

## 【表紙】

|                                          |                         |
|------------------------------------------|-------------------------|
| 【提出書類】                                   | 有価証券届出書                 |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿                 |
| 【提出日】                                    | 2021年12月8日提出            |
| 【発行者名】                                   | 朝日ライフ アセットマネジメント株式会社    |
| 【代表者の役職氏名】                               | 代表取締役社長 山口 道男           |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都杉並区和泉一丁目 2 2 番 1 9 号 |
| 【事務連絡者氏名】                                | 岡部 武男                   |
| 【電話番号】                                   | 03-3323-6201            |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | ハリス世界株ファンド（毎月決算型）       |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | 3,000億円を上限とします。         |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。             |

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

ハリス世界株ファンド(毎月決算型)  
(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託受益権(以下「受益権」といいます。)です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)

委託会社である朝日ライフ アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

3,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額とは、純資産総額(信託財産の資産総額から負債総額を控除した額)を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。当ファンドにおいては、1万口当たりの価額として表示されます。基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

ホームページ <http://www.alamco.co.jp/>

フリーダイヤル 0120-283-104（営業日の9:00～17:00）

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%(税抜3.0%)を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」において、収益分配金を再投資する場合は、申込手数料はかかりません。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### （６）【申込単位】

申込単位は、販売会社が個別に定める単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」において、収益分配

金を再投資する場合は、1口単位となります。  
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（ 7 ）【申込期間】

2021年12月9日から2022年6月8日までとします。

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（ 8 ）【申込取扱場所】

取得申込みを取り扱う販売会社については委託会社の照会先までお問い合わせください。

|                      |                                                                 |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 朝日ライフ アセットマネジメント株式会社 |                                                                 |
| ホームページ               | <a href="http://www.alamco.co.jp/">http://www.alamco.co.jp/</a> |
| フリーダイヤル              | 0120-283-104（営業日の9:00～17:00）                                    |

（ 9 ）【払込期日】

取得申込者は、取得申込金額を販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

振替受益権にかかる各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ）【払込取扱場所】

取得申込者は、取得申込金額をお申込みの販売会社に支払うものとします。取得申込みを取り扱う販売会社については委託会社の照会先までお問い合わせください。

|                      |                                                                 |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 朝日ライフ アセットマネジメント株式会社 |                                                                 |
| ホームページ               | <a href="http://www.alamco.co.jp/">http://www.alamco.co.jp/</a> |
| フリーダイヤル              | 0120-283-104（営業日の9:00～17:00）                                    |

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

当ファンドには、収益分配金の受取方法の別により、収益分配金を受け取る「分配金受取コース」と、税金を差し引いた後の収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります（販売会社によっては、取り扱うコースがどちらか一方になる場合があります。また、コース名は販売会社により異なる場合があります。）。

取得申込金額には、利息はつきません。

日本以外の地域における発行は行っていません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、投資信託振替制度の受益権であり、社振法の規定の適用を受け、「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われます。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

商品分類・属性区分

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は次のとおりです。

## ・商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉）                     |
|---------|--------|-----------------------------------|
| 単位型投信   | 国内     | 株式<br>債券<br>不動産投信<br>その他資産<br>( ) |
|         | 海外     |                                   |
| 追加型投信   | 内外     | 資産複合                              |

## ・属性区分表

| 投資対象資産         | 決算頻度 | 投資対象地域           | 投資形態         | 為替ヘッジ     |
|----------------|------|------------------|--------------|-----------|
| 株式             | 年1回  | グローバル<br>(日本を除く) |              |           |
| 一般             | 年2回  |                  |              |           |
| 大型株            |      |                  |              |           |
| 中小型株           |      | 日本               | ファミリーファンド    |           |
| 債券             | 年4回  | 北米               |              | あり<br>( ) |
| 一般             | 年6回  | 欧州               |              |           |
| 公債             | (隔月) |                  | ファンド・オブ・ファンズ | なし        |
| 社債             |      |                  |              |           |
| その他債券          | 年12回 | アジア              |              |           |
| クレジット属性<br>( ) | (毎月) |                  |              |           |
| 不動産投信          |      | オセアニア            |              |           |
| その他資産          | 日々   | 中南米              |              |           |
| (投資信託証券(株式))   |      | アフリカ             |              |           |
| 資産複合           | その他  | 中近東              |              |           |
| 資産配分固定型        | ( )  | (中東)             |              |           |
| 資産配分変動型        |      | エマージング           |              |           |

## &lt;各分類および区分の定義&gt;

## 商品分類

|         |       |                                                               |
|---------|-------|---------------------------------------------------------------|
| 単位型・追加型 | 追加型投信 | 一度設定されたファンドであっても、その後追加設定が行われ、従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。       |
| 投資対象地域  | 海外    | 目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |

|        |    |                                                            |
|--------|----|------------------------------------------------------------|
| 投資対象資産 | 株式 | 目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。 |
|--------|----|------------------------------------------------------------|

## 属性区分

|        |                       |                                                                                               |
|--------|-----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投資対象資産 | その他資産<br>(投資信託証券(株式)) | 目論見書または信託約款において、主として株式に投資する投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。                                         |
| 決算頻度   | 年12回<br>(毎月)          | 目論見書または信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。                                                   |
| 投資対象地域 | グローバル<br>(日本を除く)      | 目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産(日本を除きます。)を源泉とする旨の記載があるものをいいます。                              |
| 投資形態   | ファミリー<br>ファンド         | 目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。<br>マザーファンドということがあります。 |
| 為替ヘッジ  | なし                    | 目論見書または信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものをいいます。                                                    |

(注1) 上記は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。当ファンドが該当する商品分類・属性区分を反転表示しています。

(注2) 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

(注3) その他の商品分類・属性区分の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ

(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

## 信託金の限度額

3,000億円とします。

なお、委託会社は受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## ファンドの特色

1) ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。

当ファンドの特色は、当該マザーファンドの特色と同様ですので、「＜参考＞マザーファンドの特色」をご覧ください。

2) 毎月決算を行います。

毎月9日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益分配方針に基づいて収益分配を行います。

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



上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

## ＜参考＞マザーファンドの特色

## ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド

## ●世界の株式に投資

日本を除く世界各国の株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。

エマージング諸国の株式も投資対象としますが、投資割合はポートフォリオの30%以内とします。

●ハリス・アソシエイツ社に運用を委託します。

バリュースタイル株投資で評価の高い米ハリス・アソシエイツ社に、マザーファンドの外貨建資産の運用指図に関する権限を委託し、同社の卓越した調査能力に基づき、銘柄選択を行います。

▼ハリス・アソシエイツ社(ハリス・アソシエイツ・エル・ピー)について

- ・ハリス・アソシエイツ社は、1976年にシカゴを本拠地として設立されました。
- ・バリュースタイルの運用に確固たる信念を持ち、すべての株式ファンドを一貫したバリュースタイルの哲学に基づき運用しています。
- ・運用資産1,226億米ドル(2021年6月末)

●厳選投資

企業訪問を含む企業調査を基本としたボトムアップ・アプローチにより、フリーキャッシュフロー、利益成長の潜在能力、業界における競争力、経営者の経営方針等から独自に評価した企業価値に対し割安な銘柄を発掘し、厳選投資します。

その時々で最も割安で魅力的と判断する中大型株20～50銘柄程度に厳選投資します。

中大型株とは、その時々で時価総額の大きな銘柄をいいます。

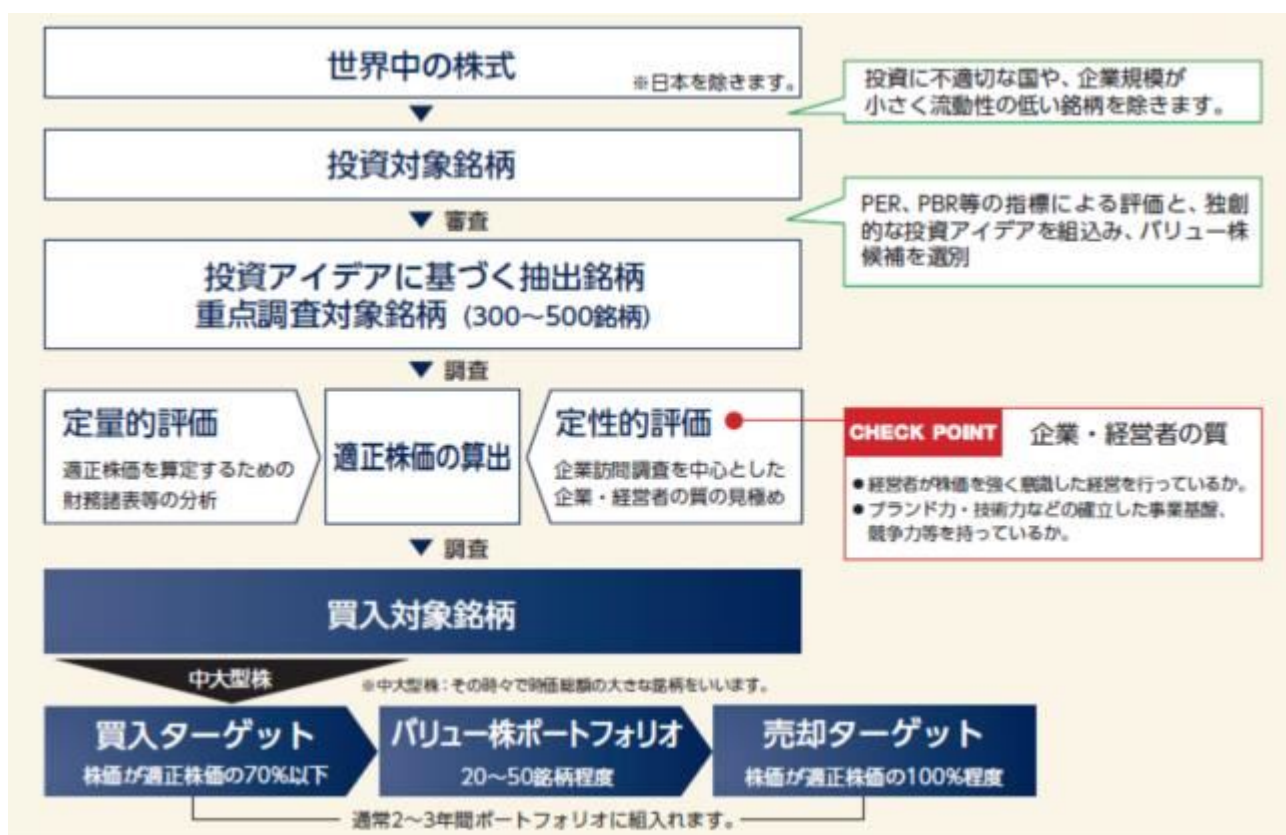
●銘柄本位

国や業種などにはこだわらず、個別の銘柄選択の積み上げにより銘柄本位でポートフォリオを構築します。

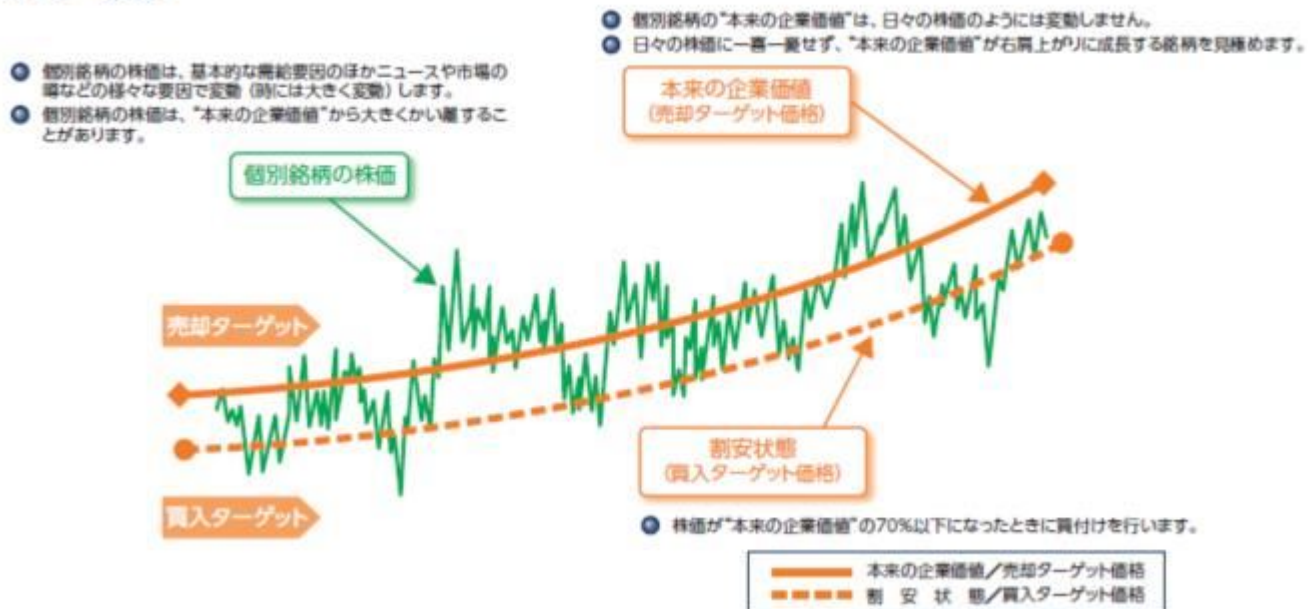
●為替

対円での為替ヘッジは、原則として行いません。

なお、対米ドルでは、円以外の通貨にかかる外国為替予約取引を行うことがあります。



## &lt;イメージ図&gt;



資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

2010年4月22日 信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】

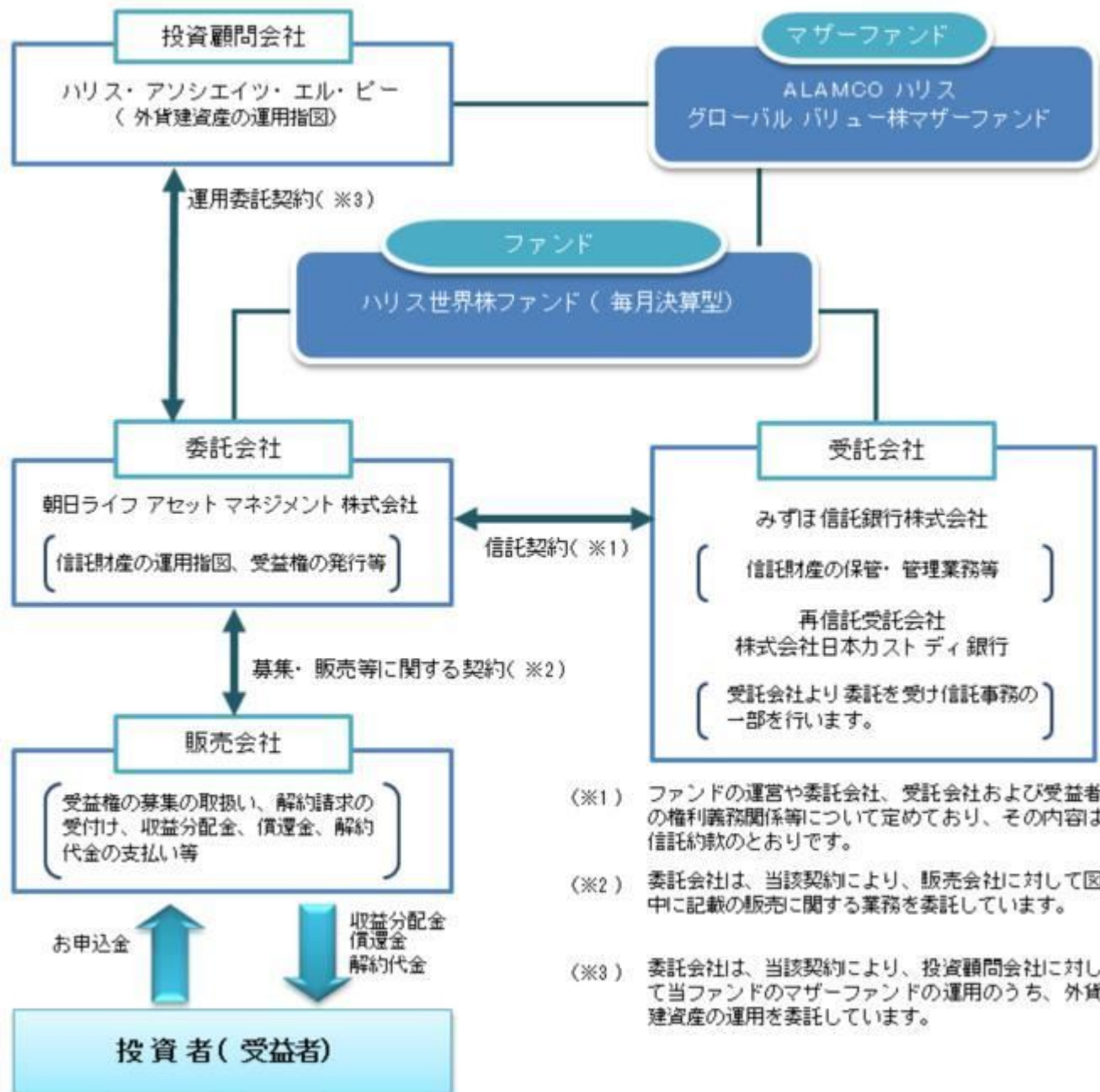
当ファンドの運用はファミリーファンド方式で行います。

ファミリーファンド方式とは、投資者から集めた資金をベビーファンドとしてまとめ、その資金を主としてマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。

マザーファンドの投資成果はベビーファンドに反映されます。



ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況

- 1) 資本金の額(2021年10月末現在)  
30億円
- 2) 会社の沿革  
1985年7月 朝日生命投資顧問株式会社設立  
1999年4月 朝日ライフ アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 3) 大株主の状況(2021年10月末現在)

| 名称         | 住所              | 所有株式数   | 比率     |
|------------|-----------------|---------|--------|
| 朝日生命保険相互会社 | 東京都新宿区四谷一丁目6番1号 | 32,000株 | 100.0% |

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

ハリス・アソシエイツ社に外貨建資産の運用指図権限を委託しているマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。

外貨建資産については、原則として、対円での為替ヘッジは行いません。なお、対米ドルでは、円以外の通貨にかかる外国為替予約取引を行うことがあります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合や、ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

## （２）【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に掲げるものをいいます。以下同じ。）

- a．有価証券
- b．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りします。）
- c．約束手形
- d．金銭債権

２）次に掲げる特定資産以外の資産

- a．為替手形

委託会社は、信託金を、主としてALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １）株券または新株引受権証書
- ２）国債証券
- ３）地方債証券
- ４）特別の法律により法人の発行する債券
- ５）社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６）特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- ７）特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- ８）協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- ９）特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10）コマーシャル・ペーパー
- 11）新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12）外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記１）から11）までの証券または証書の性質を有するもの
- 13）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14）投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りします。）

