exchange Traded | USD 280 | 15/1/2021 | 100,158 | (231,638) |
| (435) | コール | Mastercard Inc | Exchange Traded | USD 400 | 15/1/2021 | (415,314) | (592,688) |
| (587) | プット | Mastercard Inc | Exchange Traded | USD 300 | 15/1/2021 | 459,462 | (484,275) |
| (1,175) | コール | Mastercard Inc | Exchange Traded | USD 365 | 15/1/2021 | (1,891,469) | (3,216,563) |
| (692) | コール | McDonald's Corp | Exchange Traded | USD 210 | 18/9/2020 | (297,637) | (467,100) |
| (358) | コール | McDonald's Corp | Exchange Traded | USD 220 | 16/10/2020 | (81,151) | (158,415) |
| (681) | コール | McDonald's Corp | Exchange Traded | USD 240 | 18/12/2020 | (72,008) | (179,444) |
| (681) | プット | McDonald's Corp | Exchange Traded | USD 180 | 18/12/2020 | 57,378 | (203,279) |
| (855) | コール | Merck & Co Inc | Exchange Traded | USD 85 | 18/9/2020 | (70,254) | (161,595) |
| (175) | コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 190 | 18/9/2020 | (523,645) | (662,375) |
| (677) | コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 230 | 18/9/2020 | (94,489) | (429,895) |
| (678) | コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 240 | 20/11/2020 | (491,055) | (849,195) |
| (1,111) | コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 250 | 20/11/2020 | (419,123) | (1,055,450) |
| (681) | プット | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 180 | 18/12/2020 | 136,370 | (328,583) |
| (681) | コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 250 | 18/12/2020 | (507,171) | (784,853) |

| 契約数量 | コール/ プット | 銘柄 | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---------|-------------|-------------------------------|--------------------|------------|------------|-------------------------|--------------|
| (753) | コール | Microsoft Corp | Exchange Traded | USD 190 | 18/12/2020 | (2,904,178) | (3,286,845) |
| (606) | コール | Morgan Stanley | Exchange Traded | USD 50 | 18/9/2020 | (142,859) | (186,345) |
| (3,939) | コール | Morgan Stanley | Exchange Traded | USD 65 | 16/10/2020 | 150,706 | (76,811) |
| (2,727) | コール | Morgan Stanley | Exchange Traded | USD 62.5 | 15/1/2021 | (30,646) | (313,605) |
| (2,727) | プット | Morgan Stanley | Exchange Traded | USD 44 | 15/1/2021 | 92,063 | (466,317) |
| (19) | コール | NASDAQ 100 Stock Index | Exchange Traded | USD 9,175 | 18/9/2020 | (4,327,062) | (5,449,485) |
| (66) | コール | NASDAQ 100 Stock Index | Exchange Traded | USD 11,800 | 18/9/2020 | (2,237,817) | (2,998,710) |
| (229) | プット | Netflix Inc | Exchange Traded | USD 350 | 20/11/2020 | 85,930 | (110,492) |
| (512) | コール | NextEra Energy Inc | Exchange Traded | USD 280 | 18/9/2020 | (80,717) | (401,920) |
| (288) | コール | NVIDIA Corp | Exchange Traded | USD 560 | 20/11/2020 | (287,698) | (1,163,520) |
| (164) | コール | PayPal Holdings Inc | Exchange Traded | USD 180 | 18/9/2020 | (353,952) | (392,780) |
| (1,938) | コール | PayPal Holdings Inc | Exchange Traded | USD 220 | 18/9/2020 | 144,964 | (298,452) |
| (2,001) | コール | Pfizer Inc | Exchange Traded | USD 37 | 18/9/2020 | (150,529) | (250,125) |
| (5,292) | コール | Pfizer Inc | Exchange Traded | USD 40 | 20/11/2020 | (13,113) | (656,208) |
| (1,192) | コール | PPG Industries Inc | Exchange Traded | USD 140 | 15/1/2021 | (35,450) | (247,340) |
| (1,192) | プット | PPG Industries Inc | Exchange Traded | USD 100 | 15/1/2021 | 24,146 | (366,540) |
| (288) | プット | ResMed Inc | Exchange Traded | USD 160 | 15/1/2021 | 34,520 | (200,160) |
| (288) | コール | ResMed Inc | Exchange Traded | USD 195 | 15/1/2021 | (52,000) | (233,280) |
| (453) | コール | Russell 2000 E- Mini Index | Exchange Traded | USD 1,650 | 18/9/2020 | 457,041 | (255,945) |
| (453) | プット | Russell 2000 E- Mini Index | Exchange Traded | USD 1,200 | 18/9/2020 | 881,576 | (35,107) |
| (167) | コール | ServiceNow Inc | Exchange Traded | USD 490 | 20/11/2020 | (339,158) | (698,060) |
| (1,330) | プット | SPDR Gold Shares | Exchange Traded | USD 165 | 16/10/2020 | 214,471 | (65,835) |
| (560) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 282 | 18/9/2020 | 1,201,681 | (15,960) |
| (875) | コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 360 | 18/9/2020 | (107,832) | (138,250) |
| (615) | コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 253 | 30/9/2020 | (4,378,054) | (5,980,260) |
| (615) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 253 | 30/9/2020 | 1,559,085 | (18,757) |
| (1,857) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 230 | 30/9/2020 | 4,907,342 | (30,640) |
| (1,857) | コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 230 | 30/9/2020 | (18,204,995) | (22,309,069) |
| (739) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 310 | 16/10/2020 | 189,001 | (206,181) |
| (1,491) | コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 295 | 16/10/2020 | (5,554,393) | (8,368,983) |

