【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24日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＯｎｅDC先進国株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド

（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】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下、「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- **販売会社へのお問い合わせ**
- **委託会社への照会**

  ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。
※当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2021年12月25日から2022年6月24日まで
※ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。
※継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。
※販売会社は、以下の方法でご確認ください。
・委託会社への照会
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。
※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。
・委託会社への照会
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

○振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資を通じて、主として海外の金融商品取引所に上場している株式に実質的に投資します。

指数の著作権等

本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害（逸失利益を含む。）については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

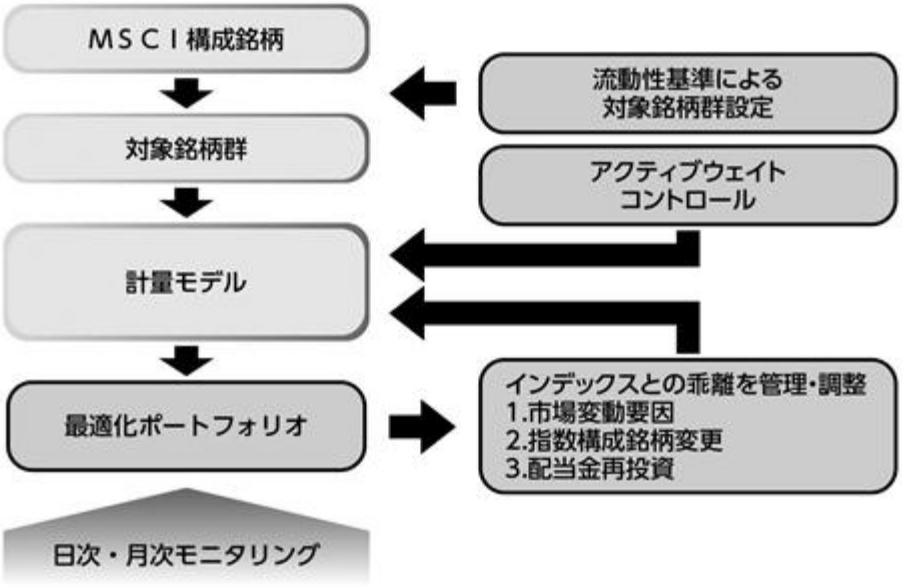
2 マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。

●MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)への連動性を高めるため、有価証券先物取引等を活用する場合があります。

3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

運用プロセス

流動性を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



※上記はマザーファンドの運用プロセスです。

■分配方針

年1回の決算時(毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

＜商品分類＞

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉となる資産）	補足分類
		株　　式	
	国　　内		
単位型		債　　券	インデックス型
	海　　外	不動産投信	
		その他資産	
追加型	内　　外	（　　）	特殊型
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

追　　加　　型	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う。
海　　外	目論見書または投資信託約款において、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う。
株　　式	目論見書または投資信託約款において、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う。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいう。

＜属性区分＞

・属性区分表

投資対象資産 （実際の組入資産）	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（株式）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル （日本を除く） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　　） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし））

（注1）「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注2）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産（投資信託証券（株式））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を除く）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
その他（ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし））	日経２２５またはＴＯＰＩＸにあてはまらない全てのものをいう。 （対象インデックスはＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とする。）

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

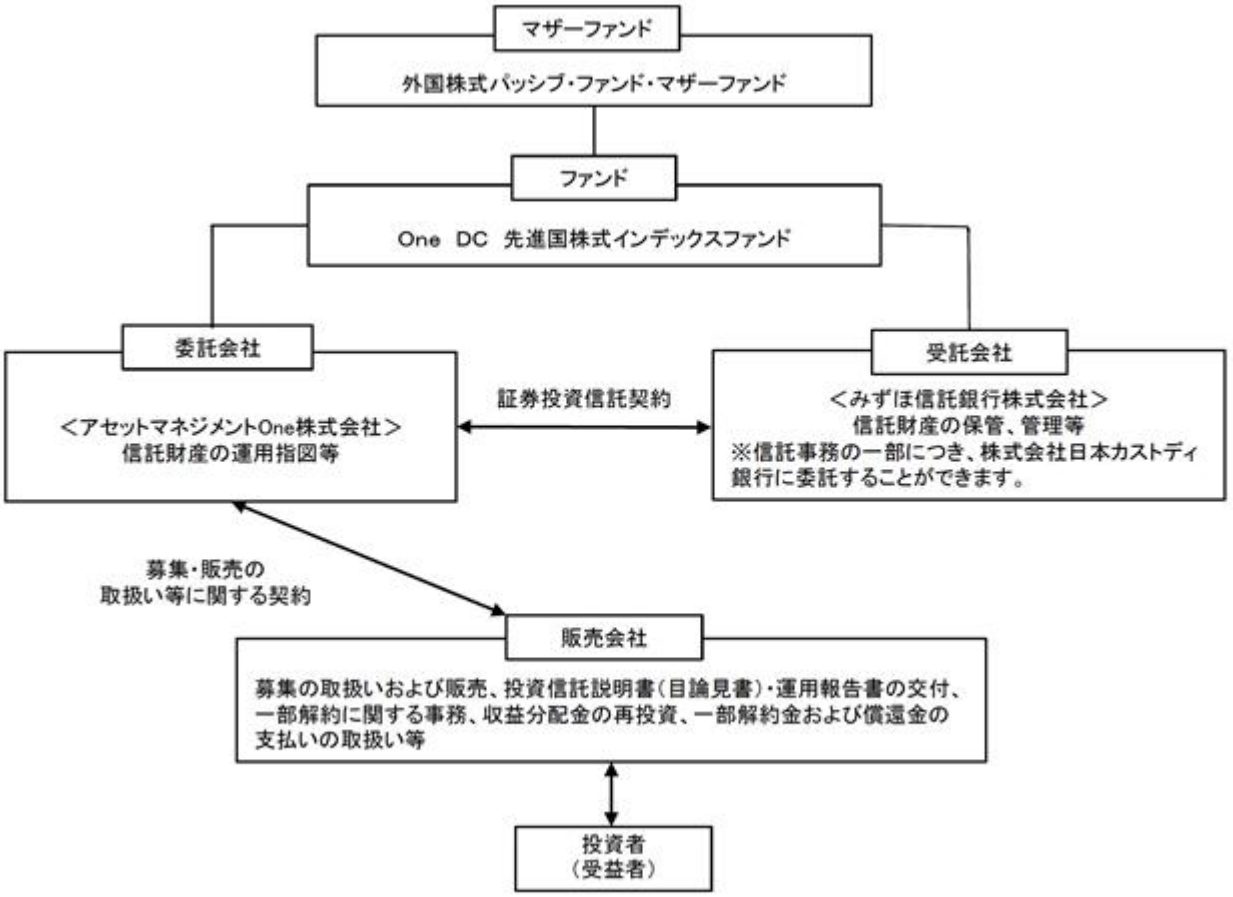
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2019年4月15日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2020年6月26日　　信託報酬率(税抜）を「年率0.109%」から「年率0.0999%」に引き下げ