17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22) 外国の者に対する権利で前記21)の有価証券の性質を有するもの

なお、1)の証券または証書、12)および17)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに12)および17)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13)および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1) 預金

2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3) コール・ローン

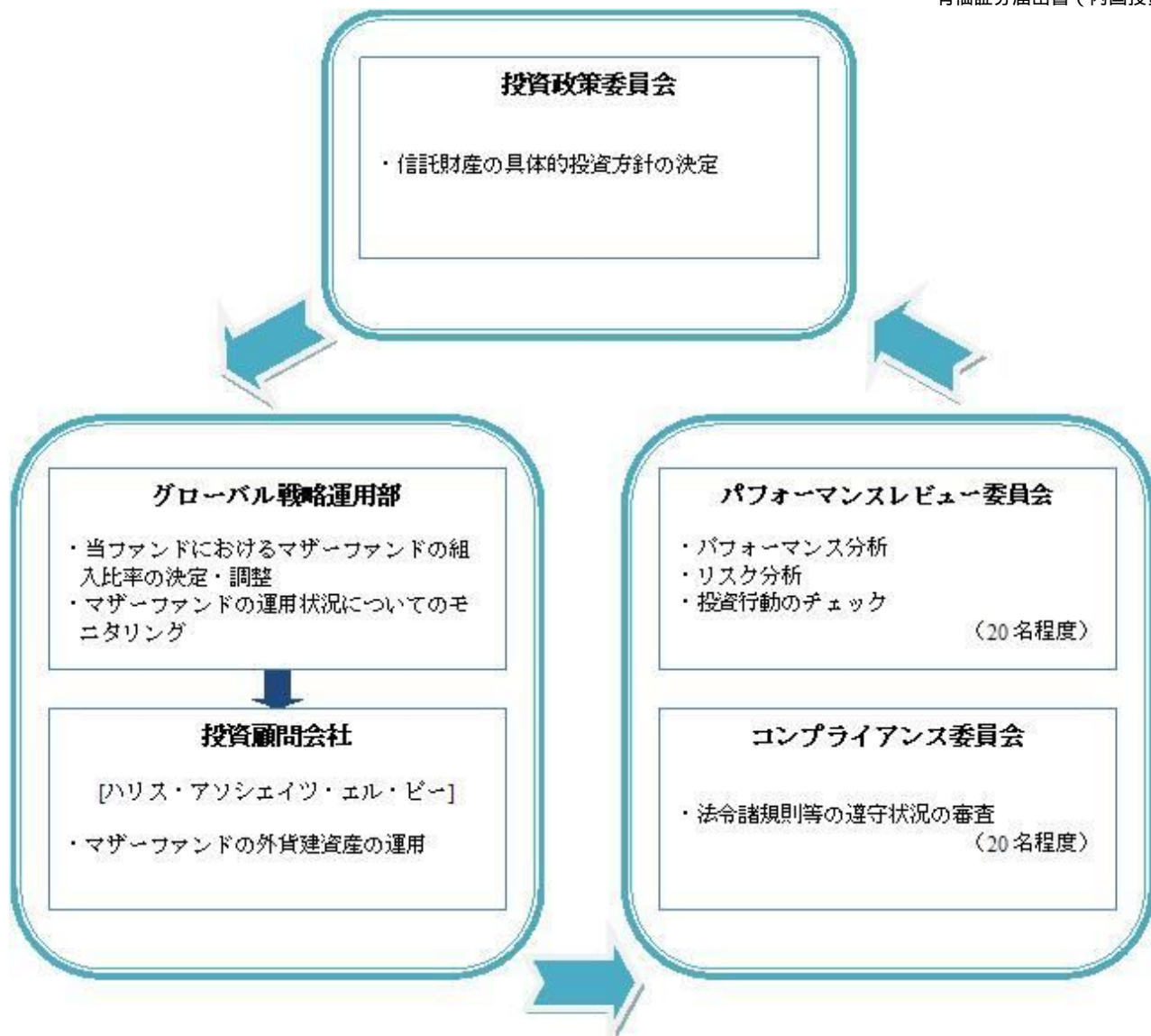
4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6) 外国の者に対する権利で前記5)の権利の性質を有するもの

前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前記 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (3) 【運用体制】



ファンドの運用に際しては、社内規程等において以下に述べる意思決定プロセスにかかる組織体および権限、責任等を定め、これに基づき業務を執行します。

また、業務執行の適切性については、適宜、内部監査部門による評価等によりその実効性を確保しています。

投資政策委員会においてファンドの具体的な投資方針を決定します。

グローバル戦略運用部および投資顧問会社において、ファンドの具体的な投資方針に基づく運用を行います。

1) グローバル戦略運用部は、当ファンドにおけるマザーファンドの組入比率の決定・調整を行います。

2) 投資顧問会社はマザーファンドの外貨建資産の運用を行います。

3) グローバル戦略運用部は、常時マザーファンドの運用状況についてのモニタリングを行います。

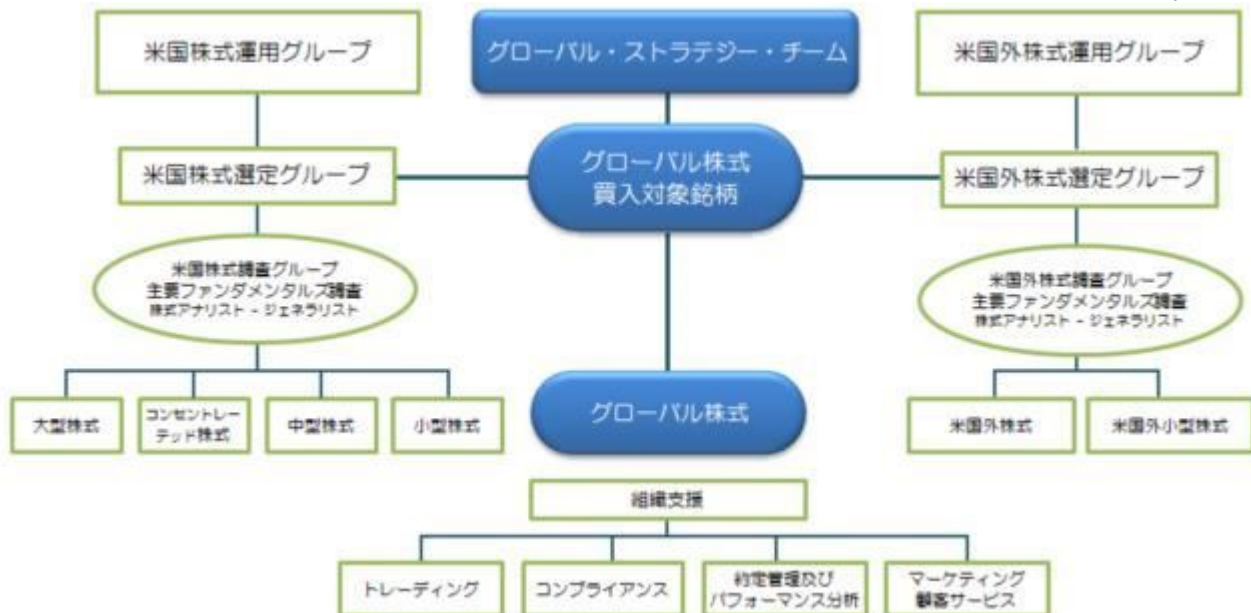
パフォーマンスレビュー委員会(20名程度)でパフォーマンス分析およびリスク分析、コンプライアンス委員会(20名程度)で法令遵守状況の審査を行い、これらを運用の意思決定プロセスにフィードバックします。なお、パフォーマンスレビュー委員会およびコンプライアンス委員会は常勤役員等により構成され、経営の立場から適切に管理・監督を行います。

受託会社等のファンドの関係法人(販売会社を除く)の管理については、日々の業務を通じ、業務執行能力、管理体制および知識・経験等をモニタリングしています。また、受託会社より内部統制に関する報告書を定期的に受領しています。

(注) 委員会および部の名称等は変更される場合があります。

#### <参考> 投資顧問会社の運用体制

マザーファンドの外貨建資産の運用を行う投資顧問会社(ハリス・アソシエイツ社)の運用体制は以下のとおりです。



グローバル・ストラテジー・チームが、マザーファンドのファンドマネジャーを担当します。

トレーディング、コンプライアンスおよび事務等については、各運用グループに共通の組織が担当します。

（注）グループ等の名称は変更される場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- １）分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
- ２）収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。
- ３）収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

分配時期

決算日は、毎月9日（休業日の場合は翌営業日）です。

収益分配金の支払いについては、以下のとおりです。

##### １）分配金受取コース

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で、取得申込金額支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

##### ２）自動けいぞく投資コース

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、税金を差し引いた後、無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は振替口座簿に記載または記録されます。

（注）将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 【収益分配金に関する留意事項】

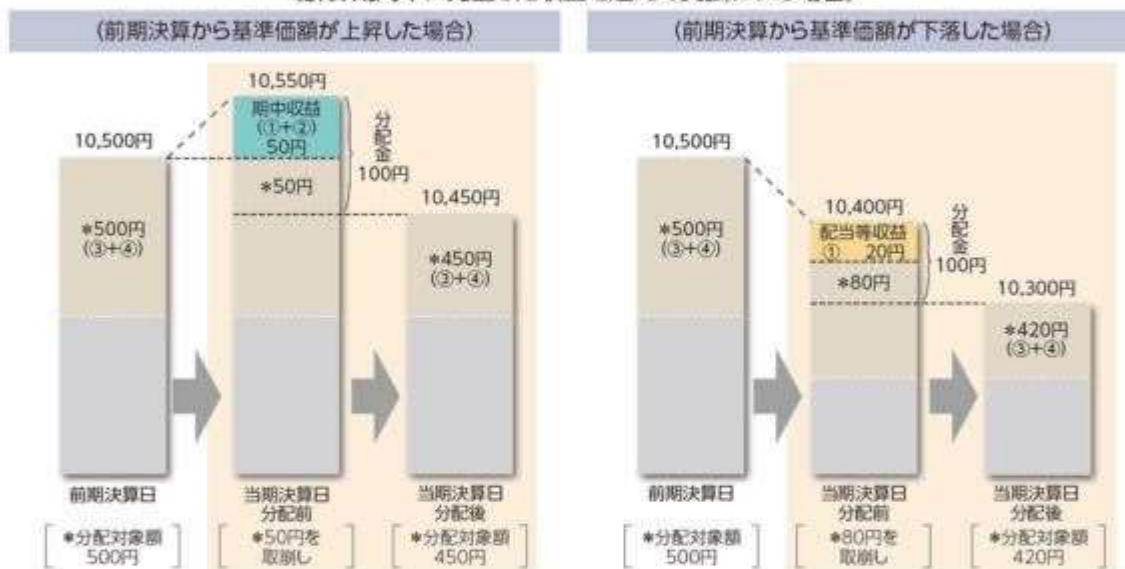
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

### ファンドで分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 《計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合》



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージ図であり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

### (分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

### (分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。

(特別分配金) 分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

## (5) 【投資制限】

### 信託約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。＜信託約款「運用の基本方針」2.(3)＞
- 2) 委託会社は、取得時において、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第15条第4項＞

上記において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。＜同条第6項＞（以下3）、5）、6）、7）において同じ。）

3）委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第15条第5項＞

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

上記にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。＜信託約款第18条＞

5）委託会社は、取得時において、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第19条第1項＞

6）委託会社は、取得時において、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第19条第2項＞

7）委託会社は、取得時において、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって、当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものをいいます（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第20条第1項＞

8）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けことの指図を行うことができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。＜信託約款第21条第1項＞

信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。信託財産の一部解約等の事由により、売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。＜同条第2項、第4項＞

上記において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。＜同条第3項＞

委託会社は、信託財産で保有する有価証券を信用取引の委託保証金の代用として差入れることの指図をすることができるものとします。＜同条第5項＞

9）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所（以下「取引所」ということがあります。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。＜信託約款第22条第1項＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引、ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。＜同条第2項＞

>

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引、ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。＜同条第3項＞

- 10) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。＜信託約款第23条第1項＞

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

＜同条第2項＞

スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。＜同条第3項＞

委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。＜同条第4項＞

- 11) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。＜信託約款第24条第1項＞

金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。＜同条第2項＞

金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。＜同条第3項＞

委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。＜同条第4項＞

- 12) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債につき、次の範囲内で貸付けの指図を行うことができます。＜信託約款第25条第1項＞

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

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

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

委託会社は、有価証券の貸付けを行うにあたり必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。＜同条第3項＞

- 13) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けの指図を行うことができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。＜信託約款第26条第1項＞

上記の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。＜同条第2項＞

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図を行うものとします。＜同条第3項＞

- 14) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図を行うことができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。＜信託約款第27条第1項、第4項＞

上記の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。＜同条第2項＞

信託財産の一部解約等の事由により、上記の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借入れた公社債の一部

を返還するための指図を行うものとします。＜同条第3項＞

- 15) 外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- ＜信託約款第28条＞
- 16) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。＜信託約款第29条第1項＞
- 上記の予約取引の範囲は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の合計額のうち信託財産に属するとみなした額との総合計額と、信託財産にかかる為替の売予約の合計額とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の合計額のうち信託財産に属するとみなした額との総合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。＜同条第2項、第4項＞
- 上記において、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の合計額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の合計額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の合計額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の合計額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。＜同条第3項＞
- 17) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。＜信託約款第35条第1項＞
- 上記の資金借入額は、次に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。＜同条第2項＞
- 1 一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
  - 2 再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
  - 3 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間、もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ＜同条第3項＞
- 再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。＜同条第4項＞
- 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。＜同条第5項＞
- 18) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。＜信託約款第24条の2＞
- 19) 前記1)から18)までの規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい当該比率以内になるよう調整を行うこととします。＜信託約款「運用の基本方針」2.(3)＞

法令に基づく投資制限

同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律)

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

#### <参考> マザーファンドの概要

##### ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド

以下「(3)投資制限」までにおいて、「ファンド」、「信託財産」および「信託期間」とは、マザーファンドのそれらをいいます。

#### (1) 投資方針

##### 投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

##### 投資態度

- 1) 主として、日本を除く世界各国株式のうち、時価総額の大きな銘柄にグローバルな視点で投資し、値上がり益の獲得および配当等収益の確保を目指して運用を行います。
- 2) 外貨建資産の運用にあたっては、ハリス・アソシエイツ・エル・ピーに運用の指図(米ドルを対価とする円以外の通貨にかかる外国為替予約取引の指図を含みます。)に関する権限を委託します。
- 3) ポートフォリオの構築にあたっては、企業訪問を含む企業調査を基本としたボトムアップ・アプローチにより、フリーキャッシュフロー、利益成長の潜在能力、業界における競争力、経営者の経営方針等から独自に評価した企業価値に対し割安な銘柄を発掘し、厳選投資します。
- 4) 発行体の属する国別の投資割合は、次のとおりとします。

|               |         |
|---------------|---------|
| アメリカおよびカナダの合計 | 25%～75% |
|---------------|---------|

|                |        |
|----------------|--------|
| 上記以外の先進国(*)の各国 | 0%～30% |
|----------------|--------|

|                 |        |
|-----------------|--------|
| エマージング諸国(**)の各国 | 0%～10% |
|-----------------|--------|

(\*) オーストラリア、オーストリア、ベルギー、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、ギリシャ、香港、アイルランド、イタリア、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、ポルトガル、シンガポール、スペイン、スイス、スウェーデン、イギリスとします。

(\*\*) アメリカ、カナダ、先進国以外の諸国とします。

- 5) エマージング諸国の株式への投資割合は、合計で信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 6) 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により、弾力的に変更を行うことがあります。
- 7) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。なお、対米ドルでは、円以外の通貨にかかる外国為替予約取引を行うことがあります。
- 8) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合や、ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

#### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

##### 1) 次に掲げる特定資産

- a. 有価証券
- b. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限り、ます。)
- c. 金銭債権
- d. 約束手形

##### 2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- a. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1)から11)までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるもので、主として有価証券に投資を行うものをいいます。)
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りま。
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 22) 外国の者に対する権利で前記21)の有価証券の性質を有するもの

なお、1)の証券または証書、12)および17)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに12)および17)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13)および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前記 の金融商品により運用することの指図ができます。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。＜信託約款「運用の基本方針」2.(3)＞

委託会社は、取得時において、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第13条第4項＞

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第13条第5項＞

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場

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

上記にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。＜信託約款第17条＞

委託会社は、取得時において、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第18条第1項＞

委託会社は、取得時において、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第18条第2項＞

委託会社は、取得時において、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図を行いません。＜信託約款第19条＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けことの指図を行うことができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。＜信託約款第20条第1項＞

信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。＜同条第2項＞

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図を行うものとします。＜同条第3項＞

委託会社は、信託財産で保有する有価証券を信用取引の委託保証金の代用として差入れることの指図をすることができるものとします。＜同条第4項＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため（投資対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のために限ります。）、ならびに価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことの指図をすることができます。＜信託約款第21条第1項＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため（投資対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のために限ります。）、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引、ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。＜同条第2項＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため（投資対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のために限ります。）、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。＜同条第3項＞

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため（投資対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のために限ります。）、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。＜信託約款第22条第1項＞

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。＜同条第2項＞

スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。＜同条第3項＞

委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。＜同条第4項＞

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため（投資対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のために限ります。）、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。＜信託約款第23条第1項＞

金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。＜同条第2項＞

金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし

す。＜同条第3項＞

委託会社は、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。＜同条第4項＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債につき、次の各号の範囲内で貸付の指図を行うことができます。＜信託約款第24条第1項＞

- 1 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

上記に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。＜同条第2項＞

委託会社は、有価証券の貸付けを行うにあたり必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。＜同条第3項＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けの指図を行うことができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。＜信託約款第25条第1項＞

上記の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。＜同条第2項＞

信託財産の一部解約等の事由により、上記の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図を行うものとします。＜同条第3項＞

委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図を行うことができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。＜信託約款第26条第1項、第4項＞

上記の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。＜同条第2項＞

信託財産の一部解約等の事由により、上記の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図を行うものとします。＜同条第3項＞

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。ただし、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。＜信託約款第27条＞

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。＜信託約款第28条＞

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。＜信託約款第23条の2＞

前記 から までの規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい当該比率以内になるよう調整を行うこととします。＜信託約款「運用の基本方針」2.（3）＞

### 3【投資リスク】

リスクに関する留意点

- 1）ファンドは値動きのある有価証券等を投資対象としますので、組入有価証券等の値動きなどの影響により、基準価額が下落することがあります。したがって、投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、これを割り込むことがあります。ファンドは預貯金と異なります。信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

- 2) ファンドは金融機関の預金または保険契約ではありませんので、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合は、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
- 3) ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