| 契約数量 | コール/ プット | 銘柄 | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---------|-------------|------------------------------|-----------------|----------|------------|-------------------------|-------------|
| (1,491) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 295 | 16/10/2020 | 2,705,743 | (275,835) |
| (2,078) | コール | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 375 | 16/10/2020 | (130,004) | (231,697) |
| (2,717) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 300 | 16/10/2020 | 456,572 | (574,646) |
| (2,953) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 300 | 20/11/2020 | 100,425 | (1,485,359) |
| (1,078) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 250 | 31/12/2020 | 503,690 | (303,457) |
| (389) | プット | SPDR S&P 500 ETF Trust | Exchange Traded | USD 270 | 17/12/2021 | 160,549 | (576,109) |
| (1,692) | コール | Starbucks Corp | Exchange Traded | USD 87.5 | 16/10/2020 | (2,105) | (422,154) |
| (1,802) | プット | Starbucks Corp | Exchange Traded | USD 67.5 | 15/1/2021 | 119,398 | (321,657) |
| (1,802) | コール | Starbucks Corp | Exchange Traded | USD 92.5 | 15/1/2021 | (365,335) | (617,185) |
| (508) | コール | STMicroelectronics NV | Exchange Traded | EUR 29 | 18/9/2020 | 23,967 | (6,967) |
| (187) | コール | Thermo Fisher Scientific Inc | Exchange Traded | USD 390 | 18/9/2020 | (650,586) | (750,805) |
| (711) | コール | Uber Technologies Inc | Exchange Traded | USD 46 | 18/9/2020 | 71,284 | (1,777) |
| (740) | コール | Union Pacific Corp | Exchange Traded | USD 230 | 15/1/2021 | (103,777) | (213,120) |
| (740) | プット | Union Pacific Corp | Exchange Traded | USD 165 | 15/1/2021 | 40,886 | (408,850) |
| (429) | コール | Unitedhealth Group Inc | Exchange Traded | USD 330 | 18/9/2020 | 284,448 | (82,797) |
| (435) | プット | Unitedhealth Group Inc | Exchange Traded | USD 230 | 18/9/2020 | 296,478 | (14,790) |
| (657) | コール | Unitedhealth Group Inc | Exchange Traded | USD 320 | 18/9/2020 | 311,542 | (358,065) |
| (450) | コール | Unitedhealth Group Inc | Exchange Traded | USD 320 | 18/12/2020 | (199,023) | (882,000) |
| (450) | プット | Unitedhealth Group Inc | Exchange Traded | USD 240 | 18/12/2020 | 380,354 | (226,125) |
| (738) | コール | US Bancorp | Exchange Traded | USD 42.5 | 18/9/2020 | 28,236 | (4,797) |
| (1,144) | コール | VMware Inc | Exchange Traded | USD 180 | 16/10/2020 | 414,987 | (114,400) |
| (1,144) | プット | VMware Inc | Exchange Traded | USD 130 | 16/10/2020 | 443,584 | (223,080) |
| (3,303) | プット | Walgreens Boots Alliance Inc | Exchange Traded | USD 37.5 | 15/1/2021 | (319,533) | (979,340) |
| (3,303) | コール | Walgreens Boots Alliance Inc | Exchange Traded | USD 47.5 | 15/1/2021 | 316,297 | (254,331) |
| (880) | プット | Walmart Inc | Exchange Traded | USD 125 | 18/9/2020 | 24,025 | (45,320) |
| (2,615) | コール | Walmart Inc | Exchange Traded | USD 145 | 18/9/2020 | (32,516) | (360,870) |
| (803) | コール | Walt Disney Co/The | Exchange Traded | USD 125 | 18/9/2020 | (555,273) | (788,947) |
| (583) | コール | Walt Disney Co/The | Exchange Traded | USD 140 | 16/10/2020 | (129,565) | (218,625) |
| (1,091) | プット | Walt Disney Co/The | Exchange Traded | USD 110 | 15/1/2021 | 87,014 | (314,208) |

| 契約数量 | コール/ プット | 銘柄 | 契約相手 | 行使価格 | 満期日 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) | 時価 (米ドル) |
|---------------------------------------|-------------|----------------|------------------------|---------|-----------|-------------------------|---------------|
| (1,091)コール | | Walt Disney Co | The Exchange Traded | USD 155 | 15/1/2021 | (125,729) | (409,125) |
| (280)コール | | Xilinx Inc | Exchange Traded | USD 110 | 18/9/2020 | 8,332 | (27,440) |
| (238)プット | | Zoetis Inc | Exchange Traded | USD 140 | 15/1/2021 | 26,835 | (86,870) |
| (238)コール | | Zoetis Inc | Exchange Traded | USD 175 | 15/1/2021 | (26,714) | (102,340) |
| 合計(米ドル原資産エクスポージャー - 1,144,357,326米ドル) | | | | | | (64,673,044) | (172,078,487) |