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

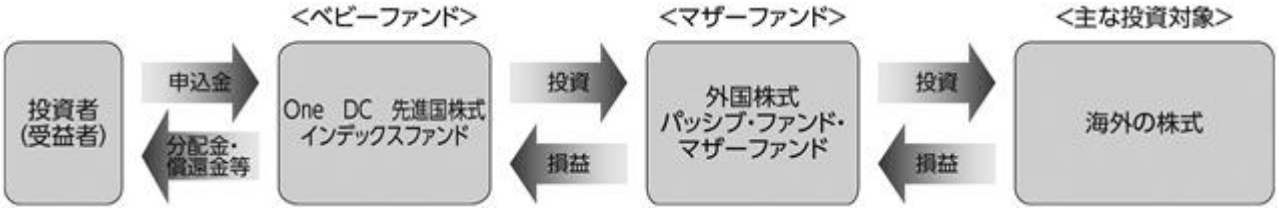
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。
当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。
当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

●ファミリーファンド方式とは●

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額
20億円（2021年9月30日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（2021年9月30日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。
※2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、海外の株式に実質的に投資し、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざします。
②ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）への連動性を高めるため、有価証券先物取引等を活用する場合があります。
③マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
⑤ファンドの資金動向、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。

当ファンドが対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格 ＜ファンドの特色＞をご参照ください。

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）
　イ.有価証券
　ロ.デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）
　ハ.金銭債権
　ニ.約束手形
2.次に掲げる特定資産以外の資産
　イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託である外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの受益証券を含む次の有価証券（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。なお、社債券のうちで、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、ならびに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総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
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．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（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（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、上記1.～11.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、次の15.で定めるものを除きます。）
15.投資法人債券（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。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
16.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。）
17.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す。）
18.預託証券または預託証書（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。）
19.外国法人が発行する譲渡性預金証書
20.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。）
21.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。）
22.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
23.外国の者に対する権利で上記22.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18.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15.の証券ならびに12.および18.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.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

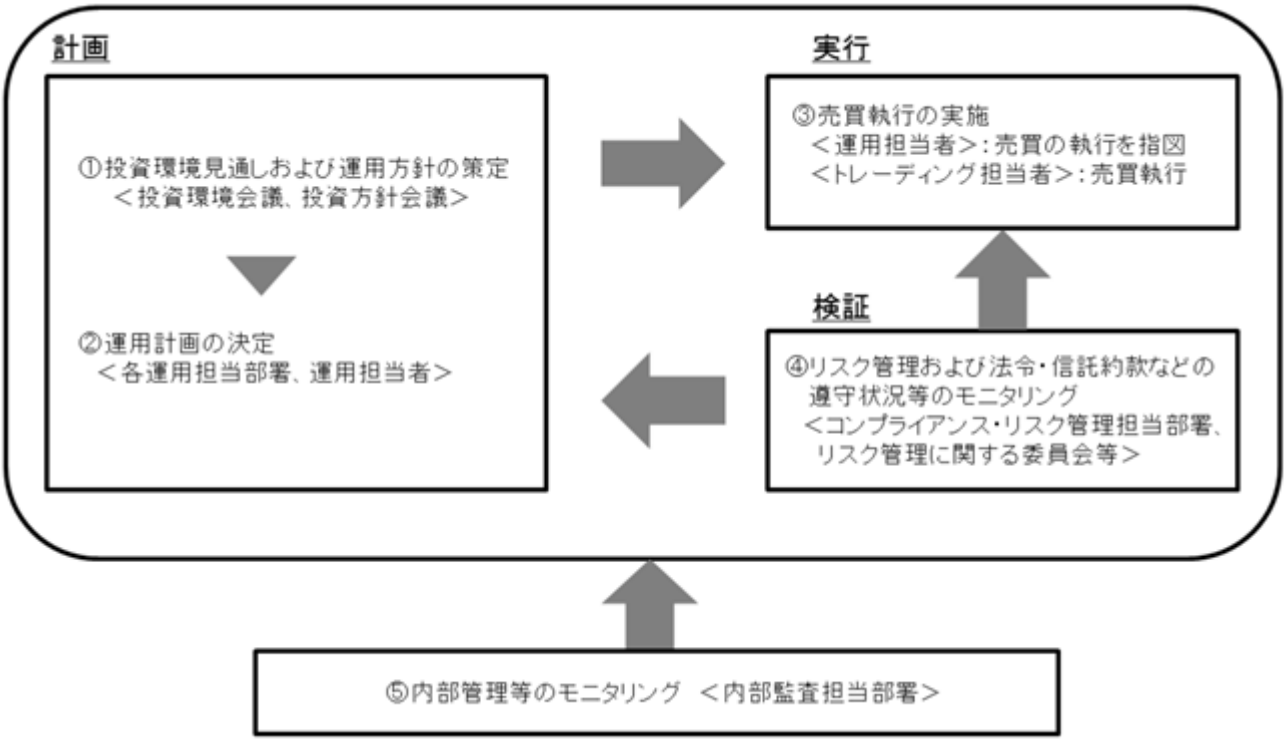
ファンド名	**外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主な投資対象	**海外の株式を主要投資対象とします。**
投資態度	**①主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **②株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **③組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。**

主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④外貨建資産への投資には、制限を設けません。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

④ モニタリング

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

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

⑤ 内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b．ファンドの関係法人に関する管理

当ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c．運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

※運用体制は2021年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

(1)分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（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)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場合があります。

(3)留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

(1)信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1)信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と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。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2)売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2)上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の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。

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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

（５）【投資制限】

①マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

②株式への実質投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

④マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑤デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

1)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。

2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑧信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑨先物取引等の運用指図（約款第23条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2)委託会社は、信託財産に属する資産の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ならびに外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を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の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金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第24条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや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。

2)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。

3)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや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。

2)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。

3)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3）において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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ヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5）において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5）において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

6)上記5)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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ヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

7)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。

8)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または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26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したがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1.株式の貸付は、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。

2)上記1)1.2.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。

3)委託会社は、有価証券の貸付にあたって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。

⑭公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

1)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ることの指図をすることができます。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。

2)上記1)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で行うものとします。

3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)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するものとします。

⑮公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

2)上記1)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。

3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)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するものとします。

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑯特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30条）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑰外国為替予約取引の指図（約款第31条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または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。

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなし

た額との合計額との差額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（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を含みます。）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。

3)上記2)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総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

5)委託会社は、外国為替の売買の予約取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑱資金の借入れ（約款第37条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および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。

2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑲同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や当ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、実質保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。

○信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合、信用格付けが格下げされた場合等には、株式の価格が下落したり、その価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

○流動性リスク

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

○当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じてＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流出入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