#### ファンドの主なリスク

当ファンドが有する主なリスクは以下のとおりです。

##### 1) 株価変動リスク

株式の価格(株価)が発行会社の経営・財務状況の変化、国内外の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を受け下落するリスクをいいます。株式の実質組入比率は原則として高水準を維持しますので、株価が下落した場合には、ファンドの基準価額が下落する要因となります。ファンドが実質的に投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合、その企業の株価は大きく下落し、ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

##### 2) 為替変動リスク

外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落した場合(円高の場合)には、円ベースの資産価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

当ファンドでは、外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行いませんので、日本円と日本円以外の通貨間の為替相場の変動により、基準価額が大きく変動することがあります。

##### 3) 信用リスク

発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、債券等の利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスク(債務不履行)をいいます。一般に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、株式ならびに債券およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品の価格は下落し(価格がゼロになることもあります。)、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、発行体の格付変更に伴い価格が下落するリスクもあります。

##### 4) カントリーリスク

一般に、有価証券への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制等の要因によって影響を受けます。その結果、ファンドの投資対象有価証券の発行国の政治、経済、社会情勢等の変化により、金融市場が混乱し、資産価格が大きく変動することがあります。

##### 5) 金利変動リスク

金利水準の大きな変動は株式市場に影響を及ぼす場合があり、ファンドの基準価額の変動要因となります。

##### 6) 流動性リスク

有価証券を売却あるいは購入しようとする際に、買い需要がないために売却することができない、あるいは売り需要がないために購入することができない等のリスクをいいます。そのため保有有価証券の売却を行う場合、市況動向や流動性、あるいはファンドの解約金額によっては、保有有価証券を市場実勢より低い価格で売却しなければならないケースが生じる場合があり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

##### 7) ファミリーファンド方式に起因するリスク

マザーファンドへ投資する他のベビーファンドがある場合、当該ベビーファンドの設定・解約等によりマザーファンドに資金の流出入が生じることがあります。その結果として、マザーファンドにおいて組入有価証券の売買等が生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

##### 8) 繰上償還リスク

当ファンドは、受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときなどには、繰上償還されることがあります。

##### 9) 為替取引の相手先に関するリスク

当ファンドは、外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行いませんが、対米ドルでは日本円以外の通貨にかかる外国為替予約取引を行うことがあります。

外国為替予約取引を行う場合、これらの取引には相手先の決済不履行リスクが伴います。

##### 10) その他の留意点

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変等により閉鎖

されることがあります。

#### リスク管理体制

ファンドのリスク管理は、社内規程やガイドライン等に基づき、運用部門のほか、管理部門およびコンプライアンス部門により行われています。また、リスク管理の状況は、委託会社の役員および各部門の代表者により構成されるリスク管理に関する委員会等において報告・検証され、必要に応じて改善される仕組みとなっています。

マザーファンドの外貨建資産の運用を行う投資顧問会社は、運用委託契約に基づくガイドラインのとおり運用が行われているかのチェックを行うほか、定期的にレポートを作成し、ファンドの運用状況に関する情報を委託会社へフィードバックします。

##### 1) パフォーマンス評価とリスク管理

- a. パフォーマンスおよびリスクの状況は、社内で一元的に管理しています。パフォーマンス評価およびリスク管理を行う上で分析の基礎となるデータは、各種のリスクモデル等によりデータベース化しています。
- b. 当ファンドのリスク分析とパフォーマンスの要因分析の結果は、役員、運用責任者を主要参加メンバーとするパフォーマンスレビュー委員会において報告され、運用計画と運用成果との整合性を検証することにより、当ファンドの品質の維持管理に努めています。
- c. 運用部門へのフィードバックは、パフォーマンスレビュー委員会を通じて行っています。
- d. 運用部門は、常時のモニタリングおよび前記c.の結果、必要に応じてマザーファンドの外貨建資産の運用を行う投資顧問会社との調整を行います。

##### 2) 運用にかかわるコンプライアンスチェック

- a. 担当ファンドマネジャー等においては、日次でリスク管理およびポジション管理を行っており、管理部門においても組入比率等の基礎数値を計算してリスク管理を行っています。
- b. マザーファンドの外貨建資産にかかる売買執行については、事後チェックを管理部門が担当し、そのチェック状況についてはコンプライアンス部門に報告を行っています。
- c. コンプライアンス部門においては、信託約款や運用計画書に規定された資産配分、運用内容の遵守状況、ファンド間売買等についてのチェックを行っています。
- d. コンプライアンス実践の責任者として、コンプライアンス・オフィサーを配置しています。コンプライアンス・オフィサーは社長の命を受けて、運用にかかるコンプライアンスの実践に関する基本方針を立案し、各部およびコンプライアンス部門に対して必要な指示を行う権限を有しています。
- e. コンプライアンス・オフィサーが主催し経営陣が参加して開催されるコンプライアンス委員会においては、コンプライアンス状況の報告が行われ、問題案件等がある場合には、それらについての対応策、改善策、是正措置等を協議決定することとしています。
- f. 運用部門は、常時のモニタリングおよび前記e.の結果、必要に応じてマザーファンドの外貨建資産の運用を行う投資顧問会社との調整を行います。

（注）委員会および部門の名称等は変更される場合があります。

#### <参考> 投資顧問会社のリスク管理体制

マザーファンドの外貨建資産の運用を行う投資顧問会社(ハリス・アソシエイツ社)のリスク管理体制は以下のとおりです。

##### 1) 運用担当者によるチェック

- a. 運用担当者は、運用委託契約に基づくガイドラインに定められた事項にしたがって運用を行います。個別銘柄の売買はすべてトレーダーを通じて執行されます。
- b. 売買執行後、運用担当者はポートフォリオの内容について分析を行い、ガイドラインに抵触していないかのチェックを行います。
- c. 定期的に他のファンドの運用担当者がガイドラインのとおり運用が行われているかどうかのチェックを行います。

##### 2) その他

- a. コンプライアンスにかかる体制整備として、投資顧問会社では、法務担当責任者(ゼネラル・カウンセル)のもとにコンプライアンス・オフィサーを配置しています。
- b. ブローカーの選定に際しては、知名度、取引実績および信用力等についての基準を設けています。
- c. 投資顧問会社は、定期的にレポートを作成し、当ファンドの運用状況に関する情報を委託会社へ

フィードバックします。

## 【参考情報】

### ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移



- ・年間騰落率は、上記5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
- ・分配金再投資基準価額は、2016年11月末を10,000として指数化しています。

### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



- ・グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- ・ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は税引前の分配金を再投資したものとみなして計算されており、実際の基準価額と異なる場合があります。

※決算日に対応した数値とは異なります。

※2016年11月から2021年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

先進国株…MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しています。

#### ○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害および一切の問題について、何らの責任も負いません。

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAI インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。取得申込時の商品・投資環境の説明および情報提供、ならびに購入にかかる事務手続き等の対価として販売会社にお支払いいただきます。ただし、「自動けいぞく投資コース」において、収益分配金を再投資する場合は、申込手数料はかかりません。

## （２）【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬は、信託期間を通じて毎日、純資産総額に対し年2.035%（税抜1.85%）の率を乗じて得た額とし、信託財産の費用として計上されます。信託報酬の支払いは、毎計算期末または信託終了の時に信託財産中から支弁します。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

信託報酬の配分およびそれに対価とする役務の内容は次のとおりです。

| 委託会社         | 販売会社                                    | 受託会社                    |
|--------------|-----------------------------------------|-------------------------|
| 年率1.12%（税抜）  | 年率0.65%（税抜）                             | 年率0.08%（税抜）             |
| 委託した資金の運用の対価 | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

委託会社の報酬には、ハリス・アソシエイツ社への「ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド」の運用指図権限委託報酬が含まれます。当該委託報酬の総額は、信託期間を通じて毎日、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に対し、年0.65%の率を乗じて得た額とします。

## （４）【その他の手数料等】

換金する受益者が負担する信託財産留保額として、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額が差し引かれ、信託財産に残されます。

信託財産に関する租税、信託財産にかかる監査費用および信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用を役務の対価とする監査費用は、毎日、純資産総額に対し、年0.0055%（税抜年0.005%）の率を乗じて得た額とします。ただし、年44万円（税抜年40万円）を上限とします。監査費用は、監査法人との契約等により変更になることがあります。

ファンドの組入る有価証券売買時に支払う手数料を役務の対価とする売買委託手数料、先物取引・オプション取引・スワップ取引・金利先渡取引・為替先渡取引・外国為替予約取引に要する費用、公社債の借入れにかかる費用、資産を外国で保管する場合の費用ならびに借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。これらの費用に消費税等がかかる場合は、その消費税等相当額を信託財産中から支弁します。これらの費用は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

当該手数料等の合計額については、投資者がファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

## （５）【課税上の取扱い】

日本の居住者（法人を含みます。）である受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度および未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。

#### 個別元本について

##### 1) 追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

##### 2) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより計算されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、販売会社毎に個別元本が計算されます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本が計算される場合があります。

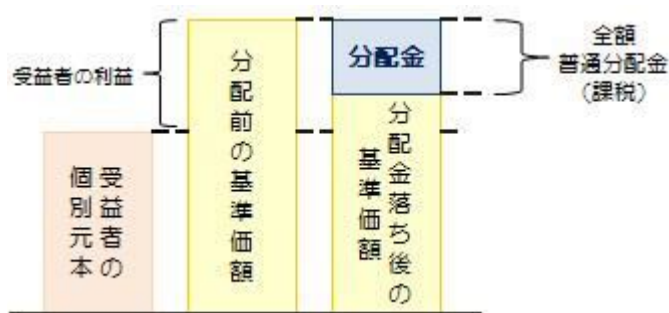
##### 3) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

#### 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）とがあります。

##### 1) 普通分配金

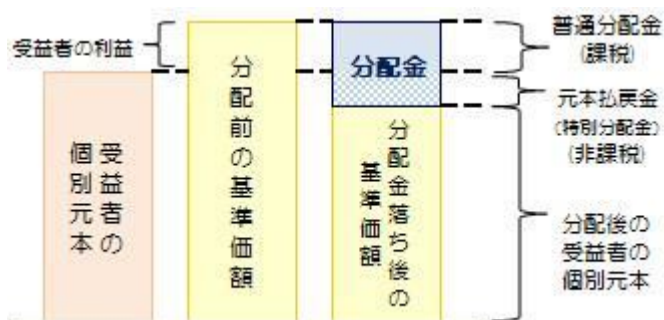
<イメージ図>



収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本と同額または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

##### 2) 元本払戻金（特別分配金）

<イメージ図>



収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上図は、あくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、収益分配金の各水準等を示唆するものではありません。

税法等が改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。

#### 個人、法人別の課税の取扱いについて

##### 1) 個人の受益者に対する課税

###### a. 収益分配金に対する課税

個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税および復興特別所得税15.315%、地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません。）または申告分離課税を選択することもできます。

###### b. ご換金（解約）時および償還時における課税

解約時の解約価額<sup>注</sup>および償還時の償還価額から取得費（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した差益（譲渡益）は、譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます。特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

その税率は、20.315%（所得税および復興特別所得税15.315%、地方税5%）です。

注：解約価額とは、基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額です。

c．損益通算について

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当等や特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等との損益通算が可能です。また、解約時および償還時の譲渡益については、他の上場株式等の譲渡損との損益通算が可能です。

d．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。NISA口座での損失と他の口座での配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2）法人の受益者に対する課税

a．収益分配金に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、15.315%（所得税および復興特別所得税）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。

b．ご換金（解約）時および償還時における課税

解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税および復興特別所得税）の税率で源泉徴収されます。地方税の徴収はありません。

c．益金不算入制度の適用はありません。

確定拠出年金制度にかかる受益者に対する課税上の取扱い

確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用され、当ファンドの収益分配時、ご換金（解約）時および償還時における課税は行われません。

上記は、2021年10月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

分配時において、外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

2021年10月29日現在の状況を記載しています。

投資比率とは、純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### （１）【投資状況】

ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

| 資産の種類                  | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|------------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券              | 日本   | 20,309,079,990 | 99.14   |
| コール・ローン等、その他の資産（負債控除後） | —    | 175,404,410    | 0.86    |
| 合計（純資産総額）              |      | 20,484,484,400 | 100.00  |

## （参考）ALAMCO ハリス グローバル バリュースタマザーファンド

| 資産の種類                  | 国／地域  | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|------------------------|-------|----------------|---------|
| 株式                     | アメリカ  | 15,283,115,332 | 42.66   |
|                        | メキシコ  | 366,576,202    | 1.02    |
|                        | ドイツ   | 7,503,049,267  | 20.94   |
|                        | フランス  | 1,750,873,957  | 4.89    |
|                        | オランダ  | 1,768,985,651  | 4.94    |
|                        | イギリス  | 1,038,602,330  | 2.90    |
|                        | スイス   | 3,700,415,732  | 10.33   |
|                        | ケイマン  | 939,461,112    | 2.62    |
|                        | 韓国    | 804,548,402    | 2.25    |
|                        | 南アフリカ | 304,759,631    | 0.85    |
|                        | ジャージー | 1,616,030,054  | 4.51    |
|                        | 小計    | 35,076,417,670 | 97.91   |
| 新株予約権付社債券等             | ガーンジー | 115,335,660    | 0.32    |
| コール・ローン等、その他の資産(負債控除後) | —     | 631,886,996    | 1.77    |
| 合計(純資産総額)              |       | 35,823,640,326 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 資産の種類  | 建別 | 国／地域 | 時価合計（円）   | 投資比率（％） |
|--------|----|------|-----------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | —    | 8,918,340 | 0.02    |
|        | 売建 | —    | 8,922,719 | 0.02    |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

## イ.評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国／地域 | 種類            | 銘柄名                               | 数量            | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|----|------|---------------|-----------------------------------|---------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | ALAMCO ハリス グローバル<br>バリュースタマザーファンド | 6,560,416,058 | 2.9824            | 19,565,784,852    | 3.0957           | 20,309,079,990   | 99.14           |

## ロ.種類別投資比率

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.14   |

|    |       |
|----|-------|
| 合計 | 99.14 |
|----|-------|

（参考）ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド

## イ.評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国／地域  | 種類 | 銘柄名                                    | 業種                                         | 数量        | 帳簿価額<br>単価<br>(円) | 帳簿価額<br>金額<br>(円) | 評価額<br>単価<br>(円) | 評価額<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------|----|----------------------------------------|--------------------------------------------|-----------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1  | アメリカ  | 株式 | ALPHABET INC-CL A                      | メディア・娯楽                                    | 7,245     | 230,137.41        | 1,667,345,599     | 331,573.11       | 2,402,247,230    | 6.71            |
| 2  | ドイツ   | 株式 | BAYER AG                               | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 238,800   | 6,998.46          | 1,671,234,146     | 6,470.54         | 1,545,166,373    | 4.31            |
| 3  | ドイツ   | 株式 | ALLIANZ SE                             | 保険                                         | 52,545    | 28,462.51         | 1,495,562,739     | 26,680.13        | 1,401,907,509    | 3.91            |
| 4  | フランス  | 株式 | BNP PARIBAS                            | 銀行                                         | 183,665   | 7,032.82          | 1,291,684,153     | 7,628.96         | 1,401,173,710    | 3.91            |
| 5  | ドイツ   | 株式 | DAIMLER AG-REG                         | 自動車・<br>自動車部<br>品                          | 121,444   | 9,615.20          | 1,167,708,762     | 11,132.76        | 1,352,007,452    | 3.77            |
| 6  | アメリカ  | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY<br>INC-CL B         | 各種金融                                       | 40,900    | 29,471.22         | 1,205,372,935     | 32,932.47        | 1,346,938,121    | 3.76            |
| 7  | スイス   | 株式 | CREDIT SUISSE GROUP<br>AG-REG          | 各種金融                                       | 1,085,384 | 1,595.29          | 1,731,509,513     | 1,197.65         | 1,299,918,243    | 3.63            |
| 8  | アメリカ  | 株式 | FISERV INC                             | ソフト<br>ウェア・<br>サービス                        | 104,500   | 12,689.14         | 1,326,016,096     | 11,199.90        | 1,170,390,083    | 3.27            |
| 9  | ジャージー | 株式 | GLENCORE PLC                           | 素材                                         | 2,075,500 | 437.47            | 907,973,137       | 563.53           | 1,169,625,610    | 3.26            |
| 10 | アメリカ  | 株式 | KEURIG DR PEPPER INC                   | 食品・飲<br>料・タバ<br>コ                          | 271,100   | 3,714.73          | 1,007,064,821     | 4,034.14         | 1,093,657,604    | 3.05            |
| 11 | アメリカ  | 株式 | HCA HEALTHCARE INC                     | ヘルスケ<br>ア機器・<br>サービス                       | 37,865    | 21,623.44         | 818,771,711       | 28,493.65        | 1,078,912,394    | 3.01            |
| 12 | スイス   | 株式 | JULIUS BAER GROUP<br>LTD               | 各種金融                                       | 125,910   | 7,139.54          | 898,940,137       | 8,229.68         | 1,036,199,689    | 2.89            |
| 13 | オランダ  | 株式 | CNH INDUSTRIAL NV                      | 資本財                                        | 503,600   | 1,747.25          | 879,916,712       | 1,976.94         | 995,589,653      | 2.78            |
| 14 | アメリカ  | 株式 | HUMANA INC                             | ヘルスケ<br>ア機器・<br>サービス                       | 18,230    | 46,094.32         | 840,299,484       | 53,152.09        | 968,962,637      | 2.70            |
| 15 | ドイツ   | 株式 | FRESENIUS MEDICAL<br>CARE AG & CO KGAA | ヘルスケ<br>ア機器・<br>サービス                       | 119,000   | 7,844.05          | 933,442,140       | 7,913.09         | 941,657,948      | 2.63            |
| 16 | アメリカ  | 株式 | BANK OF AMERICA CORP                   | 銀行                                         | 170,000   | 4,252.39          | 722,907,099       | 5,431.15         | 923,295,942      | 2.58            |
| 17 | アメリカ  | 株式 | AMERICAN<br>INTERNATIONAL GROUP        | 保険                                         | 127,300   | 5,394.77          | 686,755,265       | 6,808.83         | 866,764,441      | 2.42            |
| 18 | アメリカ  | 株式 | CHARTER<br>COMMUNICATIONS INC          | メディア<br>・娯楽                                | 9,862     | 70,233.28         | 692,640,636       | 80,281.71        | 791,738,233      | 2.21            |
| 19 | オランダ  | 株式 | PROSUS NV                              | 小売                                         | 76,115    | 10,788.35         | 821,155,741       | 10,160.88        | 773,395,998      | 2.16            |
| 20 | アメリカ  | 株式 | BOOKING HOLDINGS INC                   | 消費者<br>サービス                                | 2,660     | 268,552.19        | 714,348,839       | 276,191.95       | 734,670,603      | 2.05            |
| 21 | イギリス  | 株式 | LIBERTY GLOBAL<br>GROUP-A              | 電気通信<br>サービス                               | 206,174   | 2,757.63          | 568,552,473       | 3,255.50         | 671,201,271      | 1.87            |
| 22 | アメリカ  | 株式 | HILTON WORLDWIDE<br>HOLDINGS           | 消費者<br>サービス                                | 39,400    | 14,234.89         | 560,854,828       | 16,600.36        | 654,054,452      | 1.83            |
| 23 | ドイツ   | 株式 | SAP SE                                 | ソフト<br>ウェア・<br>サービス                        | 39,000    | 13,944.83         | 543,848,491       | 16,768.85        | 653,985,189      | 1.83            |
| 24 | スイス   | 株式 | HOLCIM LTD                             | 素材                                         | 109,315   | 6,258.49          | 684,147,207       | 5,687.68         | 621,749,614      | 1.74            |

|    |      |    |                                |                                            |         |           |             |           |             |      |
|----|------|----|--------------------------------|--------------------------------------------|---------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 25 | ドイツ  | 株式 | BAYERISCHE MOTOREN<br>WERKE AG | 自動車・<br>自動車部<br>品                          | 53,300  | 10,621.60 | 566,131,280 | 11,596.13 | 618,073,825 | 1.73 |
| 26 | アメリカ | 株式 | GENERAL MOTORS CO              | 自動車・<br>自動車部<br>品                          | 99,100  | 6,264.35  | 620,797,451 | 6,165.46  | 610,997,165 | 1.71 |
| 27 | アメリカ | 株式 | CITIGROUP INC                  | 銀行                                         | 74,600  | 8,241.07  | 614,784,195 | 8,056.92  | 601,046,948 | 1.68 |
| 28 | スイス  | 株式 | NOVARTIS AG-REG                | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 61,600  | 9,847.43  | 606,601,903 | 9,544.33  | 587,931,319 | 1.64 |
| 29 | ドイツ  | 株式 | FRESENIUS SE & CO<br>KGAA      | ヘルスケ<br>ア機器・<br>サービス                       | 108,400 | 5,774.14  | 625,917,119 | 5,325.40  | 577,273,869 | 1.61 |
| 30 | アメリカ | 株式 | HALLIBURTON CORP               | エネル<br>ギー                                  | 184,900 | 2,757.63  | 509,886,564 | 2,911.08  | 538,260,301 | 1.50 |