差金決済取引明細表
2020年8月31日現在

| 数量 | 銘柄 | 契約相手 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) |
|-----------|---|-----------|-------------------------|
| | オーストラリア | | |
| (13,939) | Ramsay Health Care Ltd NPV | JP Morgan | (28,541) |
| (156,143) | Scentre Group | JP Morgan | (34,224) |
| (67,152) | Sydney Airport | JP Morgan | (22,714) |
| (29,130) | Transurban Group | JP Morgan | (370) |
| | | | <u>(85,849)</u> |
| | バミューダ | | |
| (22,000) | China Resources Gas Group Ltd | Citibank | 4,256 |
| (31,600) | China Gas Holdings Ltd | JP Morgan | 5,093 |
| | | | <u>9,349</u> |
| | ブラジル | | |
| (28,660) | Hapvida Participacoes e Investimentos SA | JP Morgan | (498) |
| (18,345) | Lojas Americanas SA (Pref) | JP Morgan | 6,294 |
| (12,651) | Magazine Luiza SA | JP Morgan | (20,577) |
| (43,608) | Suzano SA | JP Morgan | (13,904) |
| | | | <u>(28,685)</u> |
| | カナダ | | |
| (5,673) | Canadian National Railway Co NPV | JP Morgan | (10,007) |
| | | | <u>(10,007)</u> |
| | ケイマン諸島 | | |
| (54,000) | China Conch Venture Holdings Ltd | Citibank | 6,287 |
| (71,000) | China Evergrande Group | Citibank | 5,309 |
| (55,600) | China Literature Ltd | Citibank | 7,882 |
| (42,000) | China Resources Land Ltd | Citibank | (4,134) |
| (100,000) | Longfor Group Holdings Ltd | Citibank | (8,085) |
| (7,400) | Ping An Healthcare and Technology Co Ltd | Citibank | (5,254) |
| (180,500) | Semiconductor Manufacturing International Corp | Citibank | 20,996 |
| (57,000) | Wharf Real Estate Investment Co Ltd | Citibank | 11,391 |
| (37,000) | Shimao Property Holdings Ltd | Citigroup | (3,279) |
| (277,000) | Sino Biopharmaceutical Ltd | Citigroup | 15,270 |
| (263,000) | Xiaomi Corp | Citigroup | (171,729) |
| (200,000) | China State Construction International Holdings Ltd | JP Morgan | (34,069) |
| (118,000) | Geely Automobile Holdings Ltd | JP Morgan | 5,776 |
| (26,589) | iQIYI Inc ADR | JP Morgan | (1,313) |
| (12,300) | Shenzhen International Group Holdings Ltd | JP Morgan | (33,712) |
| | | | <u>(188,664)</u> |
| | 中国 | | |
| (256,000) | China Communications Services Corp Ltd | Citibank | (340) |
| (546,000) | China Eastern Airlines Corp Ltd | Citibank | (14,096) |
| (231,500) | COSCO SHIPPING Holdings Co Ltd | Citibank | (3,354) |
| (180,000) | E.Sun Financial Holding Co Ltd | Citibank | (445) |
| (528,000) | China Molybdenum Co Ltd 'H' | Citigroup | 2,717 |
| (5,000) | Hotai Motor Co Ltd | Citigroup | 6,382 |
| (96,500) | Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd | Citigroup | (10,749) |
| (582,000) | Aluminum Corp of China Ltd | JP Morgan | 16,348 |
| (22,000) | BYD Co Ltd | JP Morgan | (3,771) |
| (862,000) | China Southern Airlines Co Ltd | JP Morgan | (56,740) |
| (76,000) | Mega Financial Holding Co Ltd | JP Morgan | 6,716 |
| (22,000) | Tsingtao Brewery Co Ltd | JP Morgan | (11,276) |
| | | | <u>(68,608)</u> |
| | デンマーク | | |
| (3,237) | Orsted A/S | Citibank | 4,832 |
| | | | <u>4,832</u> |
| | フィンランド | | |
| (2,349) | Kone Oyj | Citibank | (4,540) |
| | | | <u>(4,540)</u> |