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

○資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

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

○当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

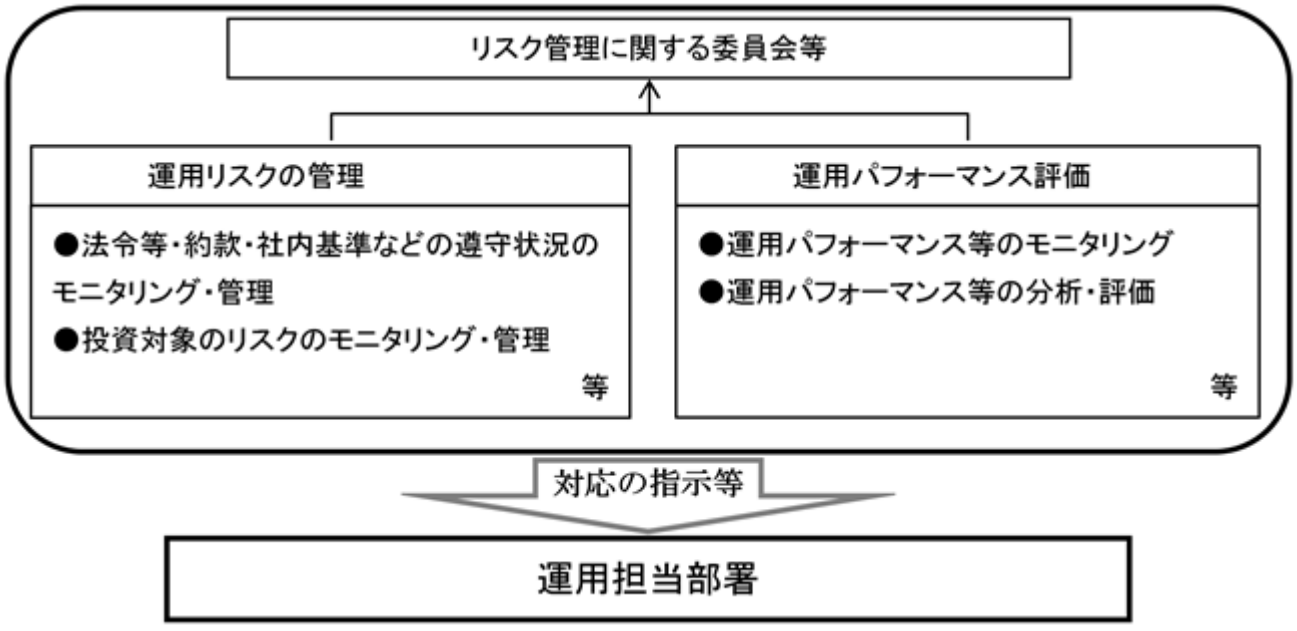
○注意事項

- **当ファンドは、実質的に株式などの値動きのある有価証券（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。**
- **投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。**
- **投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。**
- **投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。**

＜リスク管理体制＞

委託会社におけるファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

- **運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。**
- **運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。**
- **リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。**

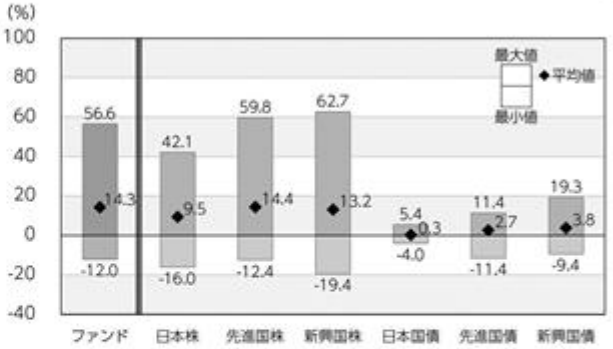


※リスク管理体制は2021年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年10月～2021年9月(2016年10月～2020年3月は対象インデックスのデータ)
代表的な資産クラス:2016年10月～2021年9月

*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
*ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。
*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
*ファンドの対象インデックスはMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)です。

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
*ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示していますので、ファンドの実績ではありません。
*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX)* (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、株式会社東京証券取引所(㈱東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.10989%（税抜0.0999%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.0354%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.0445%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.0200%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

①信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、間接的にファンドで負担することになります。

※上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。
※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）※については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

※解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限ります。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

※上記は、2021年9月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

◇個別元本方式について
受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。
＜個別元本について＞
①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
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算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。
③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞
収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2021年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		7,815,777,638	100.00
	内　日本	7,815,777,638	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		117,474	0.00
純資産総額		7,815,895,112	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		572,283,645,689	90.36
	内　アメリカ	400,648,190,329	63.26
	内　イギリス	24,422,997,338	3.86
	内　カナダ	20,535,019,607	3.24
	内　スイス	18,936,119,068	2.99
	内　フランス	18,591,519,864	2.94
	内　ドイツ	16,496,573,356	2.60
	内　オランダ	12,052,988,722	1.90
	内　オーストラリア	11,123,898,522	1.76
	内　アイルランド	11,006,600,903	1.74
	内　スウェーデン	6,211,967,736	0.98
	内　デンマーク	4,779,339,908	0.75
	内　スペイン	4,459,408,151	0.70
	内　香港	4,107,344,606	0.65
	内　イタリア	3,370,103,291	0.53
	内　フィンランド	2,332,796,450	0.37
	内　ジャージィー	2,283,721,651	0.36
	内　シンガポール	1,620,673,032	0.26
	内　ベルギー	1,509,892,488	0.24
	内　バミューダ	1,370,012,187	0.22
	内　ノルウェー	1,155,572,904	0.18
	内　ケイマン諸島	1,148,219,684	0.18
	内　イスラエル	1,143,016,014	0.18
	内　ルクセンブルグ	592,626,310	0.09
	内　ニュージーランド	562,306,639	0.09
	内　オランダ領キュラソー	446,754,567	0.07
	内　オーストリア	384,095,728	0.06
	内　ポルトガル	285,751,531	0.05
	内　リベリア	232,201,648	0.04
	内　パナマ	211,135,898	0.03
	内　マン島	189,305,308	0.03
	内　パプアニューギニア	73,492,249	0.01
投資信託受益証券		1,023,952,359	0.16
	内　オーストラリア	792,927,190	0.13
	内　シンガポール	231,025,169	0.04

投資証券		12,238,165,470	1.93
	内　アメリカ	11,348,221,035	1.79
	内　イギリス	374,539,087	0.06
	内　フランス	271,671,371	0.04
	内　香港	175,179,676	0.03
	内　カナダ	68,554,301	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		47,772,944,828	7.54
純資産総額		633,318,708,346	100.00

その他資産の投資状況

2021年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		10,849,646,770	1.71
	内　アメリカ	8,056,937,531	1.27
	内　ドイツ	1,688,387,776	0.27
	内　イギリス	478,931,512	0.08
	内　カナダ	380,003,043	0.06
	内　オーストラリア	245,386,908	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2021年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,425,456,436	5.0493 7,197,575,895	5.4830 7,815,777,638	－ －	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）

1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	1,608,716	15,293.11 24,602,274,968	15,985.53 25,716,183,670	－ －	4.06
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	689,859	28,505.20 19,664,569,703	31,785.27 21,927,361,475	－ －	3.46
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	43,740	368,612.42 16,123,107,492	369,461.35 16,160,239,466	－ －	2.55
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	230,966	32,700.79 7,552,771,515	38,009.15 8,778,821,616	－ －	1.39
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	28,951	251,409.43 7,278,554,522	300,736.87 8,706,633,250	－ －	1.37
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	28,126	252,760.76 7,109,149,266	301,111.80 8,469,070,666	－ －	1.34
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	78,889	86,550.37 6,827,872,804	87,444.21 6,898,386,692	－ －	1.09
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	239,952	18,162.73 4,358,184,149	22,962.62 5,509,928,129	－ －	0.87
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	292,453	16,430.59 4,805,176,931	18,573.12 5,431,765,833	－ －	0.86
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	254,706	18,720.86 4,768,316,345	18,357.11 4,675,668,199	－ －	0.74
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	163,269	24,224.67 3,955,138,681	25,370.02 4,142,138,709	－ －	0.65