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類             | 国内 / 外国 | 業種                     | 投資比率<br>(%) |
|----------------|---------|------------------------|-------------|
| 株式             | 外国      | エネルギー                  | 1.50        |
|                |         | 素材                     | 5.00        |
|                |         | 資本財                    | 4.21        |
|                |         | 自動車・自動車部品              | 7.20        |
|                |         | 耐久消費財・アパレル             | 0.43        |
|                |         | 消費者サービス                | 4.90        |
|                |         | メディア・娯楽                | 12.24       |
|                |         | 小売                     | 5.63        |
|                |         | 食品・飲料・タバコ              | 4.85        |
|                |         | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.15        |
|                |         | ヘルスケア機器・サービス           | 9.96        |
|                |         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 5.95        |
|                |         | 銀行                     | 8.17        |
|                |         | 各種金融                   | 10.80       |
|                |         | 保険                     | 6.33        |
| 新株予約権付社債券<br>等 | —       | ソフトウェア・サービス            | 5.66        |
|                |         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 1.02        |
|                |         | 電気通信サービス               | 2.90        |
| 合計             |         |                        | 98.24       |

## 【投資不動産物件】

ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

該当事項はありません。

（参考）ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド

該当事項はありません。

# 【その他投資資産の主要なもの】

ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

該当事項はありません。

（参考）ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド

| 資産の種類  | 通貨     | 買建 / 売建 | 数量        | 帳簿価額<br>（円） | 評価額<br>（円） | 投資比率<br>（％） |
|--------|--------|---------|-----------|-------------|------------|-------------|
| 為替予約取引 | 米ドル    | 買建      | 36,168.48 | 4,113,443   | 4,111,166  | 0.01        |
|        | ユーロ    | 買建      | 36,205.99 | 4,809,208   | 4,807,174  | 0.01        |
|        | 米ドル    | 売建      | 42,308.51 | 4,809,208   | 4,809,085  | 0.01        |
|        | スイスフラン | 売建      | 32,978.78 | 4,113,443   | 4,113,634  | 0.01        |

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## （３）【運用実績】

### 【純資産の推移】

ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

| 期別       |               | 純資産総額（円）       |                | 1万口当たり純資産額（円） |        |
|----------|---------------|----------------|----------------|---------------|--------|
|          |               | （分配落）          | （分配付）          | （分配落）         | （分配付）  |
| 第4特定期間末  | （2012年 3月 9日） | 8,054,886,711  | 8,105,817,935  | 9,507         | 9,567  |
| 第5特定期間末  | （2012年 9月10日） | 3,867,063,088  | 3,900,856,531  | 9,145         | 9,205  |
| 第6特定期間末  | （2013年 3月11日） | 5,335,407,908  | 5,475,668,603  | 12,436        | 12,766 |
| 第7特定期間末  | （2013年 9月 9日） | 5,872,751,469  | 6,111,857,191  | 13,494        | 14,094 |
| 第8特定期間末  | （2014年 3月10日） | 7,131,527,991  | 7,414,149,323  | 14,792        | 15,392 |
| 第9特定期間末  | （2014年 9月 9日） | 6,821,577,555  | 7,080,999,096  | 14,581        | 15,181 |
| 第10特定期間末 | （2015年 3月 9日） | 10,276,653,981 | 10,597,863,907 | 15,769        | 16,369 |
| 第11特定期間末 | （2015年 9月 9日） | 9,620,561,289  | 10,070,458,131 | 13,849        | 14,499 |
| 第12特定期間末 | （2016年 3月 9日） | 8,199,445,332  | 8,613,676,538  | 11,794        | 12,394 |
| 第13特定期間末 | （2016年 9月 9日） | 7,834,181,744  | 8,249,669,712  | 11,381        | 11,981 |
| 第14特定期間末 | （2017年 3月 9日） | 9,664,978,036  | 10,080,199,247 | 13,826        | 14,426 |
| 第15特定期間末 | （2017年 9月11日） | 7,331,435,974  | 7,674,707,641  | 14,200        | 14,800 |
| 第16特定期間末 | （2018年 3月 9日） | 14,614,220,333 | 15,178,057,983 | 13,841        | 14,591 |
| 第17特定期間末 | （2018年 9月10日） | 17,959,533,615 | 18,743,402,329 | 12,624        | 13,224 |
| 第18特定期間末 | （2019年 3月11日） | 16,765,917,856 | 17,658,355,645 | 11,087        | 11,687 |
| 第19特定期間末 | （2019年 9月 9日） | 16,656,679,364 | 17,588,684,202 | 10,512        | 11,112 |

|            |               |                |                |        |        |
|------------|---------------|----------------|----------------|--------|--------|
| 第20特定期間末   | (2020年 3月 9日) | 15,494,900,384 | 16,392,599,453 | 8,914  | 9,464  |
| 第21特定期間末   | (2020年 9月 9日) | 17,063,016,343 | 17,662,586,179 | 9,735  | 10,075 |
| 第22特定期間末   | (2021年 3月 9日) | 18,940,010,306 | 19,732,771,121 | 12,780 | 13,280 |
| 第23特定期間末   | (2021年 9月 9日) | 19,726,106,414 | 20,602,705,554 | 12,966 | 13,566 |
| 2020年10月末日 |               | 15,485,921,988 | —              | 8,936  | —      |
| 11月末日      |               | 18,187,542,568 | —              | 11,022 | —      |
| 12月末日      |               | 17,820,007,291 | —              | 11,220 | —      |
| 2021年 1月末日 |               | 17,162,431,009 | —              | 11,404 | —      |
| 2月末日       |               | 17,960,654,051 | —              | 12,318 | —      |
| 3月末日       |               | 19,447,888,357 | —              | 13,070 | —      |
| 4月末日       |               | 17,139,375,537 | —              | 13,334 | —      |
| 5月末日       |               | 19,857,103,330 | —              | 13,645 | —      |
| 6月末日       |               | 19,984,684,710 | —              | 13,384 | —      |
| 7月末日       |               | 20,063,498,902 | —              | 13,218 | —      |
| 8月末日       |               | 19,889,662,999 | —              | 13,087 | —      |
| 9月末日       |               | 19,763,310,218 | —              | 12,959 | —      |
| 10月末日      |               | 20,484,484,400 | —              | 13,581 | —      |

(注)分配付の金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

#### 【分配の推移】

#### ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

| 期       | 計算期間                    | 1万口当たりの分配金（円） |
|---------|-------------------------|---------------|
| 第4特定期間  | 2011年 9月10日～2012年 3月 9日 | 60            |
| 第5特定期間  | 2012年 3月10日～2012年 9月10日 | 60            |
| 第6特定期間  | 2012年 9月11日～2013年 3月11日 | 330           |
| 第7特定期間  | 2013年 3月12日～2013年 9月 9日 | 600           |
| 第8特定期間  | 2013年 9月10日～2014年 3月10日 | 600           |
| 第9特定期間  | 2014年 3月11日～2014年 9月 9日 | 600           |
| 第10特定期間 | 2014年 9月10日～2015年 3月 9日 | 600           |
| 第11特定期間 | 2015年 3月10日～2015年 9月 9日 | 650           |
| 第12特定期間 | 2015年 9月10日～2016年 3月 9日 | 600           |
| 第13特定期間 | 2016年 3月10日～2016年 9月 9日 | 600           |
| 第14特定期間 | 2016年 9月10日～2017年 3月 9日 | 600           |
| 第15特定期間 | 2017年 3月10日～2017年 9月11日 | 600           |
| 第16特定期間 | 2017年 9月12日～2018年 3月 9日 | 750           |
| 第17特定期間 | 2018年 3月10日～2018年 9月10日 | 600           |
| 第18特定期間 | 2018年 9月11日～2019年 3月11日 | 600           |
| 第19特定期間 | 2019年 3月12日～2019年 9月 9日 | 600           |
| 第20特定期間 | 2019年 9月10日～2020年 3月 9日 | 550           |
| 第21特定期間 | 2020年 3月10日～2020年 9月 9日 | 340           |

|         |                         |     |
|---------|-------------------------|-----|
| 第22特定期間 | 2020年 9月10日～2021年 3月 9日 | 500 |
| 第23特定期間 | 2021年 3月10日～2021年 9月 9日 | 600 |

## 【収益率の推移】

## ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

| 期       | 計算期間                    | 収益率（％） |
|---------|-------------------------|--------|
| 第4特定期間  | 2011年 9月10日～2012年 3月 9日 | 23.0   |
| 第5特定期間  | 2012年 3月10日～2012年 9月10日 | 3.2    |
| 第6特定期間  | 2012年 9月11日～2013年 3月11日 | 39.6   |
| 第7特定期間  | 2013年 3月12日～2013年 9月 9日 | 13.3   |
| 第8特定期間  | 2013年 9月10日～2014年 3月10日 | 14.1   |
| 第9特定期間  | 2014年 3月11日～2014年 9月 9日 | 2.6    |
| 第10特定期間 | 2014年 9月10日～2015年 3月 9日 | 12.3   |
| 第11特定期間 | 2015年 3月10日～2015年 9月 9日 | 8.1    |
| 第12特定期間 | 2015年 9月10日～2016年 3月 9日 | 10.5   |
| 第13特定期間 | 2016年 3月10日～2016年 9月 9日 | 1.6    |
| 第14特定期間 | 2016年 9月10日～2017年 3月 9日 | 26.8   |
| 第15特定期間 | 2017年 3月10日～2017年 9月11日 | 7.0    |
| 第16特定期間 | 2017年 9月12日～2018年 3月 9日 | 2.8    |
| 第17特定期間 | 2018年 3月10日～2018年 9月10日 | 4.5    |
| 第18特定期間 | 2018年 9月11日～2019年 3月11日 | 7.4    |
| 第19特定期間 | 2019年 3月12日～2019年 9月 9日 | 0.2    |
| 第20特定期間 | 2019年 9月10日～2020年 3月 9日 | 10.0   |
| 第21特定期間 | 2020年 3月10日～2020年 9月 9日 | 13.0   |
| 第22特定期間 | 2020年 9月10日～2021年 3月 9日 | 36.4   |
| 第23特定期間 | 2021年 3月10日～2021年 9月 9日 | 6.2    |

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ち、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

## （４）【設定及び解約の実績】

## ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

| 期      | 計算期間                    | 設定口数（口）       | 解約口数（口）       |
|--------|-------------------------|---------------|---------------|
| 第4特定期間 | 2011年 9月10日～2012年 3月 9日 | 29,405,956    | 22,297,768    |
| 第5特定期間 | 2012年 3月10日～2012年 9月10日 | 2,461,782     | 4,246,451,294 |
| 第6特定期間 | 2012年 9月11日～2013年 3月11日 | 99,206,507    | 37,649,439    |
| 第7特定期間 | 2013年 3月12日～2013年 9月 9日 | 2,273,050,660 | 2,211,236,023 |
| 第8特定期間 | 2013年 9月10日～2014年 3月10日 | 741,444,303   | 272,440,054   |

|         |                         |               |               |
|---------|-------------------------|---------------|---------------|
| 第9特定期間  | 2014年 3月11日～2014年 9月 9日 | 2,332,535,158 | 2,475,179,032 |
| 第10特定期間 | 2014年 9月10日～2015年 3月 9日 | 2,048,845,890 | 210,161,027   |
| 第11特定期間 | 2015年 3月10日～2015年 9月 9日 | 547,235,389   | 117,766,950   |
| 第12特定期間 | 2015年 9月10日～2016年 3月 9日 | 111,024,836   | 105,135,468   |
| 第13特定期間 | 2016年 3月10日～2016年 9月 9日 | 64,994,046    | 133,654,749   |
| 第14特定期間 | 2016年 9月10日～2017年 3月 9日 | 226,394,725   | 119,542,680   |
| 第15特定期間 | 2017年 3月10日～2017年 9月11日 | 421,277,712   | 2,248,895,284 |
| 第16特定期間 | 2017年 9月12日～2018年 3月 9日 | 6,142,985,702 | 747,709,833   |
| 第17特定期間 | 2018年 3月10日～2018年 9月10日 | 4,593,806,554 | 926,129,259   |
| 第18特定期間 | 2018年 9月11日～2019年 3月11日 | 1,846,443,767 | 950,853,985   |
| 第19特定期間 | 2019年 3月12日～2019年 9月 9日 | 1,799,373,804 | 1,075,363,989 |
| 第20特定期間 | 2019年 9月10日～2020年 3月 9日 | 3,031,850,019 | 1,494,542,391 |
| 第21特定期間 | 2020年 3月10日～2020年 9月 9日 | 1,272,702,369 | 1,127,916,595 |
| 第22特定期間 | 2020年 9月10日～2021年 3月 9日 | 1,154,838,469 | 3,862,440,995 |
| 第23特定期間 | 2021年 3月10日～2021年 9月 9日 | 4,159,880,654 | 3,766,582,076 |

## 参考情報



# 運用実績

(2021年10月29日現在)

## ● 基準価額・純資産の推移

基準価額 13,581円 純資産総額 204.84億円



※分配金再投資基準価額は信託報酬控除後であり、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しています。(設定日：2010年4月22日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

## ● 分配の推移

| 決算期      | 分配金     |
|----------|---------|
| 2021年 6月 | 100円    |
| 2021年 7月 | 100円    |
| 2021年 8月 | 100円    |
| 2021年 9月 | 100円    |
| 2021年10月 | 100円    |
| 直近1年間累計  | 1,150円  |
| 設定来累計    | 10,820円 |

※分配金は1万口当たり、税引前の金額です。

## ● 主要な資産の状況

マザーファンドの資産の状況を記載しています。

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する投資比率です。

### 資産別構成

|       | 比率     |
|-------|--------|
| 株式    | 97.9%  |
| その他資産 | 2.1%   |
| 合計    | 100.0% |

### 組入上位10業種

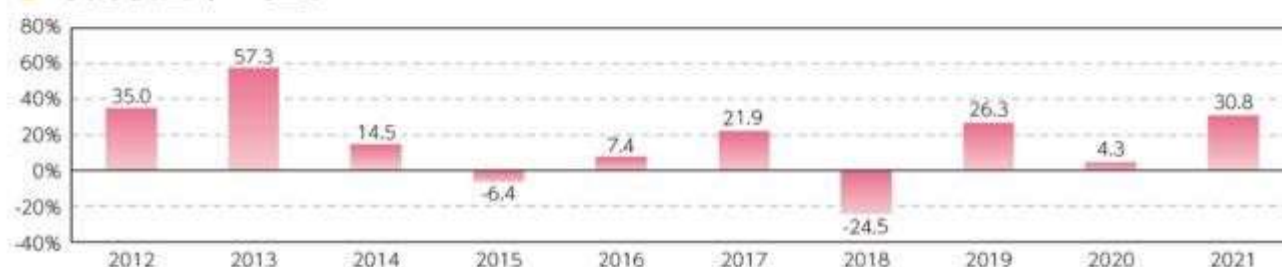
| 順位 | 業種名                   | 比率    |
|----|-----------------------|-------|
| 1  | メディア・娯楽               | 12.2% |
| 2  | 各種金融                  | 10.8% |
| 3  | ヘルスケア機器・サービス          | 10.0% |
| 4  | 銀行                    | 8.2%  |
| 5  | 自動車・自動車部品             | 7.2%  |
| 6  | 保険                    | 6.3%  |
| 7  | 製薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 6.0%  |
| 8  | ソフトウェア・サービス           | 5.7%  |
| 9  | 小売                    | 5.6%  |
| 10 | 素材                    | 5.0%  |

※業種はGICS（世界産業分類基準）に基づく24産業グループによります。

### 組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名                         | 投資国  | 業種名                   | 比率   |
|----|-----------------------------|------|-----------------------|------|
| 1  | ALPHABET INC-CL A           | アメリカ | メディア・娯楽               | 6.7% |
| 2  | BAYER AG                    | ドイツ  | 製薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 4.3% |
| 3  | ALLIANZ SE                  | ドイツ  | 保険                    | 3.9% |
| 4  | BNP PARIBAS                 | フランス | 銀行                    | 3.9% |
| 5  | DAIMLER AG-REG              | ドイツ  | 自動車・自動車部品             | 3.8% |
| 6  | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | アメリカ | 各種金融                  | 3.8% |
| 7  | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG  | スイス  | 各種金融                  | 3.6% |
| 8  | FISERV INC                  | アメリカ | ソフトウェア・サービス           | 3.3% |
| 9  | GLENCORE PLC                | イギリス | 素材                    | 3.3% |
| 10 | KEURIG DR PEPPER INC        | アメリカ | 食品・飲料・タバコ             | 3.1% |