| 数量 | 銘柄 | 契約相手 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) |
|-----------|--|-----------|-------------------------|
| | フランス | | |
| (7,291) | Bouygues SA | Citibank | (2,959) |
| (452) | Hermes International | Citibank | (11,819) |
| (1,183) | L'Oreal SA | Citibank | (1,894) |
| | | | <u>(16,672)</u> |
| | ドイツ | | |
| (2,210) | Knorr-Bremse AG | JP Morgan | (18,294) |
| | | | <u>(18,294)</u> |
| | 香港 | | |
| (11,000) | Galaxy Entertainment Group | Citigroup | (215) |
| (424,000) | China Jinmao Holdings Group Ltd | JP Morgan | 15,308 |
| (28,400) | Link REIT | JP Morgan | 801 |
| | | | <u>15,894</u> |
| | アイルランド | | |
| (1,444) | Accenture Plc | JP Morgan | (6,609) |
| 1,629,004 | iShares S&P 500 Consumer Discretionary Sector UCITS ETF | JP Morgan | 1,016,091 |
| 2,322,656 | iShares S&P 500 Financials Sector UCITS ETF | JP Morgan | 156,779 |
| 2,488,763 | iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF | JP Morgan | 307,985 |
| (1,201) | Trane Technologies Plc | JP Morgan | (1,245) |
| | | | <u>1,473,001</u> |
| | イタリア | | |
| (11,294) | Atlantia SpA | Citibank | 6,646 |
| 5,427,487 | Leonardo SpA | Citibank | (1,068,531) |
| | | | <u>(1,061,885)</u> |
| | 日本 | | |
| (5,600) | ANA Holdings Inc | Citibank | (10,667) |
| (1,300) | Oriental Land Co Ltd/Japan | Citibank | (8,141) |
| (31,200) | Z Holdings Corp NPV | Citibank | (3,900) |
| (1,000) | Fast Retailing Co Ltd | JP Morgan | (20,330) |
| (2,200) | Kintetsu Group Holdings Co NPV | JP Morgan | (3,409) |
| (4,300) | Nippon Paint Holdings Co Ltd | JP Morgan | (58,859) |
| (4,500) | SoftBank Group Corp | JP Morgan | (10,256) |
| | | | <u>(115,562)</u> |
| | オランダ | | |
| (2,662) | Airbus SE | Citibank | 8,113 |
| | | | <u>8,113</u> |
| | ノルウェー | | |
| (26,590) | Equinor ASA | Citibank | 9,371 |
| | | | <u>9,371</u> |
| | ポーランド | | |
| (95,709) | Polskie Górnictwo Naftowe i Gazownictwo SA | Citigroup | 3,833 |
| | | | <u>3,833</u> |
| | 南アフリカ | | |
| (3,116) | Capitec Bank Holdings Ltd | JP Morgan | (2,278) |
| (20,290) | Shoprite Holdings Ltd | JP Morgan | 6,850 |
| (36,160) | Vodacom Group Ltd | JP Morgan | (2,800) |
| | | | <u>1,772</u> |
| | 韓国 | | |
| (4,575) | Celltrion Healthcare Co Ltd | Citibank | 15,770 |
| (4,069) | Hyundai Heavy Industries Co Ltd | Citigroup | 4,150 |
| (635) | Amorepacific Group | JP Morgan | 221 |
| (2,279) | Samsung C&T Corp | JP Morgan | 3,268 |
| | | | <u>23,409</u> |

| 数量 | 銘柄 | 契約相手 | 未実現利益/ (損失) (米ドル) |
|-------------------------------------|-------------------------------|-----------|-------------------------|
| | スペイン | | |
| (236,366) | CaixaBank SA | Citibank | 14,266 |
| (1,619) | Amadeus IT Group SA | Citibank | (4,906) |
| (1,479) | Aena SME SA | JP Morgan | (13,971) |
| (6,091) | Ferrovial SA | JP Morgan | 4,445 |
| | | | <u>(166)</u> |
| | スウェーデン | | |
| (2,697) | Investor AB | Citibank | 919 |
| (12,494) | Svenska Handelsbanken AB | Citibank | (1,318) |
| (14,078) | Swedbank AB | Citibank | (6,866) |
| | | | <u>(7,265)</u> |
| | スイス | | |
| (818) | Swisscom AG | JP Morgan | (5,603) |
| | | | <u>(5,603)</u> |
| | 英国 | | |
| (17,889) | National Grid Plc | Citibank | 7,102 |
| (9,501) | Prudential Plc | JP Morgan | (1,043) |
| (147,425) | Tesco Plc | JP Morgan | 7,738 |
| | | | <u>13,797</u> |
| | 米国 | | |
| (4,107) | Boeing Co/The | Citibank | 19,303 |
| (3,463) | Eversource Energy | Citibank | 3,463 |
| (1,497) | Honeywell International Inc | Citibank | (11,257) |
| (13,852) | Keurig Dr Pepper Inc | Citibank | (11,636) |
| (1,497) | Lululemon Athletica Inc | Citibank | 150 |
| (2,680) | Marriott International Inc/MD | Citibank | (16,375) |
| (4,142) | Progressive Corp/The | Citibank | (4,929) |
| (2,210) | Simon Property Group Inc | Citibank | (309) |
| (2,297) | AmerisourceBergen Corp | JP Morgan | 10,313 |
| (4,838) | Conagra Foods Inc | JP Morgan | (1,982) |
| (10,632) | Dominion Energy Inc | JP Morgan | 11,336 |
| (218,793) | Exxon Mobil Corp | JP Morgan | 926,710 |
| (15,487) | Fox Corp | JP Morgan | (51,513) |
| (14,826) | Fox Corp | JP Morgan | (49,464) |
| (7,222) | Hormel Foods Corp | JP Morgan | 9,653 |
| (9,727) | Marathon Petroleum Corp | JP Morgan | 13,053 |
| (2,036) | Roper Technologies Inc | JP Morgan | 20,002 |
| (8,579) | Ross Stores Inc | JP Morgan | (16,033) |
| (4,820) | Welltower Inc | JP Morgan | (8,554) |
| (7,256) | Xcel Energy Inc | JP Morgan | 9,979 |
| | | | <u>851,910</u> |
| 合計(米ドル原資産エクスポージャー - 122,405,947米ドル) | | | <u>803,481</u> |

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

(2021年8月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2)【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。

2021年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額（単位：円） |
|------------|-------|--------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 26 | 1,416,324,156,163 |
| 追加型株式投資信託 | 830 | 15,897,211,446,199 |
| 単位型公社債投資信託 | 28 | 61,097,291,401 |
| 単位型株式投資信託 | 217 | 1,337,529,201,064 |
| 合計 | 1,101 | 18,712,162,094,827 |