12	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	90,985	39,420.71 3,586,693,941	44,813.88 4,077,391,526	－ －	0.64
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	128,224	28,425.03 3,644,771,973	31,034.29 3,979,341,672	－ －	0.63
14	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	102,444	32,551.93 3,334,750,774	37,709.20 3,863,081,858	－ －	0.61
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	236,726	14,675.09 3,473,976,379	15,894.87 3,762,730,984	－ －	0.59
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	278,181	12,469.70 3,468,835,092	13,481.70 3,750,354,122	－ －	0.59
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	744,285	3,995.06 2,973,468,935	4,820.39 3,587,747,246	－ －	0.57
18	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	40,392	68,903.94 2,783,168,276	84,110.32 3,397,384,126	－ －	0.54
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	85,300	39,008.93 3,327,462,025	39,529.02 3,371,825,815	－ －	0.53
20	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	174,439	20,677.55 3,606,972,229	19,326.34 3,371,268,400	－ －	0.53
21	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	107,503	32,330.78 3,475,656,291	28,987.27 3,116,219,561	－ －	0.49
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	46,067	58,499.50 2,694,896,485	64,656.18 2,978,516,428	－ －	0.47
23	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	42,608	61,413.35 2,616,700,139	67,046.79 2,856,729,849	－ －	0.45
24	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	93,566	26,959.79 2,522,520,152	30,274.35 2,832,650,767	－ －	0.45
25	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	440,010	6,105.92 2,686,667,390	6,259.68 2,754,324,260	－ －	0.43
26	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	408,773	5,949.41 2,431,960,426	6,701.76 2,739,502,464	－ －	0.43
27	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	67,280	38,488.93 2,589,535,560	40,525.43 2,726,551,199	－ －	0.43

28	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	539,863	4,168.32 2,250,326,342	4,871.87 2,630,146,456	－ －	0.42
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	408,114	5,563.68 2,270,618,676	6,209.32 2,534,111,075	－ －	0.40
30	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサイエンス・ツール／サービス	37,836	57,220.23 2,164,984,701	64,868.83 2,454,377,127	－ －	0.39

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年9月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	90.36
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.93
合計	92.46

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年9月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	7.24
銀行		5.75
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.52
コンピュータ・周辺機器		4.32
半導体・半導体製造装置		4.31
情報技術サービス		4.26
医薬品		4.25
インターネット販売・通信販売		3.13
資本市場		3.06
石油・ガス・消耗燃料		2.98
ヘルスケア機器・用品		2.88
保険		2.81
化学		1.92
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.79
ホテル・レストラン・レジャー		1.76
自動車		1.74
バイオテクノロジー		1.64
専門小売り		1.62
電力		1.57
機械		1.55
飲料		1.46
娯楽		1.42
食品		1.41
繊維・アパレル・贅沢品		1.35
航空宇宙・防衛		1.34
食品・生活必需品小売り		1.32

各種電気通信サービス	1.27
金属・鉱業	1.22
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.10
コングロマリット	1.04
メディア	1.03
家庭用品	1.02
陸運・鉄道	0.95
各種金融サービス	0.84
電気設備	0.82
専門サービス	0.75
総合公益事業	0.74
通信機器	0.64
タバコ	0.61
航空貨物・物流サービス	0.57
パーソナル用品	0.57
建設関連製品	0.57
電子装置・機器・部品	0.55
消費者金融	0.47
複合小売り	0.46
商業サービス・用品	0.42
不動産管理・開発	0.38
家庭用耐久財	0.32
商社・流通業	0.30
容器・包装	0.27
無線通信サービス	0.25
自動車部品	0.23
建設資材	0.23
建設・土木	0.20
エネルギー設備・サービス	0.14
ヘルスケア・テクノロジー	0.13
ガス	0.12
運送インフラ	0.12
水道	0.10
紙製品・林産品	0.10
販売	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
海運業	0.08
レジャー用品	0.06
旅客航空輸送業	0.06
合計	90.36

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec21	買建	331	8,233,766,934	8,056,937,531	1.27
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec21	買建	320	1,731,226,966	1,688,387,776	0.27
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec21	買建	45	476,246,337	478,931,512	0.08
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec21	買建	18	387,099,847	380,003,043	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec21	買建	17	253,084,918	245,386,908	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2021年9月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2020年3月25日)	617	617	0.8135	0.8135
第2計算期間末(2021年3月25日)	3,594	3,594	1.2920	1.2920
2020年9月末日	1,249	－	1.0616	－
10月末日	1,265	－	1.0320	－
11月末日	1,459	－	1.1509	－
12月末日	1,862	－	1.1841	－
2021年1月末日	2,200	－	1.2085	－
2月末日	3,075	－	1.2496	－
3月末日	3,798	－	1.3333	－
4月末日	4,291	－	1.3957	－
5月末日	5,308	－	1.4160	－
6月末日	6,350	－	1.4512	－
7月末日	7,229	－	1.4716	－
8月末日	7,829	－	1.5077	－
9月末日	7,815	－	1.4724	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）

第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
2021年3月26日～2021年9月25日	－

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△18.7
第2計算期間	58.8
2021年3月26日～2021年9月25日	15.3

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

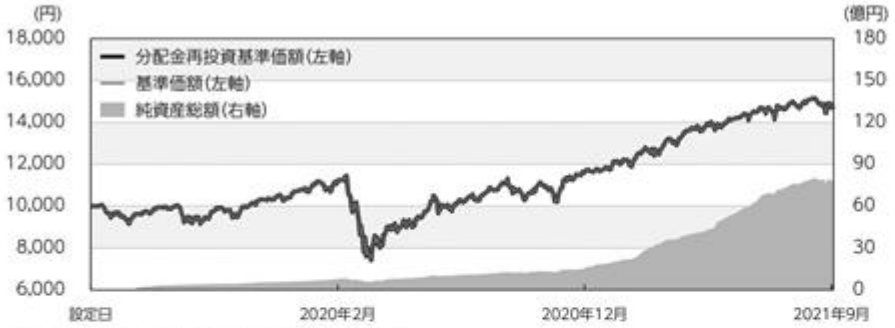
	設定口数	解約口数
第1計算期間	940,446,792	181,390,647
第2計算期間	2,509,518,622	486,240,064
2021年3月26日～ 2021年9月25日	2,950,406,739	437,452,261

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2021年9月30日

基準価額・純資産の推移 《2019年4月15日～2021年9月30日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2019年4月15日)

分配の推移(税引前)

2020年 3月	0円
2021年 3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	100.00

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

資産の種類		比率(%)
株式		90.36
	内　アメリカ	63.26
	内　イギリス	3.86
	内　カナダ	3.24
	内　スイス	2.99
	内　フランス	2.94
	内　その他	14.07
投資信託受益証券		0.16
	内　オーストラリア	0.13
	内　シンガポール	0.04
投資証券		1.93
	内　アメリカ	1.79
	内　イギリス	0.06
	内　フランス	0.04
	内　香港	0.03
	内　カナダ	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7.54
合計(純資産総額)		100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.06
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.46
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.55
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.39
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.37
6	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.34
7	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.09
8	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	0.87
9	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.86
10	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.74