## ● 年間収益率の推移



※年間収益率は、税引前分配金を再投資したものと計算しています。

※2021年は10月29日までの収益率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
・最新の運用状況は、委託会社のホームページで確認することができます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

取得申込みは、申込期間における販売会社の営業日にいつでも行うことができます。申込受付時間は、原則として午後3時<sup>注</sup>までとし、当該取得申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分として取り扱います。ただし、ニューヨーク証券取引所が休場日の場合には、取得申込みの受付は行いません。該当する日については、販売会社または委託会社までお問い合わせください。

注：販売会社によっては午後3時より前に受け付けを締め切ることがありますので、各販売会社にご確認ください。

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込金額の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行います。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

当ファンドには、収益分配金の受取方法の別により、収益分配金を受け取る「分配金受取コース」と、税金を差し引いた後の収益分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。申込方法および申込単位は、販売会社が個別に定めるものとします。ただし、「自動けいぞく投資コース」における収益分配金の再投資については、1口単位となります。

お申込み価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。取得申込みには、お申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等が別に加算されます。ただし、「自動けいぞく投資コース」における収益分配金の再投資については、当該計算期間終了日の基準価額となります。

お申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。

取得申込者は、取得申込金額をお申込みの販売会社に、当該販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

「自動けいぞく投資コース」を選択する場合には、販売会社との間で「自動けいぞく投資約款<sup>注</sup>」にしたがって契約を締結します。

また、「自動けいぞく投資コース」を選択した取得申込者が、「定時定額購入サービス」を利用する場合には、販売会社との間で「定時定額購入サービス」等に関する契約<sup>注</sup>を締結するものとします。なお、「定時定額購入サービス」等の取扱いの有無については、お申込みの販売会社にご確認ください。

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。取得申込みの受け付けが中止された場合には、取得申込者は当該受付中止以前に行った取得申込みを撤回できます。ただし、取得申込者がその取得申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に取得申込みを受け付けたものとして取り扱います。

### 2【換金（解約）手続等】

#### < 解約請求について >

解約請求は、販売会社の営業日にいつでも行うことができます。受付時間は、原則として午後3時<sup>注</sup>までとし、当該解約請求にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分として取り扱います。ただし、ニューヨーク証券取引所が休場日の場合には、当該解約請求の受け付けは行いません。該当する日については、販売会社または委託会社までお問い合わせください。

注：販売会社によっては午後3時より前に受付けを締め切ることがありますので、各販売会社にご確認ください。

委託会社は、解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

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

ご解約単位は、販売会社が個別に定める単位とします。

ご解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額(基準価額の0.3%)を差し引いた額です。1口当たりの解約価額に解約口数を乗じて得た額から、税金を差し引いた額がお受取金額となります。

ご解約価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせください。

|                      |                                                                 |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 朝日ライフ アセットマネジメント株式会社 |                                                                 |
| ホームページ               | <a href="http://www.alamco.co.jp/">http://www.alamco.co.jp/</a> |
| フリーダイヤル              | 0120-283-104（営業日の9:00～17:00）                                    |

ご解約代金は、解約請求受付日から起算して、原則として5営業日目から販売会社の営業所等において受益者に支払われます。

信託財産の資金管理を円滑に行うために大口の解約請求には制限を設ける場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付けを中止すること、およびすでに受け付けた解約請求の受付けを取り消すことがあります。解約請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の計算

基準価額は、信託財産に属する資産(受入担保代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(以下「純資産総額」といいます。)を計算日における受益権総口数で除して計算します。

当ファンドにおいては、1万口当たりの価額として表示されます。

当ファンドの信託財産に属する資産のうち、主要投資対象およびその評価方法は以下のとおりです。

|                                        |                           |
|----------------------------------------|---------------------------|
| ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マ<br>ザーファンド受益証券 | 移動平均法に基づき、基準価額により評価しています。 |
|----------------------------------------|---------------------------|

なお、外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、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るものとします。

#### <参考> マザーファンドの主要投資対象およびその評価方法

|    |                                                                                                                           |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 株式 | 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しています。時価評価にあたっては、金融商品取引所または店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、また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います。 |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

##### 基準価額の計算頻度と公表

基準価額は、委託会社の毎営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社へお問い合わせいただけるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

|                      |                                                                 |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 朝日ライフ アセットマネジメント株式会社 |                                                                 |
| ホームページ               | <a href="http://www.alamco.co.jp/">http://www.alamco.co.jp/</a> |
| フリーダイヤル              | 0120-283-104（営業日の9:00～17:00）                                    |

## （２）【保管】

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。したがって、委託会社は受益証券を発行しません。

## （３）【信託期間】

信託期間は無期限です。

「（５）その他 信託の終了(償還)」の規定により信託を終了させる場合があります。

## （４）【計算期間】

原則として、毎月10日から翌月9日までとします。

各計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を各計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

## （５）【その他】

信託の終了(償還)

- 1) 委託会社は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- 2) 委託会社は、1)の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 3) 2)の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下3)において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 4) 2)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- 5) 2)から4)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、2)から4)までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- 6) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 7) 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託

会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更等4）」の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- 8) 受託会社がその任務を辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更等

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は1)から7)までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- 2) 委託会社は、1)の事項(1)の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、1)の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 3) 2)の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下3)において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 4) 2)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- 5) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- 6) 2)から5)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案した場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- 7) 1)から6)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- 8) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、1)から7)までの規定にしたがいます。

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 運用報告書の作成および交付

- 1) 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買の状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書を毎年9月および3月の計算期末および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に交付します。
- 2) 委託会社は、運用報告書(全体版)を作成し、委託会社のホームページ(<http://www.alamco.co.jp/>)に掲載します。
- 3) 2)の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があつた場合には、これを交付します。

#### 関係法人との契約の更改

- 1) 委託会社と受託会社との間の信託契約は無期限です。ただし、「信託の終了(償還)」に該当することとなった場合には解約されます。
- 2) 委託会社と販売会社との間の募集・販売等に関する契約は、期間満了の3ヵ月前までに委託会社および販売会社のいずれからも別段の意思表示がない限り、同一の条件で更新されます。
- 3) 委託会社と投資顧問会社との間の運用委託契約は、期間満了の3ヵ月前までに委託会社および投資顧問会社のいずれからも別段の意思表示がない限り、同一の条件で更新されます。

#### 信託事務処理の委託

受託会社は、再信託受託会社と再信託契約を締結することにより、当ファンドの信託財産すべてを再信託受託会社へ移管し、当ファンドにかかる信託事務処理の一部を委託することがあります。その場合には、信託財産の管理にかかる事務のうち再信託にかかる契約書類に基づく所定の事務を行います。

なお、再信託受託会社が受ける信託事務処理の一部の委託にかかる報酬は、受託会社が受け取る信託報酬の中から当事者間で支払われるものとし、信託財産からの直接的な支弁は行いません。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

##### 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で、取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者としてします。)に支払います。

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

受益者が支払開始日から5年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属するものとしてします。

##### 償還金に対する請求権

受益者は、償還金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日(以下「償還日」といいます。)後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日まで)から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で、取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者としてします。)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して、委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい、当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益者が支払開始日から10年間請求を行わない場合は、その権利を失い、その金銭は委託会社に帰属するものとしてします。

##### 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に解約請求をすることができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

##### 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。

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、当特定期間（2021年 3月10日から2021年9月 9日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【ハリス世界株ファンド（毎月決算型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 前期<br>（2021年 3月 9日現在） | 当期<br>（2021年 9月 9日現在） |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部            |                       |                       |
| 流動資産            |                       |                       |
| コール・ローン         | 503,671,743           | 316,510,787           |
| 親投資信託受益証券       | 18,713,243,439        | 19,611,865,448        |
| 流動資産合計          | 19,216,915,182        | 19,928,376,235        |
| 資産合計            | 19,216,915,182        | 19,928,376,235        |
| 負債の部            |                       |                       |
| 流動負債            |                       |                       |
| 未払収益分配金         | 148,200,635           | 152,133,621           |
| 未払解約金           | 100,202,673           | 16,747,940            |
| 未払受託者報酬         | 1,222,937             | 1,434,278             |
| 未払委託者報酬         | 27,057,472            | 31,733,332            |
| 未払利息            | 1,159                 | 650                   |
| その他未払費用         | 220,000               | 220,000               |
| 流動負債合計          | 276,904,876           | 202,269,821           |
| 負債合計            | 276,904,876           | 202,269,821           |
| 純資産の部           |                       |                       |
| 元本等             |                       |                       |
| 元本              | 14,820,063,558        | 15,213,362,136        |
| 剰余金             |                       |                       |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 4,119,946,748         | 4,512,744,278         |
| （分配準備積立金）       | 2,405,321,242         | 2,463,820,702         |
| 元本等合計           | 18,940,010,306        | 19,726,106,414        |
| 純資産合計           | 18,940,010,306        | 19,726,106,414        |
| 負債純資産合計         | 19,216,915,182        | 19,928,376,235        |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                         | 前期<br>自 2020年 9月10日<br>至 2021年 3月 9日 | 当期<br>自 2021年 3月10日<br>至 2021年 9月 9日 |
|-------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 営業収益                    |                                      |                                      |
| 有価証券売買等損益               | 5,825,516,618                        | 1,248,622,009                        |
| 営業収益合計                  | 5,825,516,618                        | 1,248,622,009                        |
| 営業費用                    |                                      |                                      |
| 支払利息                    | 49,708                               | 146,911                              |
| 受託者報酬                   | 7,620,937                            | 8,548,641                            |
| 委託者報酬                   | 168,613,052                          | 189,138,511                          |
| その他費用                   | 220,000                              | 221,044                              |
| 営業費用合計                  | 176,503,697                          | 198,055,107                          |
| 営業利益又は営業損失（ ）           | 5,649,012,921                        | 1,050,566,902                        |
| 経常利益又は経常損失（ ）           | 5,649,012,921                        | 1,050,566,902                        |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）         | 5,649,012,921                        | 1,050,566,902                        |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      | 137,663,200                          | 3,188,939                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）         | 464,649,741                          | 4,119,946,748                        |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          | 224,355,656                          | 1,362,284,179                        |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 53,969,393                           | -                                    |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 170,386,263                          | 1,362,284,179                        |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          | 358,348,073                          | 1,140,265,472                        |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 348,158,209                          | 1,140,265,472                        |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 10,189,864                           | -                                    |
| 分配金                     | 792,760,815                          | 876,599,140                          |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）         | 4,119,946,748                        | 4,512,744,278                        |

## （３）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                   |                                         |
|-------------------|-----------------------------------------|
| 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<br>移動平均法に基づき、基準価額により評価しております。 |
| ２．収益及び費用の計上基準     | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。            |

## （貸借対照表に関する注記）

| 前期<br>(2021年 3月 9日現在)                                                                                                                                                                                                   | 当期<br>(2021年 9月 9日現在)                                                                                                                                                                                                   |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．信託財産に係る期首元本額、期中追加<br>設定元本額及び期中一部解約元本額<br>期首元本額 17,527,666,084円<br>期中追加設定元本額 1,154,838,469円<br>期中一部解約元本額 3,862,440,995円<br>２．特定期間の末日における受益権の総数 14,820,063,558口<br>３．１単位（１万口）当たりの純資産額 12,780円<br>（１口当たりの純資産額） (1.2780円) | １．信託財産に係る期首元本額、期中追加<br>設定元本額及び期中一部解約元本額<br>期首元本額 14,820,063,558円<br>期中追加設定元本額 4,159,880,654円<br>期中一部解約元本額 3,766,582,076円<br>２．特定期間の末日における受益権の総数 15,213,362,136口<br>３．１単位（１万口）当たりの純資産額 12,966円<br>（１口当たりの純資産額） (1.2966円) |

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 項目                                                                   | 前期<br>自 2020年 9月10日<br>至 2021年 3月 9日                                                                                                                                                                                                                                        | 当期<br>自 2021年 3月10日<br>至 2021年 9月 9日                                                                                                                                                                                                        |
|----------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．信託財産の運用の<br>指図に係る権限の<br>全部または一部を<br>委託するために要<br>する費用<br>２．分配金の計算過程 | 当ファンドが投資する親投資信託受益証券の純資<br>産総額に対して以下の率を乗じて得た金額<br>年1万分の6.5<br>第125期<br>自 2020年 9月10日<br>至 2020年10月 9日<br>費用控除後の配当等収益額 ー円<br>費用控除後・繰越欠損金補填<br>後の有価証券売買等損益額 ー円<br>収益調整金額 6,642,351,461円<br>分配準備積立金額 2,697,086円<br>当ファンドの分配対象収益額 6,645,048,547円<br>当ファンドの期末残存口数 17,446,939,328口 | 同左<br>第131期<br>自 2021年 3月10日<br>至 2021年 4月 9日<br>費用控除後の配当等収益額 13,747,347円<br>費用控除後・繰越欠損金補填<br>後の有価証券売買等損益額 487,416,302円<br>収益調整金額 5,664,443,876円<br>分配準備積立金額 2,321,676,041円<br>当ファンドの分配対象収益額 8,487,283,566円<br>当ファンドの期末残存口数 14,870,858,514口 |

|                           |                 |                           |                 |
|---------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------|
| 1 万口当たり収益分配対象額            | 3,808円          | 1 万口当たり収益分配対象額            | 5,707円          |
| 1 万口当たり分配金額               | 50円             | 1 万口当たり分配金額               | 100円            |
| 収益分配金金額                   | 87,234,696円     | 収益分配金金額                   | 148,708,585円    |
| 第126期                     |                 | 第132期                     |                 |
| 自 2020年10月10日             |                 | 自 2021年 4月10日             |                 |
| 至 2020年11月 9日             |                 | 至 2021年 5月10日             |                 |
| 費用控除後の配当等収益額              | 8,082,833円      | 費用控除後の配当等収益額              | 48,635,068円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | —円              | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 571,334,556円    |
| 収益調整金額                    | 6,513,041,479円  | 収益調整金額                    | 4,946,092,674円  |
| 分配準備積立金額                  | 3,039,873円      | 分配準備積立金額                  | 2,275,090,656円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 6,524,164,185円  | 当ファンドの分配対象収益額             | 7,841,152,954円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | 17,334,794,071口 | 当ファンドの期末残存口数              | 12,859,997,741口 |
| 1 万口当たり収益分配対象額            | 3,763円          | 1 万口当たり収益分配対象額            | 6,097円          |
| 1 万口当たり分配金額               | 50円             | 1 万口当たり分配金額               | 100円            |
| 収益分配金金額                   | 86,673,970円     | 収益分配金金額                   | 128,599,977円    |
| 第127期                     |                 | 第133期                     |                 |
| 自 2020年11月10日             |                 | 自 2021年 5月11日             |                 |
| 至 2020年12月 9日             |                 | 至 2021年 6月 9日             |                 |
| 費用控除後の配当等収益額              | 8,495,144円      | 費用控除後の配当等収益額              | 61,698,229円     |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 185,421,850円    | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 405,838,149円    |
| 収益調整金額                    | 6,046,083,307円  | 収益調整金額                    | 6,054,610,596円  |
| 分配準備積立金額                  | 700,837円        | 分配準備積立金額                  | 2,703,029,456円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 6,240,701,138円  | 当ファンドの分配対象収益額             | 9,225,176,430円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | 16,282,547,017口 | 当ファンドの期末残存口数              | 14,585,788,025口 |
| 1 万口当たり収益分配対象額            | 3,832円          | 1 万口当たり収益分配対象額            | 6,324円          |
| 1 万口当たり分配金額               | 100円            | 1 万口当たり分配金額               | 100円            |
| 収益分配金金額                   | 162,825,470円    | 収益分配金金額                   | 145,857,880円    |
| 第128期                     |                 | 第134期                     |                 |
| 自 2020年12月10日             |                 | 自 2021年 6月10日             |                 |
| 至 2021年 1月12日             |                 | 至 2021年 7月 9日             |                 |
| 費用控除後の配当等収益額              | 9,063,900円      | 費用控除後の配当等収益額              | —円              |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 831,931,855円    | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | —円              |
| 収益調整金額                    | 5,880,497,663円  | 収益調整金額                    | 6,344,401,977円  |
| 分配準備積立金額                  | 31,847,309円     | 分配準備積立金額                  | 2,975,170,839円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 6,753,340,727円  | 当ファンドの分配対象収益額             | 9,319,572,816円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | 15,835,398,800口 | 当ファンドの期末残存口数              | 14,969,296,046口 |
| 1 万口当たり収益分配対象額            | 4,264円          | 1 万口当たり収益分配対象額            | 6,225円          |
| 1 万口当たり分配金額               | 100円            | 1 万口当たり分配金額               | 100円            |
| 収益分配金金額                   | 158,353,988円    | 収益分配金金額                   | 149,692,960円    |
| 第129期                     |                 | 第135期                     |                 |
| 自 2021年 1月13日             |                 | 自 2021年 7月10日             |                 |
| 至 2021年 2月 9日             |                 | 至 2021年 8月10日             |                 |
| 費用控除後の配当等収益額              | 4,282,152円      | 費用控除後の配当等収益額              | 4,898,505円      |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 679,211,888円    | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | —円              |

|                           |                 |                           |                 |
|---------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------|
| 収益調整金額                    | 5,556,397,038円  | 収益調整金額                    | 6,486,245,518円  |
| 分配準備積立金額                  | 671,829,849円    | 分配準備積立金額                  | 2,801,418,298円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 6,911,720,927円  | 当ファンドの分配対象収益額             | 9,292,562,321円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | 14,947,205,684口 | 当ファンドの期末残存口数              | 15,160,611,706口 |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 4,624円          | 1万口当たり収益分配対象額             | 6,129円          |
| 1万口当たり分配金額                | 100円            | 1万口当たり分配金額                | 100円            |
| 収益分配金金額                   | 149,472,056円    | 収益分配金金額                   | 151,606,117円    |
| 第130期                     |                 | 第136期                     |                 |
| 自 2021年 2月10日             |                 | 自 2021年 8月11日             |                 |
| 至 2021年 3月 9日             |                 | 至 2021年 9月 9日             |                 |
| 費用控除後の配当等収益額              | 6,489,088円      | 費用控除後の配当等収益額              | —円              |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | 1,391,332,108円  | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | —円              |
| 収益調整金額                    | 5,550,790,932円  | 収益調整金額                    | 6,557,732,520円  |
| 分配準備積立金額                  | 1,155,700,681円  | 分配準備積立金額                  | 2,615,954,323円  |
| 当ファンドの分配対象収益額             | 8,104,312,809円  | 当ファンドの分配対象収益額             | 9,173,686,843円  |
| 当ファンドの期末残存口数              | 14,820,063,558口 | 当ファンドの期末残存口数              | 15,213,362,136口 |
| 1万口当たり収益分配対象額             | 5,468円          | 1万口当たり収益分配対象額             | 6,030円          |
| 1万口当たり分配金額                | 100円            | 1万口当たり分配金額                | 100円            |
| 収益分配金金額                   | 148,200,635円    | 収益分配金金額                   | 152,133,621円    |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 項目                       | 期別<br>前期<br>自 2020年 9月10日<br>至 2021年 3月 9日                                                                                                                                       | 当期<br>自 2021年 3月10日<br>至 2021年 9月 9日 |
|--------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針          | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資して運用することを目的としております。                                                                               | 同左                                   |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権および金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（有価証券に関する注記）」に記載しております。<br>これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスクに晒されております。<br>目論見書の記述に合わせて、主要なリスク項目を記載しております。 | 同左                                   |

|                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |    |
|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| 3.金融商品に係るリスク管理体制          | <p>委託会社においては、パフォーマンスおよびリスクの状況は社内で一元的に管理しています。パフォーマンス評価およびリスク管理を行う上での分析の基礎となるデータは各種のリスクモデル等によりデータベース化しています。当ファンドのリスク分析とパフォーマンスの要因分析の結果は、運用責任者、経営陣を主要参加メンバーとするパフォーマンスレビュー委員会において報告され、運用計画と運用成果との整合性を検証することにより、当ファンドの品質の維持管理に努めています。</p> <p>また、コンプライアンス部門において、信託約款や運用計画書の遵守状況ならびに執行・組入れに係る管理状況を審査し、必要に応じて速やかに関連部門へ注意・勧告を行っております。</p> | 同左 |
| 4.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。</p>                                                                                                                                                                                                      | 同左 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 前期<br>(2021年 3月 9日現在)                                                                                                                                                                                                                                    | 当期<br>(2021年 9月 9日現在)                                                                                             |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価およびその差額<br/>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。</p> <p>2.時価の算定方法<br/>(1)親投資信託受益証券<br/>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権および金銭債務<br/>これらの科目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> | <p>1.貸借対照表計上額、時価およびその差額<br/>同左</p> <p>2.時価の算定方法<br/>(1)親投資信託受益証券<br/>同左</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権および金銭債務<br/>同左</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