(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

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第36期事業年度(自2020年4月1日至2021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：千円)

| | 第35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 32,932,013 | 36,734,502 |
| 金銭の信託 | 28,548,165 | 25,670,526 |
| 有価証券 | 996 | - |
| 未収委託者報酬 | 11,487,393 | 16,804,456 |
| 未収運用受託報酬 | 4,674,225 | 5,814,654 |
| 未収投資助言報酬 | 331,543 | 317,567 |
| 未収収益 | 11,674 | 7,412 |
| 前払費用 | 480,129 | 724,591 |
| その他 | 2,815,351 | 2,419,487 |
| 流動資産計 | 81,281,494 | 88,493,198 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 1,006,793 | 1 915,815 |
| 器具備品 | 1 270,768 | 1 202,902 |
| 建設仮勘定 | 894 | 609 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | 3,299,065 | 2,878,179 |
| ソフトウェア仮勘定 | 221,784 | 1,109,723 |
| 電話加入権 | 3,931 | 3,931 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 261,361 | 261,360 |
| 関係会社株式 | 5,299,196 | 5,299,196 |
| 長期差入保証金 | 1,302,402 | 1,324,203 |
| 繰延税金資産 | 2,508,004 | 3,676,823 |
| その他 | 111,162 | 591,970 |
| 固定資産計 | 14,285,364 | 16,264,717 |
| 資産合計 | 95,566,859 | 104,757,915 |

(単位:千円)

| | 第35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|--------------|------------------------|------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 3,702,906 | 3,730,283 |
| 未払金 | 4,803,140 | 7,337,541 |
| 未払収益分配金 | 966 | 846 |
| 未払償還金 | 9,999 | 9,999 |
| 未払手数料 | 4,582,140 | 6,889,193 |
| その他未払金 | 210,034 | 437,502 |
| 未払費用 | 6,673,320 | 9,713,972 |
| 未払法人税等 | 4,090,268 | 4,199,922 |
| 未払消費税等 | 1,338,183 | 2,106,617 |
| 賞与引当金 | 1,373,328 | 1,789,597 |
| 役員賞与引当金 | 65,290 | 76,410 |
| 流動負債計 | 22,046,438 | 28,954,345 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 2,118,947 | 2,292,486 |
| 時効後支払損引当金 | 174,139 | 157,945 |
| 固定負債計 | 2,293,087 | 2,450,431 |
| 負債合計 | 24,339,526 | 31,404,777 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | 19,552,957 | 19,552,957 |
| 資本準備金 | 2,428,478 | 2,428,478 |
| その他資本剰余金 | 17,124,479 | 17,124,479 |
| 利益剰余金 | 49,674,383 | 51,800,187 |
| 利益準備金 | 123,293 | 123,293 |
| その他利益剰余金 | 49,551,090 | 51,676,893 |
| 別途積立金 | 31,680,000 | 31,680,000 |
| 繰越利益剰余金 | 17,871,090 | 19,996,893 |
| 株主資本計 | 71,227,341 | 73,353,144 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 7 | 6 |
| 評価・換算差額等計 | 7 | 6 |
| 純資産合計 | 71,227,333 | 73,353,137 |
| 負債・純資産合計 | 95,566,859 | 104,757,915 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | | 第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日) | |
|------------|---------------------------------------|-------------|---------------------------------------|-------------|
| | 営業収益 | | | |
| 委託者報酬 | 84,426,075 | | 89,905,293 | |
| 運用受託報酬 | 16,912,305 | | 17,640,234 | |
| 投資助言報酬 | 1,208,954 | | 1,103,477 | |
| その他営業収益 | 68,156 | | 781,735 | |
| 営業収益計 | | 102,615,492 | | 109,430,741 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 34,980,736 | | 37,003,102 | |
| 広告宣伝費 | 340,791 | | 424,598 | |
| 公告費 | 375 | | 400 | |
| 調査費 | 25,132,268 | | 30,794,092 | |
| 調査費 | 10,586,542 | | 11,302,420 | |
| 委託調査費 | 14,545,725 | | 19,491,671 | |
| 委託計算費 | 698,723 | | 543,135 | |
| 営業雑経費 | 990,002 | | 938,891 | |
| 通信費 | 44,209 | | 46,358 | |
| 印刷費 | 738,330 | | 680,272 | |
| 協会費 | 71,386 | | 71,361 | |
| 諸会費 | 22,790 | | 23,936 | |
| 支払販売手数料 | 113,286 | | 116,962 | |
| 営業費用計 | | 62,142,897 | | 69,704,220 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | 10,817,861 | | 10,586,117 | |
| 役員報酬 | 174,795 | | 163,394 | |
| 給料・手当 | 9,087,800 | | 9,030,562 | |
| 賞与 | 1,555,264 | | 1,392,160 | |
| 交際費 | 40,436 | | 8,168 | |
| 寄付金 | 8,906 | | 7,757 | |
| 旅費交通費 | 320,037 | | 50,081 | |
| 租税公課 | 651,265 | | 912,570 | |
| 不動産賃借料 | 1,479,503 | | 1,499,753 | |
| 退職給付費用 | 505,189 | | 524,845 | |
| 固定資産減価償却費 | 882,526 | | 1,078,185 | |
| 福利厚生費 | 44,352 | | 44,004 | |
| 修繕費 | 1,843 | | 777 | |
| 賞与引当金繰入額 | 1,373,328 | | 1,789,597 | |
| 役員賞与引当金繰入額 | 65,290 | | 76,410 | |
| 機器リース料 | 233 | | 208 | |
| 事務委託費 | 3,625,424 | | 3,793,883 | |
| 事務用消耗品費 | 104,627 | | 68,534 | |
| 器具備品費 | 1,620 | | 548 | |
| 諸経費 | 197,094 | | 152,830 | |
| 一般管理費計 | | 20,119,543 | | 20,594,276 |
| 営業利益 | | 20,353,050 | | 19,132,244 |