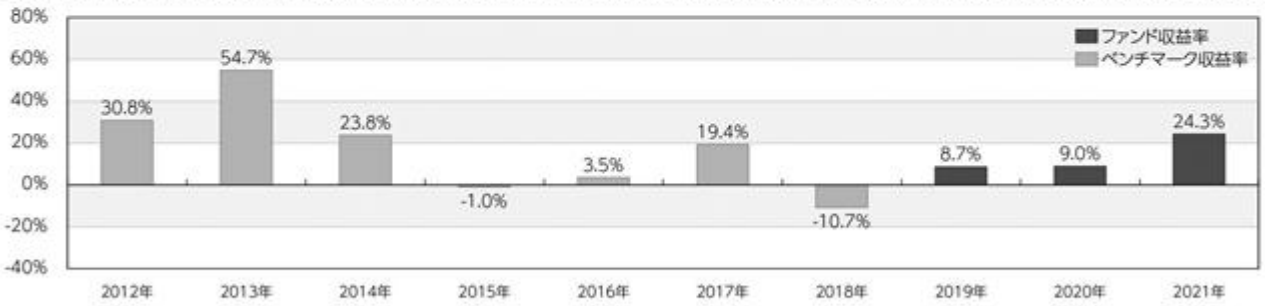
その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.71

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	ソフトウェア	7.24
2	銀行	5.75
3	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.52
4	コンピュータ・周辺機器	4.32
5	半導体・半導体製造装置	4.31

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※2018年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」です。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

1円以上1円単位とします。

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に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。

なお、受益者が解約の請求をするときは、委託会社または販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

※委託会社は、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、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

・解約単位

1口単位とします。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2019年4月15日（設定日）から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年3月26日から翌年3月25日までとします。

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

（５）【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、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。

b.委託会社は、上記a.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、書面決議の日および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、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発します。

c.上記b.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。以下イ.償還規定c.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。

d.上記b.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。

e.上記b.からd.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、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、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

f.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

g.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、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、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、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が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。

h.受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

i.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ.信託約款の変更等

a.委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（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、信託約款はa.からg.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。

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよ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、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発します。

c.上記b.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。

d.上記b.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。

e.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。

f.上記b.からe.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をした場合において、当該提案につき、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。

g.上記a.からf.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っても、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。

h.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、上記a.からg.の規定にしたがいます。

ⅰ.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ハ.関係法人との契約の更改

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

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

ホ.運用報告書

- **委託会社は、毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。**
- **運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。**

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3)一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（2020年3月26日から2021年3月25日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2020年3月25日現在	第2期 2021年3月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,427,232	14,128,493
親投資信託受益証券	617,497,096	3,594,842,899
流動資産合計	626,924,328	3,608,971,392
資産合計	626,924,328	3,608,971,392
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,082,628	12,940,368
未払受託者報酬	60,315	219,838
未払委託者報酬	268,541	878,371
その他未払費用	9,952	35,097
流動負債合計	9,421,436	14,073,674
負債合計	9,421,436	14,073,674
純資産の部		
元本等		
元本	759,056,145	2,782,334,703
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△141,553,253	812,563,015
（分配準備積立金）	7,405,956	421,395,305
元本等合計	617,502,892	3,594,897,718
純資産合計	617,502,892	3,594,897,718
負債純資産合計	626,924,328	3,608,971,392

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2019年4月15日 至　2020年3月25日	第2期 自　2020年3月26日 至　2021年3月25日
営業収益		
受取利息	－	4
有価証券売買等損益	△142,093,904	607,977,803
営業収益合計	△142,093,904	607,977,807
営業費用		
支払利息	605	1,194
受託者報酬	86,267	330,162
委託者報酬	384,111	1,340,457
その他費用	14,328	52,936
営業費用合計	485,311	1,724,749
営業利益又は営業損失（△）	△142,579,215	606,253,058
経常利益又は経常損失（△）	△142,579,215	606,253,058
当期純利益又は当期純損失（△）	△142,579,215	606,253,058
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△1,948,576	87,875,504
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	△141,553,253
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,725,369	435,738,714
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,725,369	30,198,319
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	405,540,395
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,647,983	－
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,647,983	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△141,553,253	812,563,015

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第2期 自　2020年3月26日 至　2021年3月25日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 2020年3月25日現在	第2期 2021年3月25日現在
１．　期首元本額	1,000,000円	759,056,145円
期中追加設定元本額	939,446,792円	2,509,518,622円
期中一部解約元本額	181,390,647円	486,240,064円
２．　受益権の総数	759,056,145口	2,782,334,703口
３．　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は141,553,253円であります。	－

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　2019年4月15日 至　2020年3月25日	第2期 自　2020年3月26日 至　2021年3月25日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,405,956円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（542,531円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は7,948,487円（1万口当たり104.71円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（25,866,697円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（390,421,287円）、信託約款に規定される収益調整金（391,167,710円）及び分配準備積立金（5,107,321円）より分配対象収益は812,563,015円（1万口当たり2,920.43円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自　2019年4月15日 至　2020年3月25日	第2期 自　2020年3月26日 至　2021年3月25日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

２． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
３． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2020年3月25日現在	第2期 2021年3月25日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2020年3月25日現在	第2期 2021年3月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	△143,186,586	593,672,103
合計	△143,186,586	593,672,103

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2020年3月25日現在	第2期 2021年3月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8135円 (8,135円)	1.2920円 (12,920円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
（１）株式
該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2021年3月25日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	747,601,726	3,594,842,899	
親投資信託受益証券　合計		747,601,726	3,594,842,899	
合計			3,594,842,899	

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

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

（参考）
当ファンドは、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年3月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	5,624,794,397
コール・ローン	231,161,336
株式	481,690,396,704
投資信託受益証券	902,419,343
投資証券	9,977,838,762
派生商品評価勘定	502,198
未収入金	4,377,622
未収配当金	669,914,072
差入委託証拠金	5,516,212,792
流動資産合計	504,617,617,226
資産合計	504,617,617,226
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,212,990
未払解約金	121,677,000
流動負債合計	259,889,990
負債合計	259,889,990
純資産の部	
元本等	
元本	104,889,479,890
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	399,468,247,346
元本等合計	504,357,727,236
純資産合計	504,357,727,236
負債純資産合計	504,617,617,226