前期(自 2020年 9月10日 至 2021年 3月 9日)

（単位：円）

| 種類        | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|--------------------|
| 親投資信託受益証券 | 1,436,995,666      |
| 合計        | 1,436,995,666      |

当期(自 2021年 3月10日 至 2021年 9月 9日)

（単位：円）

| 種類        | 最終計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|--------------------|
| 親投資信託受益証券 | 47,613,009         |
| 合計        | 47,613,009         |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 前期<br>自 2020年 9月10日<br>至 2021年 3月 9日 | 当期<br>自 2021年 3月10日<br>至 2021年 9月 9日 |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 該当事項はありません。                          | 同左                                   |

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## １）株式（2021年 9月 9日現在）

該当事項はありません。

## 2）株式以外の有価証券（2021年 9月 9日現在）

（単位：円）

| 種類        | 通貨     | 銘柄                                    | 券面総額          | 評価額                      | 備考 |
|-----------|--------|---------------------------------------|---------------|--------------------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本円    | A L A M C O ハリス グローバル バリューストックマザーファンド | 6,706,057,599 | 19,611,865,448           |    |
|           | 日本円 小計 | 銘柄数：1<br>組入時価比率：99.4%                 | 6,706,057,599 | 19,611,865,448<br>100.0% |    |
|           | 合計     |                                       |               | 19,611,865,448           |    |

(注1)親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)組入時価比率は、左より純資産総額に対する評価額の割合、および、合計金額に対する評価額の割合であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「A L A M C O ハリス グローバル バリューストックマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

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。

A L A M C O ハリス グローバル バリューストックマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

|      | (2021年 3月 9日現在) | (2021年 9月 9日現在) |
|------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 |                 |                 |
| 流動資産 |                 |                 |
| 預金   | 699,840,467     | 541,709,494     |

|             | （2021年 3月 9日現在） | （2021年 9月 9日現在） |
|-------------|-----------------|-----------------|
| コール・ローン     | 189,691,182     | 308,165,162     |
| 株式          | 35,286,368,763  | 33,346,544,264  |
| 社債券         | -               | 112,501,719     |
| 派生商品評価勘定    | 303,302         | 224             |
| 未収入金        | 307,054,240     | 97,083,798      |
| 未収配当金       | 27,079,978      | 4,862,135       |
| 未収利息        | -               | 988,176         |
| 流動資産合計      | 36,510,337,932  | 34,411,854,972  |
| 資産合計        | 36,510,337,932  | 34,411,854,972  |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    | 3,231           | 7,760           |
| 未払金         | 141,980,220     | 86,494,003      |
| 未払利息        | 436             | 633             |
| 流動負債合計      | 141,983,887     | 86,502,396      |
| 負債合計        | 141,983,887     | 86,502,396      |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 元本          | 13,355,985,343  | 11,737,036,529  |
| 剰余金         |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 23,012,368,702  | 22,588,316,047  |
| 元本等合計       | 36,368,354,045  | 34,325,352,576  |
| 純資産合計       | 36,368,354,045  | 34,325,352,576  |
| 負債純資産合計     | 36,510,337,932  | 34,411,854,972  |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | <p>株式</p> <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、監査対象ファンドの計算期間末日の金融商品取引所または店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、また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>社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、監査対象ファンドの計算期間末日の金融商品取引業者等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、または価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法  | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、監査対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。</p>                                                                                                                                                                                                       |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における監査対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>                                                                                                                                                                                                                            |
| 4. 収益及び費用の計上基準         | <p>受取配当金</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

|  |                                                                    |
|--|--------------------------------------------------------------------|
|  | 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合は入金日基準で計上しております。 |
|  | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。                                       |
|  | 為替差損益<br>約定日基準で計上しております。                                           |

## （貸借対照表に関する注記）

| （2021年 3月 9日現在）                                    |                 | （2021年 9月 9日現在）                                    |                 |
|----------------------------------------------------|-----------------|----------------------------------------------------|-----------------|
| 1. 監査対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 |                 | 1. 監査対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 |                 |
| 期首元本額                                              | 17,029,190,985円 | 期首元本額                                              | 13,355,985,343円 |
| 期中追加設定元本額                                          | 2,168,633円      | 期中追加設定元本額                                          | 965,155,699円    |
| 期中一部解約元本額                                          | 3,675,374,275円  | 期中一部解約元本額                                          | 2,584,104,513円  |
| 2. 元本の内訳                                           |                 | 2. 元本の内訳                                           |                 |
| ハリス世界株ファンド（毎月決算型）                                  | 6,872,289,181円  | ハリス世界株ファンド（毎月決算型）                                  | 6,706,057,599円  |
| ハリス世界株ファンド（資産成長型）                                  | 71,003,255円     | ハリス世界株ファンド（資産成長型）                                  | 100,474,357円    |
| A L A M C O ハリス グローバル                              | 1,254,301,207円  | A L A M C O ハリス グローバル                              | 1,333,975,100円  |
| バリュー株ファンド2007（適格機関投資家専用）                           |                 | バリュー株ファンド2007（適格機関投資家専用）                           |                 |
| A L A M C O ハリス 年金グローバル                            | 5,158,391,700円  | A L A M C O ハリス 年金グローバル                            | 3,596,529,473円  |
| バリュー株ファンド2007（適格機関投資家専用）                           |                 | バリュー株ファンド2007（適格機関投資家専用）                           |                 |
| 3. 監査対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数                       | 13,355,985,343口 | 3. 監査対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数                       | 11,737,036,529口 |
| 4. 1単位（1万口）当たりの純資産額                                | 27,230円         | 4. 1単位（1万口）当たりの純資産額                                | 29,245円         |
| （1口当たりの純資産額）                                       | (2.7230円)       | （1口当たりの純資産額）                                       | (2.9245円)       |

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

| 項目              | 期別<br>自 2020年 9月10日<br>至 2021年 3月 9日                                                               | 自 2021年 3月10日<br>至 2021年 9月 9日 |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資して運用することを目的としております。 | 同左                             |

|                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |           |
|--------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|
| <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権および金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（有価証券に関する注記）」に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>目論見書の記述に合わせて、主要なリスク項目を記載しております。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                  | <p>同左</p> |
| <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>        | <p>信託財産の運用の指図に係る権限の一部を委託しているハリス・アソシエイツ社（以下、投資顧問会社という。）においては、運用委託契約に基づくガイドラインに定められた事項にしたがって運用を行い、売買執行後、ポートフォリオの内容について分析を行い、ガイドラインに抵触していないかのチェックを行っています。また、投資顧問会社は、定期的にレポートを作成し、当ファンドの運用状況に関する情報を委託会社へフィードバックしています。</p> <p>委託会社においては、パフォーマンスおよびリスクの状況は社内で一元的に管理しています。パフォーマンス評価およびリスク管理を行う上での分析の基礎となるデータは各種のリスクモデル等によりデータベース化しています。当ファンドのリスク分析とパフォーマンスの要因分析の結果は、運用責任者、経営陣を主要参加メンバーとするパフォーマンスレビュー委員会において報告され、運用計画と運用成果との整合性を検証することにより、当ファンドの品質の維持管理に努めています。</p> <p>また、コンプライアンス部門において、信託約款や運用計画書の遵守状況ならびに執行・組入れに係る管理状況を審査し、必要に応じて速やかに関連部門へ注意・勧告を行っております。</p> | <p>同左</p> |

|                           |                                                                                                                                                                                                                                        |    |
|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| 4.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。</p> <p>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または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p> | 同左 |
|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|

## 金融商品の時価等に関する事項

| （2021年 3月 9日現在）                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | （2021年 9月 9日現在）                                                                                                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>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。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>（１）株式</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>（２）派生商品評価勘定</p> <p>「（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。</p> <p>（３）コール・ローン等の金銭債権および金銭債務</p> <p>これらの科目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> | <p>1.貸借対照表計上額、時価およびその差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>（１）株式、社債券</p> <p>同左</p> <p>（２）派生商品評価勘定</p> <p>同左</p> <p>（３）コール・ローン等の金銭債権および金銭債務</p> <p>同左</p> |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（自 2020年 9月10日 至 2021年 3月 9日）

（単位：円）

| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|----|-------------------|
|----|-------------------|

|    |               |
|----|---------------|
| 株式 | 8,909,915,197 |
| 合計 | 8,909,915,197 |

(自 2021年 3月10日 至 2021年 9月 9日)

(単位：円)

| 種類  | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----|-------------------|
| 株式  | 1,261,632,044     |
| 社債券 | 12,302,060        |
| 合計  | 1,273,934,104     |

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から有価証券報告書における開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2021年 3月 9日現在)

(単位：円)

| 区分        | 種類     | 契約額等        |       | 時価          | 評価損益    |
|-----------|--------|-------------|-------|-------------|---------|
|           |        |             | うち1年超 |             |         |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 |             |       |             |         |
|           | 買建     | 210,959,032 | -     | 211,253,313 | 294,281 |
|           | 米ドル    | 202,334,638 | -     | 202,632,150 | 297,512 |
|           | 香港ドル   | 8,624,394   | -     | 8,621,163   | 3,231   |
|           | 売建     | 210,959,032 | -     | 210,953,242 | 5,790   |
|           | 米ドル    | 8,624,394   | -     | 8,623,604   | 790     |
|           | ユーロ    | 126,968,100 | -     | 126,968,100 | -       |
|           | 英ポンド   | 75,366,538  | -     | 75,361,538  | 5,000   |
| 合計        |        | 421,918,064 | -     | 422,206,555 | 300,071 |

(2021年 9月 9日現在)

(単位：円)

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|

| 区分        | 種類       | 契約額等       | うち1年超 | 時価         | 評価損益  |
|-----------|----------|------------|-------|------------|-------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引   |            |       |            |       |
|           | 買建       | 27,267,631 | -     | 27,259,871 | 7,760 |
|           | 米ドル      | 2,426      | -     | 2,411      | 15    |
|           | スイスフラン   | 14,128,514 | -     | 14,126,748 | 1,766 |
|           | 香港ドル     | 13,136,691 | -     | 13,130,712 | 5,979 |
|           | 売建       | 27,267,631 | -     | 27,267,407 | 224   |
|           | 米ドル      | 27,265,205 | -     | 27,264,981 | 224   |
|           | 南アフリカランド | 2,426      | -     | 2,426      | -     |
| 合計        |          | 54,535,262 | -     | 54,527,278 | 7,536 |

#### 時価の算定方法

##### 為替予約取引

- １）計算期間末日に対顧客先物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。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場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。

計算期間末日において当該日の対顧客先物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。

- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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たレートを用いております。
- ・計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値を用いております。

- ２）計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### （関連当事者との取引に関する注記）

|                                |                                |
|--------------------------------|--------------------------------|
| 自 2020年 9月10日<br>至 2021年 3月 9日 | 自 2021年 3月10日<br>至 2021年 9月 9日 |
| 該当事項はありません。                    | 同左                             |

#### 附属明細表

##### 第１ 有価証券明細表

##### １）株式（2021年 9月 9日現在）

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 |    | 備考 |
|----|----|-----|-----|----|----|
|    |    |     | 単価  | 金額 |    |

|        |                                     |           |          |                  |       |
|--------|-------------------------------------|-----------|----------|------------------|-------|
| 米ドル    | HALLIBURTON CORP                    | 186,700   | 19.35    | 3,612,645.00     |       |
|        | GENERAL DYNAMICS CORP               | 22,400    | 204.40   | 4,578,560.00     |       |
|        | GENERAL MOTORS CO                   | 100,100   | 48.97    | 4,901,897.00     |       |
|        | BOOKING HOLDINGS INC                | 2,690     | 2,315.95 | 6,229,905.50     |       |
|        | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS           | 43,100    | 122.76   | 5,290,956.00     |       |
|        | ALPHABET INC-CL A                   | 7,315     | 2,873.82 | 21,021,993.30    |       |
|        | CHARTER COMMUNICATIONS INC          | 9,957     | 799.79   | 7,963,509.03     |       |
|        | COMCAST CORP-CL A                   | 51,900    | 60.14    | 3,121,266.00     |       |
|        | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR        | 18,800    | 170.71   | 3,209,348.00     |       |
|        | CONSTELLATION BRANDS INC-A          | 11,950    | 216.97   | 2,592,791.50     |       |
|        | KEURIG DR PEPPER INC                | 273,700   | 35.29    | 9,658,873.00     |       |
|        | HCA HEALTHCARE INC                  | 42,365    | 254.43   | 10,778,926.95    |       |
|        | HUMANA INC                          | 17,670    | 413.50   | 7,306,545.00     |       |
|        | BANK OF AMERICA CORP                | 171,600   | 40.78    | 6,997,848.00     |       |
|        | CITIGROUP INC                       | 75,300    | 70.04    | 5,274,012.00     |       |
|        | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B         | 41,300    | 279.34   | 11,536,742.00    |       |
|        | MOODY'S CORP                        | 5,335     | 381.94   | 2,037,649.90     |       |
|        | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP        | 128,600   | 54.81    | 7,048,566.00     |       |
|        | AUTOMATIC DATA PROCESS              | 11,500    | 205.13   | 2,358,995.00     |       |
|        | FISERV INC                          | 59,100    | 117.00   | 6,914,700.00     |       |
|        | WORKDAY INC-CLASS A                 | 7,800     | 272.20   | 2,123,160.00     |       |
|        | GRUPO TELEvisa SA-SPON ADR          | 308,900   | 12.52    | 3,867,428.00     |       |
|        | LIBERTY GLOBAL GROUP-A              | 243,974   | 29.51    | 7,199,672.74     |       |
| 米ドル 小計 | 銘柄数：23                              | 1,842,056 |          | 145,625,989.92   |       |
|        | 組入時価比率：46.8%                        |           |          | (16,052,352,868) | 48.1% |
| ユーロ    | CNH INDUSTRIAL NV                   | 562,700   | 13.70    | 7,708,990.00     |       |
|        | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG         | 56,500    | 78.61    | 4,441,465.00     |       |
|        | DAIMLER AG-REG                      | 147,544   | 68.71    | 10,137,748.24    |       |
|        | PROSUS NV                           | 68,315    | 78.45    | 5,359,311.75     |       |
|        | DANONE SA                           | 47,000    | 59.60    | 2,801,200.00     |       |
|        | HENKEL AG & CO KGAA                 | 33,600    | 74.80    | 2,513,280.00     |       |
|        | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG          | 5,500     | 80.50    | 442,750.00       |       |
|        | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | 119,000   | 65.40    | 7,782,600.00     |       |
|        | FRESENIUS SE & CO KGAA              | 83,800    | 42.98    | 3,602,143.00     |       |

|                |                                |           |            |                                   |  |
|----------------|--------------------------------|-----------|------------|-----------------------------------|--|
| ユーロ 小計         | BAYER AG                       | 230,200   | 46.50      | 10,704,300.00                     |  |
|                | BNP PARIBAS                    | 202,665   | 53.50      | 10,842,577.50                     |  |
|                | ALLIANZ SE                     | 52,545    | 196.58     | 10,329,296.10                     |  |
|                | SAP SE                         | 41,200    | 124.20     | 5,117,040.00                      |  |
|                | 銘柄数：13                         | 1,650,569 |            | 81,782,701.59<br>(10,648,925,574) |  |
|                | 組入時価比率：31.0%                   |           |            | 31.9%                             |  |
| 英ポンド           | GLENCORE PLC                   | 2,179,500 | 3.34       | 7,283,889.00                      |  |
|                | COMPASS GROUP PLC              | 152,200   | 14.42      | 2,195,485.00                      |  |
|                | WPP GROUP PLC                  | 284,298   | 9.81       | 2,790,100.57                      |  |
|                | 銘柄数：3                          | 2,615,998 |            | 12,269,474.57<br>(1,860,911,208)  |  |
|                | 組入時価比率：5.4%                    |           |            | 5.6%                              |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
| スイスフラン         | HOLCIM LTD                     | 78,915    | 47.34      | 3,735,836.10                      |  |
|                | CIE FINANCIERE RICHEMON-REG    | 12,150    | 104.80     | 1,273,320.00                      |  |
|                | NOVARTIS AG-REG                | 61,600    | 81.15      | 4,998,840.00                      |  |
|                | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG     | 1,100,484 | 9.66       | 10,630,675.44                     |  |
|                | JULIUS BAER GROUP LTD          | 138,310   | 62.78      | 8,683,101.80                      |  |
|                | 銘柄数：5                          | 1,391,459 |            | 29,321,773.34<br>(3,506,004,438)  |  |
| スイスフラン<br>小計   | 組入時価比率：10.2%                   |           |            | 10.5%                             |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
| 香港ドル           | ALIBABA GROUP HOLDING LTD      | 142,500   | 170.90     | 24,353,250.00                     |  |
| 香港ドル 小計        | 銘柄数：1                          | 142,500   |            | 24,353,250.00<br>(345,085,552)    |  |
|                | 組入時価比率：1.0%                    |           |            | 1.0%                              |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
| 韓国ウォン          | NAVER CORP                     | 9,375     | 409,500.00 | 3,839,062,500.00                  |  |
|                | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD-PFD | 35,000    | 72,000.00  | 2,520,000,000.00                  |  |
|                | 銘柄数：2                          | 44,375    |            | 6,359,062,500.00<br>(600,295,500) |  |
| 韓国ウォン 小計       | 組入時価比率：1.7%                    |           |            | 1.8%                              |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |
| 南アフリカランド       | NASPERS LTD-N SHS              | 16,302    | 2,635.49   | 42,963,757.98                     |  |
| 南アフリカランド<br>小計 | 銘柄数：1                          | 16,302    |            | 42,963,757.98<br>(332,969,124)    |  |
|                |                                |           |            |                                   |  |

|     |             |           |  |                                    |  |
|-----|-------------|-----------|--|------------------------------------|--|
|     | 組入時価比率：1.0% |           |  | 1.0%                               |  |
| 合 計 |             | 7,703,259 |  | 33,346,544,264<br>(33,346,544,264) |  |