(単位:千円)

| | 第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) | | 第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日) | |
|--------------|---------------------------------------|------------|---------------------------------------|------------|
| | | | | |
| 営業外収益 | | | | |
| 受取利息 | 4,440 | | 27,079 | |
| 受取配当金 | 11,185 | | 2,356 | |
| 時効成立分配金・償還金 | 49,164 | | 362 | |
| 投資信託償還益 | 5,528 | | - | |
| 為替差益 | - | | 7,314 | |
| 金銭の信託運用益 | - | | 1,229,697 | |
| 受取負担金 | 297,886 | | - | |
| 雑収入 | 7,394 | | 13,505 | |
| 時効後支払損引当金戻入額 | 3,473 | | 13,011 | |
| 営業外収益計 | | 379,073 | | 1,293,326 |
| 営業外費用 | | | | |
| 為替差損 | 19,750 | | - | |
| 投資信託償還損 | 1 | | 3 | |
| 金銭の信託運用損 | 169,505 | | - | |
| システム解約料 | 31,680 | | - | |
| 早期割増退職金 | - | | 48,755 | |
| 雑損失 | 104 | | 5 | |
| 営業外費用計 | | 221,042 | | 48,764 |
| 経常利益 | | 20,511,082 | | 20,376,806 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | 1,169,758 | | - | |
| 特別利益計 | | 1,169,758 | | - |
| 特別損失 | | | | |
| 固定資産除却損 | 1 16,085 | | 1 1,511 | |
| 特別損失計 | | 16,085 | | 1,511 |
| 税引前当期純利益 | | 21,664,754 | | 20,375,294 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 7,045,579 | | 7,418,311 |
| 法人税等調整額 | | 385,835 | | 1,168,820 |
| 法人税等合計 | | 6,659,743 | | 6,249,491 |
| 当期純利益 | | 15,005,011 | | 14,125,803 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

| | 評価・換算差額等 | | 純資産 合計 |
|-----------------------------|----------------------|----------------|------------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 846,755 | 846,755 | 68,349,085 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 11,280,000 |
| 当期純利益 | | | 15,005,011 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額) | 846,763 | 846,763 | 846,763 |
| 当期変動額合計 | 846,763 | 846,763 | 2,878,247 |
| 当期末残高 | 7 | 7 | 71,227,333 |

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

| | 株主資本 | | | | | | | | |
|-----------------------------|-----------|-----------|--------------|-------------|-----------|------------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | | | | 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 | 2,000,000 | 2,428,478 | 17,124,479 | 19,552,957 | 123,293 | 31,680,000 | 17,871,090 | 49,674,383 | 71,227,341 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 12,000,000 | 12,000,000 | 12,000,000 |
| 当期純利益 | | | | | | | 14,125,803 | 14,125,803 | 14,125,803 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額) | | | | | | | | | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | - | - | 2,125,803 | 2,125,803 | 2,125,803 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 17,124,479 | 19,552,957 | 123,293 | 31,680,000 | 19,996,893 | 51,800,187 | 73,353,144 |

| | 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 | 7 | 7 | 71,227,333 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 12,000,000 |
| 当期純利益 | | | 14,125,803 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額) | 1 | 1 | 1 |
| 当期変動額合計 | 1 | 1 | 2,125,804 |
| 当期末残高 | 6 | 6 | 73,353,137 |

重要な会計方針

| | |
|--------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p> |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 3. 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p> |
| 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 |
| 5. 引当金の計上基準 | <p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> |
| 6. 消費税等の会計処理 | 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。 |

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「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 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

| | 第35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|------|------------------------|------------------------|
| 建物 | 320,020 | 407,133 |
| 器具備品 | 949,984 | 978,763 |

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

| | 第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日) | 第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日) |
|--------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物 | - | 944 |
| 器具備品 | 9,609 | 566 |
| ソフトウエア | 6,475 | - |

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

| 決議 | 株式の 種類 | 配当の 原資 | 配当金の総 額(千円) | 1株当たり配 当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|------------|-----------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 2020年6月17日 定時株主総会 | 普通 株式 | 利益 剰余金 | 12,000,000 | 300,000 | 2020年3月31日 | 2020年6月18日 |
| | A種種 類株式 | | | | | |

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の 種類 | 配当金の総 額(千円) | 1株当たり配 当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|------------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 2020年6月17日 定時株主総会 | 普通株式 | 12,000,000 | 300,000 | 2020年3月31日 | 2020年6月18日 |
| | A種種類 株式 | | | | |