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年3月25日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	87,618,531,002円
同期中追加設定元本額	50,439,485,511円
同期中一部解約元本額	33,168,536,623円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,563,140,118円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,310,337円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,693,250円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	6,532,863円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	22,096,248円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	17,443,618円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	10,331,490円
たわらノーロード　先進国株式	20,304,416,961円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	223,156,171円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,374,769,267円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	421,357,714円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	46,533,836円
たわらノーロード　バランス（標準型）	363,266,244円
たわらノーロード　バランス（積極型）	430,373,718円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	1,099,049円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	132,195,005円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	347,948,067円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	231,926,364円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	361,615,110円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	617,016円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,969,605円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,908,463円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,753,035円
たわらノーロード　全世界株式	90,648,857円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	47,132,942,136円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	747,601,726円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	179,129,234円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	927,081,027円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,093,166,656円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	110,456,347円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	333,223,370円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	287,098,251円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	26,254,018円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	812,258,246円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	164,562,950円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	200,131,079円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	174,742,969円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	290,408,303円
投資のソムリエ	6,219,207,691円
クルーズコントロール	278,564,071円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	358,585,770円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	191,359,007円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	114,589,388円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,000,824円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	3,880,916円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	184,203,371円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,031,628,461円
ワールドアセットバランス（基本コース）	303,169,116円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	876,724,028円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	9,122,291円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	4,466,840円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,809,134円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	18,399,313円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	32,145,887円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,159,297,944円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	168,019,810円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	4,677,103円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	2,472,991円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	2,627,692円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,863,941円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	527,338円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	557,257円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	8,768,590円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	245,460円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	253,423,278円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	62,969,789円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,434,370,078円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,155,011,618円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	862,091,517円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,266,447円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	819,550円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,722,229円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	72,407,897円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,993,003円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,677,682円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,504,289円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	863,556円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,697,574円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,123,952円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	281,526,985円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	396,965,021円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,284,233,059円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	393,840,908円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	67,114,596円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	458,063,421円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	20,807,679円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,600,491円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	192,986,328円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,227,921円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	62,784,847円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	98,751,321円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	198,560,455円
計	104,889,479,890円
２．　受益権の総数	104,889,479,890口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2020年3月26日 至　2021年3月25日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年3月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年3月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△5,623,789,892

投資信託受益証券	20,547,509
投資証券	117,528,792
合計	△5,485,713,591

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年2月16日から2021年3月25日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年3月25日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,173,216,223	－	1,173,117,190	△99,033
アメリカ・ドル	860,696,400	－	860,617,350	△79,050
イギリス・ポンド	56,351,484	－	56,344,680	△6,804
オーストラリア・ドル	27,458,060	－	27,453,080	△4,980
カナダ・ドル	41,650,271	－	41,644,980	△5,291
ユーロ	187,060,008	－	187,057,100	△2,908
合計	1,173,216,223	－	1,173,117,190	△99,033

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2021年3月25日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	13,010,613,997	－	12,873,002,238	△137,611,759
合計	13,010,613,997	－	12,873,002,238	△137,611,759

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

１．　原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年3月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.8085円 (48,085円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2021年3月25日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	39,487	3,087.070	121,899,133.090	
	ABBOTT LABORATORIES	164,599	118.020	19,425,973.980	
	AES CORP	64,846	25.650	1,663,299.900	
	ABIOMED INC	3,987	294.210	1,173,015.270	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	82,241	130.620	10,742,319.420	
	ADVANCED MICRO DEVICES	111,857	76.480	8,554,823.360	
	ADOBE INC	44,515	451.510	20,098,967.650	
	CHUBB LTD	41,876	156.620	6,558,619.120	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,854	278.010	5,519,610.540	
	ALLEGHANY CORP	1,263	633.960	800,691.480	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	74.980	453,778.960	
	ALLSTATE CORP	26,594	112.850	3,001,132.900	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	64,850	212.220	13,762,467.000	
	AMGEN INC	53,918	245.470	13,235,251.460	
	HESS CORP	24,776	69.080	1,711,526.080	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,612	138.420	8,805,173.040	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	46,836	84.990	3,980,591.640	
	AFLAC INC	63,132	49.900	3,150,286.800	
	AMERICAN INTL GROUP	81,268	44.990	3,656,247.320	
	AMERCO	929	587.730	546,001.170	
	ANALOG DEVICES	34,824	150.440	5,238,922.560	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,780	151.540	3,149,001.200	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	65,314	58.590	3,826,747.260	
	VALERO ENERGY CORP	37,400	71.780	2,684,572.000	
	ANSYS INC	8,374	330.370	2,766,518.380	
	APPLE INC	1,573,696	120.090	188,985,152.640	
	APPLIED MATERIALS INC	84,933	121.100	10,285,386.300	
	ALBEMARLE CORP	10,595	146.630	1,553,544.850	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,047	55.920	2,966,388.240	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	79.600	738,528.800	
AMEREN CORP	22,273	80.990	1,803,890.270	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	103.590	688,977.090	
AUTOLIV INC	7,570	88.320	668,582.400	
AUTODESK INC	20,606	263.180	5,423,087.080	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	39,725	185.270	7,359,850.750	
AUTOZONE INC	2,200	1,353.490	2,977,678.000	
AVERY DENNISON CORP	7,627	177.100	1,350,741.700	
BALL CORP	28,847	85.350	2,462,091.450	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	126,556	249.630	31,592,174.280	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	75,718	45.250	3,426,239.500	
BAXTER INTERNATIONAL INC	48,248	82.080	3,960,195.840	
BECTON DICKINSON & CO	27,118	241.770	6,556,318.860	
AMETEK INC	22,088	122.810	2,712,627.280	
VERIZON COMM INC	382,072	57.010	21,781,924.720	
WR BERKLEY CORP	12,511	74.540	932,569.940	
BEST BUY CO INC	21,560	114.320	2,464,739.200	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,149	559.380	1,202,107.620	
YUM! BRANDS INC	27,393	107.080	2,933,242.440	
FIRSTENERGY CORP	47,800	34.330	1,640,974.000	
BOEING CO	49,777	239.240	11,908,649.480	
ROBERT HALF INTL INC	11,111	73.690	818,769.590	
BORGWARNER INC	21,938	43.500	954,303.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	129,098	37.580	4,851,502.840	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	95.070	1,114,125.330	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	10,687	170.260	1,819,568.620	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,291	1,109.880	2,542,735.080	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	210,050	62.300	13,086,115.000	
ONEOK INC	39,284	48.740	1,914,702.160	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,186	114.470	708,111.420	
UNITED RENTALS INC	7,071	305.410	2,159,554.110	
SEMPRA ENERGY	26,113	128.970	3,367,793.610	
FEDEX CORP	23,242	268.290	6,235,596.180	
VERISIGN INC	10,044	195.030	1,958,881.320	
AMPHENOL CORP	56,800	63.650	3,615,320.000	
BROWN-FORMAN CORP	28,495	69.070	1,968,149.650	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.110	593,500.960	
CSX CORP	70,959	94.170	6,682,209.030	