(注1)外貨建有価証券の種類別通貨計における( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券の邦貨換算額であります。

(注3)組入時価比率は、左より純資産総額に対する評価額（邦貨換算額）の割合、および、合計金額に対する評価額（邦貨換算額）の割合であります。

## 2）株式以外の有価証券（2021年 9月 9日現在）

| 種類  | 通貨        | 銘柄                                       | 券面総額       | 評価額                              | 備考 |
|-----|-----------|------------------------------------------|------------|----------------------------------|----|
| 社債券 | スイスフラン    | CSG GUERNSEY VII LTD-A-3.0%-<br>21/11/12 | 400,000.00 | 450,544.84                       |    |
|     |           | CSG GUERNSEY VII LTD-B-3.0%-<br>21/11/12 | 438,000.00 | 490,341.00                       |    |
|     | スイスフラン 小計 | 銘柄数：2                                    | 838,000.00 | 940,885.84<br><br>(112,501,719)  |    |
|     |           | 組入時価比率：0.3%                              |            | 100.0%                           |    |
| 合計  |           |                                          |            | 112,501,719<br><br>(112,501,719) |    |

(注1)外貨建有価証券の種類別通貨計における( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券の邦貨換算額であります。

(注3)組入時価比率は、左より純資産総額に対する評価額（邦貨換算額）の割合、および、合計金額に対する評価額（邦貨換算額）の割合であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当表に記載すべき内容は、「（デリバティブ取引等に関する注記）取引の時価等に関する事項」にて開示しておりますので、記載を省略しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## ハリス世界株ファンド（毎月決算型）

2021年10月29日

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 20,540,173,778円 |
| 負債総額           | 55,689,378円     |
| 純資産総額（ - ）     | 20,484,484,400円 |
| 発行済口数          | 15,083,708,103口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3581円         |
| （1万口当たり純資産額）   | （13,581円）       |

## （参考）ALAMCO ハリス グローバル バリュース株マザーファンド

2021年10月29日

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 36,044,041,093円 |
| 負債総額           | 220,400,767円    |
| 純資産総額（ - ）     | 35,823,640,326円 |
| 発行済口数          | 11,572,030,445口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 3.0957円         |
| （1万口当たり純資産額）   | （30,957円）       |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## 1．名義書換の手続等

委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、該当事項はありません。

## 2．受益者に対する特典

ありません。

## 3．譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## 4．受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前項の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

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

5．受益権の譲渡の対抗要件

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

6．受益権の再分割

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

7．質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

資本金の額等（2021年10月末現在）

- 1）資本金：3,000百万円
- 2）発行可能株式総数：64,000株
- 3）発行済株式総数：32,000株
- 4）最近5年における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### 委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

委託会社の経営にあたる取締役は、株主総会によって選任されます。その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

取締役全員で構成される取締役会は、委託会社の経営の基本方針を決定するとともに、代表取締役を選任します。代表取締役は会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、常勤取締役および役付執行役員によって構成される経営会議が、取締役会から委任を受けた事項を決定します。

###### ・投資運用の意思決定機構

- 1）ファンドの運用に際しては、社内規程等において以下に述べる意思決定プロセスにかかわる組織体および権限、責任等を定め、これに基づき業務を執行します。

また、業務執行の適切性については、適宜、内部監査部門による評価等によりその実効性を確保しています。

- a．ファンダメンタルズ分析会議でエコノミスト、アナリストおよびファンドマネジャー等による投資環境分析を行い、これを踏まえて資産別（株式および債券）運用委員会を開催し、個別資産および各プロダクトの投資戦略を決定します。

- b．投資政策委員会では、基本アセットアロケーション、ファンドの具体的な投資方針を決定します。

- 2）運用各部において、ファンドの具体的な投資方針に基づく運用を行います。

- 3）パフォーマンスレビュー委員会でパフォーマンス分析およびリスク分析、コンプライアンス委員会で法令遵守状況の審査を行い、これらを運用の意思決定プロセスにフィードバックします。

（注）委員会および部門の名称等は変更される場合があります。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である当社は、証券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）ならびに受益権の募集または私募（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業務を行っています。

2021年10月末現在、当社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は以下のとおりです。

| 種類        | 本数 | 純資産総額(百万円) |
|-----------|----|------------|
| 単位型株式投資信託 | 18 | 35,161     |
| 追加型株式投資信託 | 75 | 497,971    |
| 合計        | 93 | 533,132    |

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1.財務諸表の作成方法について

当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

#### 2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）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）

| 期別       |          | 第35期<br>(2020年3月31日) |           | 第36期<br>(2021年3月31日) |           |
|----------|----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| 科目       | 注記<br>番号 | 内訳                   | 金額        | 内訳                   | 金額        |
| （資産の部）   |          |                      |           |                      |           |
| 流動資産     |          |                      |           |                      |           |
| 現金・預金    |          |                      | 3,890,445 |                      | 4,001,281 |
| 前払費用     | 2        |                      | 73,730    |                      | 78,347    |
| 未収委託者報酬  |          |                      | 262,142   |                      | 312,288   |
| 未収運用受託報酬 | 2        |                      | 243,265   |                      | 431,164   |
| 未収還付法人税等 |          |                      | -         |                      | 1,441     |
| 未収収益     |          |                      | 17,228    |                      | 19,999    |
| その他      |          |                      | 3,359     |                      | 1,594     |
| 流動資産計    |          |                      | 4,490,171 |                      | 4,846,117 |
| 固定資産     |          |                      |           |                      |           |
| 有形固定資産   |          |                      |           |                      |           |
| 建物       | 1        | 7,437                |           | 6,579                |           |
| 器具備品     | 1        | 38,113               | 45,551    | 27,700               | 34,280    |
| 無形固定資産   |          |                      |           |                      |           |
| 電話加入権    |          | 2,776                |           | 2,776                |           |
| ソフトウェア   |          | 8,564                | 11,340    | 14,134               | 16,910    |
| 投資その他の資産 |          |                      |           |                      |           |
| 投資有価証券   |          | 14,637               |           | 19,642               |           |
| 関係会社株式   |          | 38,291               |           | 38,291               |           |
| 長期差入保証金  | 2        | 35,819               |           | 35,215               |           |
| 長期前払費用   |          | 582                  |           | -                    |           |
| 繰延税金資産   |          | 63,048               | 152,378   | 65,334               | 158,483   |
| 固定資産計    |          |                      | 209,271   |                      | 209,674   |
| 資産合計     |          |                      | 4,699,442 |                      | 5,055,792 |

（単位：千円）

| 期別           |          | 第35期<br>(2020年3月31日) |           | 第36期<br>(2021年3月31日) |           |
|--------------|----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| 科目           | 注記<br>番号 | 内訳                   | 金額        | 内訳                   | 金額        |
| (負債の部)       |          |                      |           |                      |           |
| 流動負債         |          |                      |           |                      |           |
| 預り金          |          |                      | 8,933     |                      | 110,631   |
| 未払金          |          |                      |           |                      |           |
| 未払手数料        |          | 85,810               |           | 99,279               |           |
| その他未払金       |          | 34,439               | 120,250   | 17,762               | 117,042   |
| 未払費用         | 2        |                      | 315,689   |                      | 458,062   |
| 未払法人税等       |          |                      | 13,836    |                      | 51,773    |
| 未払消費税等       |          |                      | 44,486    |                      | 62,038    |
| 賞与引当金        |          |                      | 142,895   |                      | 152,553   |
| 流動負債計        |          |                      | 646,091   |                      | 952,102   |
| 負債合計         |          |                      | 646,091   |                      | 952,102   |
| (純資産の部)      |          |                      |           |                      |           |
| 株主資本         |          |                      |           |                      |           |
| 資本金          |          |                      | 3,000,000 |                      | 3,000,000 |
| 資本剰余金        |          |                      |           |                      |           |
| 資本準備金        |          | 524,000              | 524,000   | 524,000              | 524,000   |
| 利益剰余金        |          |                      |           |                      |           |
| 利益準備金        |          | 226,000              |           | 226,000              |           |
| その他利益剰余金     |          |                      |           |                      |           |
| 繰越利益剰余金      |          | 303,249              | 529,249   | 352,419              | 578,419   |
| 株主資本合計       |          |                      | 4,053,249 |                      | 4,102,419 |
| 評価・換算差額等     |          |                      |           |                      |           |
| その他有価証券評価差額金 |          |                      | 101       |                      | 1,270     |
| 評価・換算差額等合計   |          |                      | 101       |                      | 1,270     |
| 純資産合計        |          |                      | 4,053,350 |                      | 4,103,690 |
| 負債・純資産合計     |          |                      | 4,699,442 |                      | 5,055,792 |

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

| 期別 |          | 第35期<br>(自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日) |    | 第36期<br>(自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日) |    |
|----|----------|----------------------------------------|----|----------------------------------------|----|
| 科目 | 注記<br>番号 | 内訳                                     | 金額 | 内訳                                     | 金額 |

|           |   |           |           |           |           |
|-----------|---|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 営業収益      |   |           |           |           |           |
| 委託者報酬     |   | 2,956,200 |           | 2,741,899 |           |
| 運用受託報酬    |   | 1,434,377 |           | 1,690,173 |           |
| その他営業収益   |   | 155,983   | 4,546,561 | 128,348   | 4,560,421 |
| 営業費用      | 1 |           |           |           |           |
| 支払手数料     |   |           | 866,504   |           | 788,690   |
| 広告宣伝費     |   |           | 12,166    |           | 10,012    |
| 公告費       |   |           | 200       |           | 200       |
| 調査費       |   |           |           |           |           |
| 調査費       |   | 519,037   |           | 546,351   |           |
| 委託調査費     |   | 1,590,494 |           | 1,590,245 |           |
| 図書費       |   | 1,276     | 2,110,808 | 1,232     | 2,137,829 |
| 営業雑経費     |   |           |           |           |           |
| 通信費       |   | 3,081     |           | 5,067     |           |
| 印刷費       |   | 15,011    |           | 15,746    |           |
| 協会費       |   | 5,210     |           | 4,827     |           |
| 諸会費       |   | 2,966     |           | 2,914     |           |
| その他営業雑経費  |   | 367       | 26,637    | 210       | 28,766    |
| 営業費用計     |   |           | 3,016,316 |           | 2,965,499 |
| 一般管理費     | 1 |           |           |           |           |
| 給料        |   |           |           |           |           |
| 役員報酬      |   | 82,520    |           | 87,846    |           |
| 給料・手当     |   | 755,499   |           | 752,736   |           |
| 賞与        |   | 18,951    | 856,971   | 19,260    | 859,843   |
| 交際費       |   |           | 3,954     |           | 927       |
| 寄付金       |   |           | 4,256     |           | 9,480     |
| 旅費交通費     |   |           | 17,747    |           | 951       |
| 租税公課      |   |           | 35,032    |           | 35,772    |
| 不動産賃借料    |   |           | 102,155   |           | 98,451    |
| 退職給付費用    |   |           | 44,515    |           | 46,770    |
| 福利厚生費     |   |           | 125,057   |           | 132,280   |
| 賞与引当金繰入   |   |           | 123,800   |           | 132,065   |
| 固定資産減価償却費 |   |           | 20,043    |           | 19,704    |
| 諸経費       |   |           | 120,249   |           | 107,371   |
| 一般管理費計    |   |           | 1,453,784 |           | 1,443,620 |
| 営業利益      |   |           | 76,459    |           | 151,301   |
| 営業外収益     | 1 |           |           |           |           |
| 受取配当金     |   |           | 42,951    |           | 40,390    |
| 受取利息      |   |           | 19        |           | 11        |
| 受取賃借料     |   |           | 13,082    |           | 12,011    |
| 雑収入       |   |           | 952       |           | 467       |

|              |   |        |         |        |         |
|--------------|---|--------|---------|--------|---------|
| 営業外収益計       |   |        | 57,006  |        | 52,880  |
| 営業外費用        |   |        |         |        |         |
| 雑損           |   |        | 896     |        | 140     |
| 営業外費用計       |   |        | 896     |        | 140     |
| 経常利益         |   |        | 132,569 |        | 204,041 |
| 特別利益         |   |        |         |        |         |
| 投資有価証券売却益    |   |        | 2,139   |        | 533     |
| 特別利益計        |   |        | 2,139   |        | 533     |
| 特別損失         |   |        |         |        |         |
| 固定資産除却損      | 2 |        | 80      |        | 31      |
| 投資有価証券売却損    |   |        | 0       |        | -       |
| 特別損失計        |   |        | 81      |        | 31      |
| 税引前当期純利益     |   |        | 134,627 |        | 204,544 |
| 法人税、住民税及び事業税 |   | 31,932 |         | 58,176 |         |
| 法人税等調整額      |   | 1,851  | 33,783  | 2,802  | 55,373  |
| 当期純利益        |   |        | 100,844 |        | 149,170 |

## ( 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      |           |                 |           |              |             |            | 評価・換算差額等             |                            | 純資産<br>合計 |
|-------------------------|-----------|-----------|-----------------|-----------|--------------|-------------|------------|----------------------|----------------------------|-----------|
|                         | 資本金       | 資本剰余金     |                 | 利益剰余金     |              |             | 株主資本<br>合計 | その他有<br>価証券評<br>価差額金 | 評価・<br>換<br>算差額<br>等<br>合計 |           |
|                         |           | 資本準<br>備金 | 資本剰<br>余<br>金合計 | 利益準<br>備金 | その他利<br>益剰余金 | 利益剰余<br>金合計 |            |                      |                            |           |
|                         |           |           |                 |           | 繰越利益<br>剰余金  |             |            |                      |                            |           |
| 当期首残高                   | 3,000,000 | 524,000   | 524,000         | 226,000   | 402,404      | 628,404     | 4,152,404  | 1,716                | 1,716                      | 4,154,120 |
| 当期変動額                   |           |           |                 |           |              |             |            |                      |                            |           |
| 剰余金の配当                  |           |           |                 |           | 200,000      | 200,000     | 200,000    |                      |                            | 200,000   |
| 当期純利益                   |           |           |                 |           | 100,844      | 100,844     | 100,844    |                      |                            | 100,844   |
| 株主資本以外の項目<br>の当期変動額（純額） |           |           |                 |           |              |             |            | 1,614                | 1,614                      | 1,614     |
| 当期変動額合計                 |           |           |                 |           | 99,155       | 99,155      | 99,155     | 1,614                | 1,614                      | 100,769   |
| 当期末残高                   | 3,000,000 | 524,000   | 524,000         | 226,000   | 303,249      | 529,249     | 4,053,249  | 101                  | 101                        | 4,053,350 |

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 |       |       |  | 評価・換算差額等 |  |  |
|--|------|-------|-------|--|----------|--|--|
|  |      | 資本剰余金 | 利益剰余金 |  |          |  |  |

|                         | 資本金       | 資本準備金   | 資本剰余金合計 | 利益準備金   | その他利益剰余金<br>繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | 株主資本合計    | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | 純資産合計     |
|-------------------------|-----------|---------|---------|---------|---------------------|---------|-----------|--------------|------------|-----------|
| 当期首残高                   | 3,000,000 | 524,000 | 524,000 | 226,000 | 303,249             | 529,249 | 4,053,249 | 101          | 101        | 4,053,350 |
| 当期変動額                   |           |         |         |         |                     |         |           |              |            |           |
| 剰余金の配当                  |           |         |         |         | 100,000             | 100,000 | 100,000   |              |            | 100,000   |
| 当期純利益                   |           |         |         |         | 149,170             | 149,170 | 149,170   |              |            | 149,170   |
| 株主資本以外の項目<br>の当期変動額（純額） |           |         |         |         |                     |         |           | 1,168        | 1,168      | 1,168     |
| 当期変動額合計                 |           |         |         |         | 49,170              | 49,170  | 49,170    | 1,168        | 1,168      | 50,339    |
| 当期末残高                   | 3,000,000 | 524,000 | 524,000 | 226,000 | 352,419             | 578,419 | 4,102,419 | 1,270        | 1,270      | 4,103,690 |

## 注記事項

## 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<br/>移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<br/>時価のあるもの<br/>期末日の市場価格等に基づく時価法<br/>（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）<br/>時価のないもの<br/>移動平均法による原価法</p>                                                                         |
| 2．固定資産の減価償却方法           | <p>(1) 有形固定資産<br/>定率法（ただし、1998年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については定額法）を採用しております。<br/>なお、主な耐用年数は、建物6年～24年、器具備品4年～15年であります。</p> <p>(2) 無形固定資産<br/>定額法を採用しております。<br/>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）に基づいております。</p> |
| 3．引当金の計上基準              | <p>賞与引当金</p> <p>従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち、当期の負担額を計上しております。</p>                                                                                                                                                                       |
| 4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | <p>外貨建金銭債権債務は、決算日の直物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。</p>                                                                                                                                                                                  |
|                         | 消費税等の処理方法                                                                                                                                                                                                                                  |

５．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

「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）
- ・「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 2021年3月26日）

### (1)概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### (2)適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### (3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用により、繰越利益剰余金の期首残高に与える影響はありません。

## 注記事項

（貸借対照表関係）

（単位：千円）

| 項目               | 第35期<br>(2020年3月31日) | 第36期<br>(2021年3月31日) |
|------------------|----------------------|----------------------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 |                      |                      |
| 建物               | 40,268               | 41,126               |
| 器具備品             | 109,998              | 125,161              |
| 2 関係会社に対する資産及び負債 |                      |                      |
| 前払費用             | 6,106                | 6,106                |
| 未収運用受託報酬         | 4,099                | 4,339                |
| 長期差入保証金          | 39,651               | 39,651               |
| 未払費用             | 4,834                | 7,589                |

（損益計算書関係）

（単位：千円）

| 項目              | 第35期<br>(自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日) | 第36期<br>(自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日) |
|-----------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 1 関係会社との取引に係るもの |                                        |                                        |
| 営業費用            | 136,707                                | 128,524                                |
| 一般管理費           | 241,420                                | 224,261                                |
| 受取配当金           | 42,840                                 | 40,290                                 |

|              |    |    |
|--------------|----|----|
| 2 固定資産除却損の内訳 |    |    |
| 器具備品         | 80 | 31 |