(2) 基準日が当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
2021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(千円) | 1株当たり配 当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|------------|-----------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 2021年6月16日 定時株主総会 | 普通 株式 | 利益 剰余金 | 11,280,000 | 282,000 | 2021年3月31日 | 2021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。

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

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。

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰りを確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金 | 36,734,502 | 36,734,502 | - |
| (2) 金銭の信託 | 25,670,526 | 25,670,526 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 16,804,456 | 16,804,456 | - |
| (4) 未収運用受託報酬 | 5,814,654 | 5,814,654 | - |
| (5) 投資有価証券 其他有価証券 | 1,990 | 1,990 | - |
| 資産計 | 85,026,130 | 85,026,130 | - |
| (1) 未払手数料 | 6,889,193 | 6,889,193 | - |
| 負債計 | 6,889,193 | 6,889,193 | - |

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

| 区分 | 第35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式 | 259,369 | 259,369 |
| 関係会社株式 | 5,299,196 | 5,299,196 |

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

| | 1年以内 (千円) | 1年超5年以内 (千円) | 5年超10年以内 (千円) | 10年超 (千円) |
|----------------------------|--------------|-----------------|------------------|--------------|
| (1) 現金・預金 | 36,734,502 | - | - | - |
| (2) 金銭の信託 | 25,670,526 | - | - | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 16,804,456 | - | - | - |
| (4) 未収運用受託報酬 | 5,814,654 | - | - | - |
| (5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託) | - | 1,990 | - | - |

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

| 区分 | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|--------------------------|------------------------|-------|----|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | - | - | - |
| 小計 | | | |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | 2,988 | 3,000 | 11 |
| 小計 | 2,988 | 3,000 | 11 |
| 合計 | 2,988 | 3,000 | 11 |

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

| 区分 | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|--------------------------|------------------------|-------|----|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | - | - | - |
| 小計 | | | |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 投資信託 | 1,990 | 2,000 | 9 |
| 小計 | 1,990 | 2,000 | 9 |
| 合計 | 1,990 | 2,000 | 9 |

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

| 区分 | 売却額 (千円) | 売却益の合計額 (千円) | 売却損の合計額 (千円) |
|------|-------------|-----------------|-----------------|
| 投資信託 | 996 | - | 3 |

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

| | 第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日) | 第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 退職給付債務の期首残高 | 2,289,044 | 2,422,901 |
| 勤務費用 | 302,546 | 303,999 |
| 利息費用 | 2,087 | 2,180 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 18,448 | 4,319 |
| 退職給付の支払額 | 187,749 | 245,143 |
| 過去勤務費用の発生額 | - | 1,567 |
| その他 | 1,476 | 1,567 |
| 退職給付債務の期末残高 | 2,422,901 | 2,479,619 |

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

(千円)

| | 第35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|---------------------|------------------------|------------------------|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 2,422,901 | 2,479,619 |
| 未積立退職給付債務 | 2,422,901 | 2,479,619 |
| 未認識数理計算上の差異 | 130,155 | 84,264 |
| 未認識過去勤務費用 | 173,798 | 102,868 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,118,947 | 2,292,486 |
| 退職給付引当金 | 2,118,947 | 2,292,486 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,118,947 | 2,292,486 |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

| | 第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日) | 第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 勤務費用 | 302,546 | 303,999 |
| 利息費用 | 2,087 | 2,180 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 38,861 | 41,571 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 69,519 | 69,362 |
| その他 | 11,303 | 7,720 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 401,711 | 409,394 |

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千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35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|-------|------------------------|------------------------|
| 割引率 | 0.09% | 0.09% |
| 予想昇給率 | 1.00% ~ 4.42% | 1.00% ~ 3.76% |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| | 第35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| | (千円) | (千円) |
| 繰延税金資産 | | |
| 未払事業税 | 221,053 | 260,377 |
| 未払事業所税 | 10,778 | 10,711 |
| 賞与引当金 | 420,513 | 547,974 |
| 未払法定福利費 | 78,439 | 92,748 |
| 未払給与 | 10,410 | 8,535 |
| 受取負担金 | 47,781 | - |
| 運用受託報酬 | 331,395 | 1,410,516 |
| 資産除去債務 | 14,116 | 18,079 |
| 減価償却超過額(一括償却資産) | 50,942 | 25,808 |
| 減価償却超過額 | 82,684 | 51,986 |
| 繰延資産償却超過額(税法上) | 323,132 | 301,965 |
| 退職給付引当金 | 648,821 | 701,959 |
| 時効後支払損引当金 | 53,321 | 48,362 |
| ゴルフ会員権評価損 | 7,360 | 7,360 |
| 関係会社株式評価損 | 166,740 | 166,740 |
| 投資有価証券評価損 | 28,976 | 28,976 |
| その他 | 11,532 | 5,283 |
| その他有価証券評価差額金 | 3 | 2 |
| 繰延税金資産小計 | 2,508,004 | 3,676,823 |
| 評価性引当額 | - | - |
| 繰延税金資産合計 | 2,508,004 | 3,676,823 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | - | - |
| 繰延税金負債合計 | - | - |
| 繰延税金資産の純額 | 2,508,004 | 3,676,823 |

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

| 結合当事企業 | DIAM | MHAM | TB | 新光投信 |
|--------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 事業の内容 | 投資運用業務、投資助言・代理業務 | 投資運用業務、投資助言・代理業務 | 信託業務、銀行業務、投資運用業務 | 投資運用業務、投資助言・代理業務 |