CABOT OIL & GAS CORP	31,416	18.230	572,713.680	
CAMPBELL SOUP CO	16,623	48.770	810,703.710	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	71.330	1,400,992.530	
CONSTELLATION BRANDS INC	15,370	229.680	3,530,181.600	
CARDINAL HEALTH INC	28,861	59.110	1,705,973.710	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	72,425	24.850	1,799,761.250	
CATERPILLAR INC	50,403	221.230	11,150,655.690	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	114.280	1,127,372.200	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	135.030	1,341,252.990	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	80,424	13.220	1,063,205.280	
CERNER CORP	27,258	71.830	1,957,942.140	
JPMORGAN CHASE & CO	282,096	150.620	42,489,299.520	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,293	84.570	2,054,459.010	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	104.620	1,346,668.640	
CINTAS CORP	8,099	335.950	2,720,859.050	
CISCO SYSTEMS INC	391,511	49.650	19,438,521.150	
CLOROX COMPANY	12,204	189.220	2,309,240.880	
COCA-COLA CO/THE	377,350	51.520	19,441,072.000	
COPART INC	18,628	105.900	1,972,705.200	
COGNEX CORP	17,583	77.500	1,362,682.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	74,995	77.770	5,832,361.150	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	26,269	143.280	3,763,822.320	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	235.100	1,223,225.300	
NRG ENERGY, INC.	21,039	35.930	755,931.270	
COMCAST CORP-CL A	422,897	55.920	23,648,400.240	
CONAGRA BRANDS INC	47,993	36.900	1,770,941.700	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,844	73.430	2,191,444.920	
CMS ENERGY CORP	25,936	60.880	1,578,983.680	
COOPER COS INC	5,205	380.310	1,979,513.550	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	48.360	798,568.680	
CORNING INC	73,382	40.250	2,953,625.500	
SEALED AIR CORP	13,870	45.220	627,201.400	
HEICO CORP-CL A	6,236	114.000	710,904.000	
CUMMINS INC	14,120	257.700	3,638,724.000	
DR HORTON INC	33,509	83.560	2,800,012.040	
DANAHER CORP	59,450	219.470	13,047,491.500	
MOODY'S CORP	15,199	296.250	4,502,703.750	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	49,905	76.940	3,839,690.700	
TARGET CORP	46,514	188.280	8,757,655.920	
DEERE & CO	27,670	360.910	9,986,379.700	
MORGAN STANLEY	130,753	79.330	10,372,635.490	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	98.220	1,879,537.920	
COSTAR GROUP INC	3,737	804.230	3,005,407.510	
THE WALT DISNEY CO	167,946	184.720	31,022,985.120	

DOLLAR TREE INC	21,916	110.500	2,421,718.000	
DOVER CORP	12,652	135.670	1,716,496.840	
OMNICOM GROUP	19,663	74.890	1,472,562.070	
DTE ENERGY CO	17,793	130.530	2,322,520.290	
DUKE ENERGY CORP	68,443	94.390	6,460,334.770	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,684	133.930	1,698,768.120	
EBAY INC	61,491	57.640	3,544,341.240	
BANK OF AMERICA CORP	721,182	36.900	26,611,615.800	
CITIGROUP INC	193,072	70.080	13,530,485.760	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,229	108.760	1,330,026.040	
EATON CORP PLC	37,306	134.450	5,015,791.700	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,856	126.970	3,409,906.320	
DISH NETWORK CORP	21,420	35.520	760,838.400	
ECOLAB INC	23,050	208.460	4,805,003.000	
PERKINELMER INC	9,755	125.200	1,221,326.000	
ELECTRONIC ARTS INC	26,271	129.800	3,409,975.800	
SALESFORCE.COM INC	84,482	209.530	17,701,513.460	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	226.270	507,523.610	
EMERSON ELECTRIC CO	56,165	88.060	4,945,889.900	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	95.850	1,102,562.550	
ENTERGY CORP	19,693	97.430	1,918,688.990	
EOG RESOURCES INC	56,310	72.540	4,084,727.400	
EQUIFAX INC	11,215	174.410	1,956,008.150	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	21,023	284.980	5,991,134.540	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	15,838	102.230	1,619,118.740	
EXXON MOBIL CORP	392,818	56.340	22,131,366.120	
FMC CORP	11,416	109.510	1,250,166.160	
NEXTERA ENERGY INC	181,413	72.830	13,212,308.790	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	321.350	1,043,102.100	
FAIR ISAAC CORP	2,482	475.390	1,179,917.980	
ASSURANT INC	5,523	142.000	784,266.000	
FASTENAL CO	50,482	48.230	2,434,746.860	
FIFTH THIRD BANCORP	63,646	36.280	2,309,076.880	
M&T BANK CORP	11,432	147.770	1,689,306.640	
FISERV INC	53,132	123.250	6,548,519.000	
FORD MOTOR CO	366,977	12.140	4,455,100.780	
FRANKLIN RESOURCES INC	31,397	28.590	897,640.230	
FREEPORT-MCMORAN INC	136,831	31.610	4,325,227.910	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	124.220	2,226,270.840	
DENTSPLY SIRONA INC	21,862	60.350	1,319,371.700	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,599	176.420	3,810,495.580	
GENERAL MILLS INC	58,344	58.620	3,420,125.280	
GENUINE PARTS CO	13,393	114.810	1,537,650.330	
GILEAD SCIENCES INC	116,909	64.350	7,523,094.150	
GARTNER INC	8,742	181.100	1,583,176.200	
MCKESSON CORP	14,289	187.800	2,683,474.200	
NVIDIA CORP	57,415	505.720	29,035,913.800	
GENERAL ELECTRIC CO	813,887	12.500	10,173,587.500	

WW GRAINGER INC	4,234	395.390	1,674,081.260	
HALLIBURTON CO	77,483	21.300	1,650,387.900	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,283	88.720	3,307,747.760	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,389	328.650	9,987,344.850	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,969	195.960	3,717,165.240	
HASBRO INC	11,383	95.630	1,088,556.290	
HENRY SCHEIN INC	14,910	65.660	978,990.600	
HEICO CORP	3,623	122.750	444,723.250	
HERSHEY FOODS CORP	13,622	157.260	2,142,195.720	
HP INC	125,184	29.370	3,676,654.080	
F5 NETWORKS INC	5,529	197.710	1,093,138.590	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,024	97.030	1,166,688.720	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	24.500	684,505.500	
HOLOGIC INC	24,009	71.980	1,728,167.820	
HOME DEPOT INC	99,488	292.750	29,125,112.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	74.730	1,217,202.240	
HORMEL FOODS CORP	26,254	48.060	1,261,767.240	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	21.750	1,067,163.750	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	306.300	892,251.900	
HUMANA INC	11,937	414.660	4,949,796.420	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	159.530	1,203,494.320	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,857	15.320	1,437,889.240	
BIOGEN INC	14,557	265.690	3,867,649.330	
IDEX CORP	7,516	201.340	1,513,271.440	
ILLINOIS TOOL WORKS	29,314	220.360	6,459,633.040	
INTUIT INC	24,426	377.290	9,215,685.540	
IDEXX LABORATORIES INC	8,112	472.970	3,836,732.640	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	43.280	474,348.800	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,891	161.210	3,529,048.110	
INTEL CORP	379,473	62.040	23,542,504.920	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,906	136.430	2,715,775.580	
INTERNATIONAL PAPER CO	36,233	52.200	1,891,362.600	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	27.830	982,872.110	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,871	123.300	1,586,994.300	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	153.920	1,058,046.080	
INCYTE CORP	18,815	78.480	1,476,601.200	
JOHNSON & JOHNSON	243,488	161.910	39,423,142.080	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	33,476	67.050	2,244,565.800	
KLA CORPORATION	14,748	297.890	4,393,281.720	