## （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. 発行済株式に関する事項

（単位：株）

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|-------|---------|----|----|--------|
| 発行済株式 |         |    |    |        |
| 普通株式  | 32,000  | -  | -  | 32,000 |
| 合計    | 32,000  | -  | -  | 32,000 |

## 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（円）   | 1株当たり配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 2019年6月19日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 200,000,000 | 6,250円      | 2019年3月31日 | 2019年6月20日 |

## （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 | 配当金の<br>総額（円） | 配当の原資 | 1株当たり配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-------|---------------|-------|-------------|------------|------------|
| 2020年6月16日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 100,000,000   | 利益剰余金 | 3,125円      | 2020年3月31日 | 2020年6月17日 |

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

（単位：株）

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|-------|---------|----|----|--------|
| 発行済株式 |         |    |    |        |
| 普通株式  | 32,000  | -  | -  | 32,000 |
| 合計    | 32,000  | -  | -  | 32,000 |

## 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（円）   | 1株当たり配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 2020年6月16日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 100,000,000 | 3,125円      | 2020年3月31日 | 2020年6月17日 |

## （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 | 配当金の<br>総額（円） | 配当の原資 | 1株当たり配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|----|-------|---------------|-------|-------------|-----|-------|
|----|-------|---------------|-------|-------------|-----|-------|

|                      |      |             |       |        |            |            |
|----------------------|------|-------------|-------|--------|------------|------------|
| 2021年6月28日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 140,000,000 | 利益剰余金 | 4,375円 | 2021年3月31日 | 2021年6月29日 |
|----------------------|------|-------------|-------|--------|------------|------------|

## （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、第二種金融商品取引業（委託者指図型投資信託の受益権の募集または私募に係る業務）、投資助言・代理業（投資顧問契約に係る業務）及び投資運用業（投資一任契約に係る業務及び投資信託に係る業務）を営んでおります。

当社の金融商品に対する取組方針に関しましては、資産運用を行うに当たっては、会社経営の社会性・公共性の観点から問題を生ぜしめないように十分な配慮を行い、財務健全性の見地からリスク分散を図るとともに、経営体力に見合ったものとするよう定めております。

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

当社が保有する金融商品には、関係会社株式及び投資信託が含まれております。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び金利の変動リスク、市場価格の変動リスクに晒されております。

## （3）金融商品に係るリスク管理体制

当社の金融商品に係るリスク管理体制に関しましては、対象となる運用資産、取引、コンプライアンスチェック等を定めるとともに、実際に保有する金融商品については、定期的に発行体の財務状況、時価等を把握し、保有状況を見直すよう努めております。

## 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は、次のとおりです。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、次表には含めておりません（（注2）参照）。

第35期（2020年3月31日）

（単位：千円）

|             | 貸借対照表計上額  | 時価        | 差額 |
|-------------|-----------|-----------|----|
| （1）現金・預金    | 3,890,445 | 3,890,445 | -  |
| （2）未収委託者報酬  | 262,142   | 262,142   | -  |
| （3）未収運用受託報酬 | 243,265   | 243,265   | -  |
| （4）投資有価証券   |           |           |    |
| 其他有価証券      | 14,637    | 14,637    | -  |
| （5）未払費用     | 315,689   | 315,689   | -  |

第36期（2021年3月31日）

（単位：千円）

|             | 貸借対照表計上額  | 時価        | 差額 |
|-------------|-----------|-----------|----|
| （1）現金・預金    | 4,001,281 | 4,001,281 | -  |
| （2）未収委託者報酬  | 312,288   | 312,288   | -  |
| （3）未収運用受託報酬 | 431,164   | 431,164   | -  |
| （4）投資有価証券   |           |           |    |
| 其他有価証券      | 19,642    | 19,642    | -  |
| （5）未払費用     | 458,062   | 458,062   | -  |

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

（1）現金・預金、（2）未収委託者報酬、（3）未収運用受託報酬、並びに（5）未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（４）投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

（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の貸借対照表計上額

（単位：千円）

| 区分    | 2020年3月31日 | 2021年3月31日 |
|-------|------------|------------|
| 非上場株式 | 38,291     | 38,291     |

上記については、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、「（４）投資有価証券」には含めておりません。

（注３）金銭債権の決算日後の償還予定額

第35期（2020年3月31日）

（単位：千円）

|          | 1年以内      | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|----------|-----------|---------|----------|------|
| 現金・預金    | 3,890,445 | -       | -        | -    |
| 未収委託者報酬  | 262,142   | -       | -        | -    |
| 未収運用受託報酬 | 243,265   | -       | -        | -    |
| 合計       | 4,395,852 | -       | -        | -    |

第36期（2021年3月31日）

（単位：千円）

|          | 1年以内      | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|----------|-----------|---------|----------|------|
| 現金・預金    | 4,001,281 | -       | -        | -    |
| 未収委託者報酬  | 312,288   | -       | -        | -    |
| 未収運用受託報酬 | 431,164   | -       | -        | -    |
| 合計       | 4,744,735 | -       | -        | -    |

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式25,791千円、関連会社株式12,500千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式25,791千円、関連会社株式12,500千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第35期（2020年3月31日）

（単位：千円）

|                      | 種類   | 貸借対照表計上額 | 取得原価   | 差額    |
|----------------------|------|----------|--------|-------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 投資信託 | 8,631    | 7,491  | 1,140 |
|                      | 小計   | 8,631    | 7,491  | 1,140 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 投資信託 | 6,005    | 7,000  | 994   |
|                      | 小計   | 6,005    | 7,000  | 994   |
| 合計                   |      | 14,637   | 14,491 | 146   |

第36期（2021年3月31日）

（単位：千円）

|                      | 種類   | 貸借対照表計上額 | 取得原価   | 差額    |
|----------------------|------|----------|--------|-------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  | 投資信託 | 14,005   | 11,902 | 2,103 |
|                      | 小計   | 14,005   | 11,902 | 2,103 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | 投資信託 | 5,636    | 5,909  | 272   |
|                      | 小計   | 5,636    | 5,909  | 272   |
| 合計                   |      | 19,642   | 17,811 | 1,831 |

## 3. 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）

（単位：千円）

| 種類   | 売却額   | 売却益の合計 | 売却損の合計 |
|------|-------|--------|--------|
| 投資信託 | 9,138 | 2,139  | 0      |
| 合計   | 9,138 | 2,139  | 0      |

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

| 種類   | 売却額   | 売却益の合計 | 売却損の合計 |
|------|-------|--------|--------|
| 投資信託 | 2,133 | 533    | 0      |
| 合計   | 2,133 | 533    | 0      |

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く利用しておりませんので、該当事項はありません。

（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、確定拠出年金法の施行に伴い、2007年3月より確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 退職給付費用の内訳

（単位：千円）

|         | 第35期<br>(自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日) | 第36期<br>(自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日) |
|---------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 確定拠出掛金等 | 44,515                                 | 46,770                                 |

（税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の主な発生原因別の内訳

（単位：千円）

|        | 第35期<br>(2020年3月31日) | 第36期<br>(2021年3月31日) |
|--------|----------------------|----------------------|
| 繰延税金資産 |                      |                      |
| 未払事業税  | 4,643                | 5,155                |
| 未払事業所税 | 1,047                | 1,054                |

|              |        |        |
|--------------|--------|--------|
| 賞与引当金        | 39,950 | 43,418 |
| 未払役員報酬       | 321    | 415    |
| 未払法定福利費      | 6,173  | 6,750  |
| 未払寄付金        | 622    | 679    |
| 未払確定拠出掛金     | 1,166  | 1,203  |
| 未返還投資顧問料     | 1,670  | 1,451  |
| 未払監査費用       | 4,670  | 4,496  |
| 未払特別法人事業税    | -      | 441    |
| 未払調査費        | 582    | 582    |
| 関係会社株式評価損    | 3,689  | 3,689  |
| 敷金           | 2,684  | 2,851  |
| 税務上の繰延資産     | 2,244  | 1,128  |
| 小計           | 69,467 | 72,436 |
| 評価性引当額       | 6,374  | 6,540  |
| 繰延税金資産合計     | 63,093 | 65,895 |
| 繰延税金負債       |        |        |
| その他有価証券評価差額金 | 44     | 560    |
| 繰延税金負債合計     | 44     | 560    |
| 繰延税金資産の純額    | 63,048 | 65,334 |

## 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項目別の内訳

（単位：％）

|                   | 第35期<br>( 2020年3月31日 ) | 第36期<br>( 2021年3月31日 ) |
|-------------------|------------------------|------------------------|
| 法定実効税率            | 30.62                  | 30.62                  |
| （調整）              |                        |                        |
| 永久に損金に算入されない項目    | 2.46                   | 1.32                   |
| 永久に益金に算入されない項目    | 9.74                   | 6.03                   |
| 住民税均等割            | 1.70                   | 1.12                   |
| 評価性引当額の増減         | 0.12                   | 0.08                   |
| その他               | 0.07                   | 0.04                   |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 25.09                  | 27.07                  |

## （持分法損益等）

（単位：千円）

|                    | 第35期<br>( 自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 ) | 第36期<br>( 自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 ) |
|--------------------|------------------------------------------|------------------------------------------|
| 関連会社等に対する投資の金額     | 38,000                                   | 38,000                                   |
| 持分法を適用した場合の投資の金額   | 162,825                                  | 162,224                                  |
| 持分法を適用した場合の投資利益の金額 | 41,334                                   | 39,689                                   |

## （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち、貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

当社はオフィスの不動産貸借契約に基づき、オフィスの退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しております。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該資産除去債務については、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産貸借契約に関連する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もり、そのうち当期の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

この見積もりにあたり、使用見込期間は当該オフィスビルの耐用年数である50年を採用しております。

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

|          | 第35期<br>(自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日) | 第36期<br>(自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日) |
|----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 期首残高     | 19,036                                 | 18,491                                 |
| 増減額（は減少） | 545                                    | 545                                    |
| 期末残高     | 18,491                                 | 17,946                                 |

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

当社は、投資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。

## 〔関連情報〕

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

製品・サービスの区分の外部顧客への売上高については、損益計算書に記載しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 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

対象となる外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

なお、制度上顧客情報を知りえない、または顧客との守秘義務契約により開示できない売上については、判定対象から除いております。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

製品・サービスの区分の外部顧客への売上高については、損益計算書に記載しております。

## 2. 地域ごとの情報

### （１）売上高

本邦の外部顧客への売上高が損益計算書の売上高の90%を超えるため、記載を省略しております。

### （２）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

対象となる外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

なお、制度上顧客情報を知りえない、または顧客との守秘義務契約により開示できない売上については、判定対象から除いております。

### 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

### 〔報告セグメントごとののれん償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

### 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

### （関連当事者情報）

#### 1. 関連当事者との取引

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）

| 種類  | 会社等の名称又は氏名 | 所在地  | 資本金又は出資金<br>（百万円） | 事業の内容<br>又は職業 | 議決権等の<br>被所有割合  | 関連当事者<br>との関係                      | 取引の内容                            | 取引金額<br>（千円） | 科目           | 期末残高<br>（千円） |
|-----|------------|------|-------------------|---------------|-----------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------|--------------|--------------|
| 親会社 | 朝日生命保険相互会社 | 千代田区 | 91,000            | 生命保険業         | （被所有）<br>直接100% | 投資顧問契約<br>に基づく資産<br>運用受託、役<br>員の兼任 | 運用受託報酬                           | 45,505       | 未収運用<br>受託報酬 | 4,099        |
|     |            |      |                   |               |                 |                                    | 出向者人件費<br>の支払、賃借<br>料・共益費支<br>払他 | 228,995      | 前払費用         | 6,106        |

#### 第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金<br>（百万円） | 事業の内容<br>又は職業 | 議決権等の<br>被所有割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容  | 取引金額<br>（千円） | 科目           | 期末残高<br>（千円） |
|----|------------|-----|-------------------|---------------|----------------|---------------|--------|--------------|--------------|--------------|
|    |            |     |                   |               |                |               | 運用受託報酬 | 44,140       | 未収運用<br>受託報酬 | 4,339        |

|     |            |     |        |       |                 |                        |                      |         |      |       |
|-----|------------|-----|--------|-------|-----------------|------------------------|----------------------|---------|------|-------|
| 親会社 | 朝日生命保険相互会社 | 新宿区 | 91,000 | 生命保険業 | （被所有）<br>直接100% | 投資顧問契約に基づく資産運用受託、役員の兼任 | 出向者人件費の支払、賃借料・共益費支払他 | 224,261 | 前払費用 | 6,106 |
|-----|------------|-----|--------|-------|-----------------|------------------------|----------------------|---------|------|-------|

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資顧問契約については、一般の顧客と同様の取扱いをしております。

証券投資信託受益証券の募集販売の取引条件については、一般の販売会社と同様の取扱いをしております。

3. 営業費用のうち、賃借料・共益費については、朝日不動産管理株式会社が収納事務の代理を行っており、同社を経由した取引となっております。

## 2. 親会社に関する注記

### 親会社情報

朝日生命保険相互会社（相互会社であるため上場しておりません）

### （1株当たり情報）

（単位：円）

| 項目         | 第35期<br>（自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日） | 第36期<br>（自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日） |
|------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 1株当たり純資産額  | 126,667.21                             | 128,240.32                             |
| 1株当たり当期純利益 | 3,151.38                               | 4,661.58                               |

なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）1株当たりの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。

| 項目           | 第35期<br>（自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日） | 第36期<br>（自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日） |
|--------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 損益計算書上の当期純利益 | 100,844千円                              | 149,170千円                              |
| 普通株主に帰属しない金額 | -                                      | -                                      |
| 普通株式に係る当期純利益 | 100,844千円                              | 149,170千円                              |
| 普通株式の期中平均株式数 | 32,000株                                | 32,000株                                |

### （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託

会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（ ）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記（ ）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### 定款の変更等

- 1) 委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- 2) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあります。
- 3) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあります。

### 訴訟事件その他の重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### < 受託会社 >

##### 名称

みずほ信託銀行株式会社

資本金の額(2021年3月末現在)

247,369百万円

##### 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

(参考)再信託受託会社の概要

名 称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2021年3月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

#### < 販売会社 >

| 名称            | 資本金の額<br>(単位：百万円) | 事業の内容                         |
|---------------|-------------------|-------------------------------|
| アイザワ証券株式会社    | 3,000             | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| あかつき証券株式会社    | 3,067             | 同上                            |
| 安藤証券株式会社      | 2,280             | 同上                            |
| エース証券株式会社     | 8,831             | 同上                            |
| 株式会社SBI証券     | 48,323            | 同上                            |
| 岡三オンライン証券株式会社 | 2,500             | 同上                            |
| 岡三にいがた証券株式会社  | 852               | 同上                            |

|               |                  |                      |
|---------------|------------------|----------------------|
| 極東証券株式会社      | 5,251            | 同上                   |
| 株式会社証券ジャパン    | 3,000            | 同上                   |
| 立花証券株式会社      | 6,695            | 同上                   |
| 東海東京証券株式会社    | 6,000            | 同上                   |
| 日産証券株式会社      | 1,500            | 同上                   |
| PWM日本証券株式会社   | 3,000            | 同上                   |
| フィデリティ証券株式会社  | 10,857           | 同上                   |
| フィリップ証券株式会社   | 950              | 同上                   |
| 松井証券株式会社      | 11,945           | 同上                   |
| マネックス証券株式会社   | 12,200           | 同上                   |
| 水戸証券株式会社      | 12,272           | 同上                   |
| 楽天証券株式会社      | 7,495            | 同上                   |
| リテラ・クレア証券株式会社 | 3,794            | 同上                   |
| 株式会社愛媛銀行      | 21,367           | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。   |
| 株式会社北日本銀行     | 7,761            | 同上                   |
| 株式会社大光銀行      | 10,000           | 同上                   |
| 株式会社但馬銀行      | 5,481            | 同上                   |
| 株式会社千葉興業銀行    | 62,120           | 同上                   |
| 株式会社東京スター銀行   | 26,000           | 同上                   |
| 株式会社トマト銀行     | 17,810           | 同上                   |
| PayPay銀行株式会社  | 37,250           | 同上                   |
| おかやま信用金庫      | 1,839<br>(出資の総額) | 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。 |

（注）資本金の額は、2021年3月末現在を記載しています。

（注）アイザワ証券株式会社の資本金の額は、2021年10月1日現在を記載しています。

#### < 投資顧問会社 >

名称

ハリス・アソシエイツ・エル・ピー

資本金の額(2020年12月末現在)

3,863千米ドル(約399百万円)

(米ドルの円換算は、便宜上、2020年12月末現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=103円50銭)によります。)

事業の内容

各種の証券を購入、売却、交換および取引することを含む投資運用業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

#### < 受託会社 >

ファンドの受託者として信託財産の保管・管理、計算等を行います。

#### < 販売会社 >

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いを行い、信託契約の一部解約に関する事務、受益権の買取りに関する事務、解約代金、収益分配金、償還金の支払いに関する事務等を行います。

#### < 投資顧問会社 >

委託会社から当ファンドのマザーファンドの運用指図(為替ヘッジを含む外貨建資産)に関する権限の委託を

受け、マザーファンドの運用指図を行います。

### 3【資本関係】

#### < 受託会社 >

該当事項はありません。

#### < 販売会社 >

該当事項はありません。

#### < 投資顧問会社 >

該当事項はありません。

### 第3【その他】

目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用するほか、ファンドの形態等を記載することがあります。

請求目論見書に信託約款の全文を掲載します。

目論見書に、以下の内容を記載することがあります。

- 1) 金融商品取引法上の目論見書である旨
- 2) 金融商品取引業者登録番号、設立年月日、運用する投資信託財産の合計純資産総額などの委託会社に関する情報
- 3) 請求目論見書の入手方法および信託約款が請求目論見書に記載されている旨
- 4) 目論見書の使用開始日
- 5) 届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- 6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- 7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨を記録しておくべきである旨
- 8) 購入に際しては目論見書の内容を十分に読むべき旨

当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

目論見書の別称として、「投資信託説明書」という名称を用いることがあります。

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

目論見書の運用実績のデータは適宜更新されることがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2021年6月28日

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社  
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 伊藤 志保 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 窪 寺 信 印  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている朝日ライフ アセットマネジメント株式会社の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、朝日ライフ アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態並びに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並びに監査役及び監査役会の責任

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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、監査役及び監査役会に対して、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。

２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年11月5日

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社  
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

伊藤 志保

### 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」に掲げられているハリス世界株ファンド（毎月決算型）の2021年3月10日から2021年9月9日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハリス世界株ファンド（毎月決算型）の2021年9月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

- 
- （注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- ２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。