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

| 会社名 | DIAM （存続会社） | MHAM （消滅会社） |
|---------|----------------|----------------|
| 合併比率（*） | 1 | 0.0154 |

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」(企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分)に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

| | | |
|-------|-----------|---------------|
| 取得の対価 | MHAMの普通株式 | 144,212,500千円 |
| 取得原価 | | 144,212,500千円 |

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

| | | |
|-------------------|---|--------------|
| a. 発生したのれん | 金額 | 76,224,837千円 |
| b. 発生原因 | 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。 | |
| c. のれんの償却方法及び償却期間 | 20年間の均等償却 | |

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

| | | |
|---------|---------------|--------------|
| a. 資産の額 | 資産合計 | 40,451,657千円 |
| | うち現金・預金 | 11,605,537千円 |
| | うち金銭の信託 | 11,792,364千円 |
| b. 負債の額 | 負債合計 | 9,256,209千円 |
| | うち未払手数料及び未払費用 | 4,539,592千円 |

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

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

| | |
|------------------------|--------------|
| a. 無形固定資産に配分された金額 | 53,030,000千円 |
| b. 主要な種類別の内訳 | |
| 顧客関連資産 | 53,030,000千円 |
| c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間 | |
| 顧客関連資産 | 16.9年 |

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

| | 第35期 (2020年3月31日現在) | 第36期 (2021年3月31日現在) |
|---|------------------------|------------------------|
| 流動資産 | - 千円 | - 千円 |
| 固定資産 | 94,605,736千円 | 84,609,003千円 |
| 資産合計 | 94,605,736千円 | 84,609,003千円 |
| 流動負債 | - 千円 | - 千円 |
| 固定負債 | 8,278,713千円 | 5,570,814千円 |
| 負債合計 | 8,278,713千円 | 5,570,814千円 |
| 純資産 | 86,327,023千円 | 79,038,188千円 |
| (注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。 | | |
| のれん | 62,885,491千円 | 59,074,249千円 |
| 顧客関連資産 | 34,810,031千円 | 29,793,358千円 |

(2) 損益計算書項目

| | 第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日) | 第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日) |
|--------------------------------------|--|--|
| 営業収益 | - 千円 | - 千円 |
| 営業利益 | 8,954,439千円 | 8,823,626千円 |
| 経常利益 | 8,954,439千円 | 8,823,626千円 |
| 税引前当期純利益 | 9,111,312千円 | 8,823,626千円 |
| 当期純利益 | 7,536,465千円 | 7,288,834千円 |
| 1株当たり当期純利益 | 188,411円64銭 | 182,220円85銭 |
| (注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。 | | |
| のれんの償却額 | 3,811,241千円 | 3,811,241千円 |
| 顧客関連資産の償却額 | 5,149,555千円 | 5,016,672千円 |

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容又 は職業 | 議決権 等の所 有(被 所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|------------|---------------------|----------------------|--------------|-----------|--------------|
| | | | | | | 役員の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 親会社 の子会社 | 株式会社 みずほ銀行 | 東京都 千代田 区 | 14,040 億円 | 銀行業 | - | - | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託の 販売代行手 数料 | 5,793,912 | 未払 手数料 | 1,112,061 |
| | みずほ証 券株式会 社 | 東京都 千代田 区 | 1,251 億円 | 証券業 | - | - | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託の 販売代行手 数料 | 10,294,840 | 未払 手数料 | 1,231,431 |

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 住所 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容又 は職業 | 議決権 等の所 有(被 所有) 割合 | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|-------------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------------------------|------------|---------------------|----------------------|--------------|-----------|--------------|
| | | | | | | 役員の 兼任等 | 事業上 の関係 | | | | |
| 親会社 の子会社 | 株式会社 みずほ銀行 | 東京都 千代田 区 | 14,040 億円 | 銀行業 | - | - | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託の 販売代行手 数料 | 6,435,839 | 未払 手数料 | 1,457,765 |
| | みずほ証 券株式会 社 | 東京都 千代田 区 | 1,251 億円 | 証券業 | - | - | 当社設定 投資信託 の販売 | 投資信託の 販売代行手 数料 | 12,767,199 | 未払 手数料 | 2,524,882 |

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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日) | 第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 1株当たり純資産額 | 1,780,683円32銭 | 1,833,828円44銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 375,125円27銭 | 353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日) | 第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日) |
|----------------------------|--|--|
| 当期純利益金額 | 15,005,011千円 | 14,125,803千円 |
| 普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額 | 15,005,011千円 | 14,125,803千円 |
| 普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数 | 40,000株 | 40,000株 |
| (うち普通株式) | (24,490株) | (24,490株) |
| (うちA種種類株式) | (15,510株) | (15,510株) |

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

独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、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2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年9月30日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

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」に掲げられているグローバルドライブ（年1回決算型）限定為替ヘッジの2021年2月19日から2021年8月18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、グローバルドライブ（年1回決算型）限定為替ヘッジの2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは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

2021年9月30日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

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」に掲げられているグローバルドライブ（年1回決算型）為替ヘッジなしの2021年2月19日から2021年8月18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、グローバルドライブ（年1回決算型）為替ヘッジなしの2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。