DEVON ENERGY CORP	56,014	22.340	1,251,352.760	
KELLOGG CO	25,903	61.510	1,593,293.530	
KEYCORP	87,597	19.260	1,687,118.220	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,861	135.680	4,187,220.480	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,153	722.750	10,229,080.750	
KROGER CO	71,262	35.710	2,544,766.020	
LAM RESEARCH CORP	13,455	552.450	7,433,214.750	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	388.100	1,281,506.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	129.890	1,096,011.820	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	98.390	1,392,513.670	
PLUG POWER INC	42,511	33.200	1,411,365.200	
LENNAR CORP	26,894	94.650	2,545,517.100	
ELI LILLY & CO	79,928	180.170	14,400,627.760	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	58.510	1,058,445.900	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	66,324	159.910	10,605,870.840	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,424	120.840	3,555,596.160	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,209	356.120	8,265,189.080	
LOEWS CORP	21,759	50.900	1,107,533.100	
LOWE'S COS INC	67,956	180.680	12,278,290.080	
DOMINION ENERGY INC	73,373	74.160	5,441,341.680	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,870	36.900	1,508,103.000	
MCCORMICK & CO INC	24,453	87.530	2,140,371.090	
MCDONALD'S CORPORATION	68,754	224.050	15,404,333.700	
S&P GLOBAL INC	22,369	351.790	7,869,190.510	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	242.950	829,917.200	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,126.620	1,353,070.620	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	56,191	80.210	4,507,080.110	
MARSH & MCLENNAN COS	45,948	118.000	5,421,864.000	
MASCO CORP	23,151	57.300	1,326,552.300	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,956	322.250	1,919,321.000	
METLIFE INC	71,848	58.540	4,205,981.920	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,591	89.390	2,108,799.490	
MEDTRONIC PLC	124,315	115.960	14,415,567.400	
ACTIVISION BLIZZARD INC	72,380	90.510	6,551,113.800	
CVS HEALTH CORP	121,833	73.210	8,919,393.930	
MERCK & CO.INC.	233,956	76.240	17,836,805.440	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	36,651	38.120	1,397,136.120	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,588	250.420	2,150,606.960	
MICROSOFT CORP	664,678	235.460	156,505,081.880	
MICRON TECH INC	103,840	83.000	8,618,720.000	

MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,604	146.760	3,464,123.040	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	61,287	45.250	2,773,236.750	
3M CO	53,466	190.690	10,195,431.540	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	185.400	922,550.400	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,221	181.040	2,936,649.840	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	254.110	2,120,802.060	
ILLUMINA INC	13,134	406.800	5,342,911.200	
XCEL ENERGY INC	46,591	65.580	3,055,437.780	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	87.570	705,639.060	
NETAPP INC	19,804	68.630	1,359,148.520	
NEWELL BRANDS INC	33,317	24.910	829,926.470	
NEWMONT CORP	72,665	60.370	4,386,786.050	
NVR INC	351	4,539.650	1,593,417.150	
NIKE INC-CL B	116,303	133.160	15,486,907.480	
NORDSON CORP	4,644	199.710	927,453.240	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,673	264.310	6,257,010.630	
EVERSOURCE ENERGY	30,569	85.630	2,617,623.470	
NISOURCE INC	42,287	23.880	1,009,813.560	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	99.350	1,725,212.750	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,737	316.030	4,657,334.110	
WELLS FARGO & CO	363,854	38.120	13,870,114.480	
NUCOR CORP	30,412	69.470	2,112,721.640	
CHENIERE ENERGY INC	22,945	71.950	1,650,892.750	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,952	123.910	5,322,182.320	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	83,516	27.060	2,259,942.960	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,712	234.110	2,039,566.320	
OGE ENERGY CORP	16,028	32.020	513,216.560	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,576	488.860	3,214,743.360	
ORACLE CORP	181,047	66.830	12,099,371.010	
PACCAR INC	32,876	90.690	2,981,524.440	
PTC INC	11,191	126.840	1,419,466.440	
EXELON CORP	91,025	42.930	3,907,703.250	
PARKER HANNIFIN CORP	12,236	308.330	3,772,725.880	
PAYCHEX INC	30,376	96.960	2,945,256.960	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,789	506.170	3,436,388.130	
PPL CORPORATION	71,320	28.420	2,026,914.400	
PEPSICO INC	127,370	138.810	17,680,229.700	
PENTAIR PLC	15,564	59.860	931,661.040	
PFIZER INC	514,931	35.610	18,336,692.910	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24,882	43.350	1,078,634.700	
CONOCOPHILLIPS	127,567	53.210	6,787,840.070	
PG&E CORP	123,999	11.310	1,402,428.690	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,838	161.300	3,199,869.400	

ALTRIA GROUP INC	172,675	49.510	8,549,139.250	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,478	170.250	6,721,129.500	
BROWN & BROWN INC	20,308	45.880	931,731.040	
GARMIN LTD	12,365	126.780	1,567,634.700	
PPG INDUSTRIES INC	22,331	148.160	3,308,560.960	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	202.830	680,088.990	
COSTCO WHOLESALE CORP	40,705	338.040	13,759,918.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	21,494	170.310	3,660,643.140	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	126.890	1,513,290.140	
PROCTER & GAMBLE CO	228,886	132.560	30,341,128.160	
PROGRESSIVE CORP	52,887	92.490	4,891,518.630	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	44,503	58.710	2,612,771.130	
PULTE GROUP INC	24,305	48.210	1,171,744.050	
GLOBAL PAYMENTS INC	27,987	201.670	5,644,138.290	
QUALCOMM INC	104,860	127.180	13,336,094.800	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	118.560	1,273,808.640	
EXACT SCIENCES CORP	13,911	130.320	1,812,881.520	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,427	162.980	884,492.460	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,504	460.320	4,374,881.280	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	123.190	751,089.430	
RESMED INC	13,286	192.180	2,553,303.480	
US BANCORP	126,797	53.470	6,779,835.590	
SEAGEN INC	11,631	140.190	1,630,549.890	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,383	37.250	1,280,766.750	
ROSS STORES INC	33,462	115.480	3,864,191.760	
ROLLINS INC	18,567	33.810	627,750.270	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,914	406.280	4,027,859.920	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,718	263.190	2,820,870.420	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,382	81.580	1,825,923.560	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	90.280	993,441.120	
ACCENTURE PLC-CL A	58,320	267.550	15,603,516.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	131,601	58.060	7,640,754.060	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,794	223.740	2,638,789.560	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,717	149.280	3,540,473.760	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	57,695	143.400	8,273,463.000	
BOOKING HOLDINGS INC	3,816	2,202.730	8,405,617.680	
SCHLUMBERGER LTD	136,684	27.420	3,747,875.280	
SCHWAB (CHARLES) CORP	142,703	64.120	9,150,116.360	
POOL CORP	3,532	340.100	1,201,233.200	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,694	157.450	3,100,820.300	
BUNGE LTD	13,304	75.530	1,004,851.120	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	59.280	631,509.840	
ANTHEM INC	23,210	360.870	8,375,792.700	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,836	115.370	1,596,259.320	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,038	57.950	1,450,952.100	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,614	724.150	5,513,678.100	
CENTENE CORP	55,308	64.940	3,591,701.520	
SVB FINANCIAL GROUP	5,018	487.420	2,445,873.560	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	65.260	740,766.260	
SNAP-ON INC	4,825	215.490	1,039,739.250	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	38,458	88.800	3,415,070.400	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	181.730	1,131,450.980	
EDISON INTERNATIONAL	35,041	59.930	2,100,007.130	
SOUTHERN CO	98,285	60.690	5,964,916.650	
TRUIST FINANCIAL CORP	126,093	55.820	7,038,511.260	
SOUTHWEST AIRLINES	15,436	57.700	890,657.200	
AT&T INC	659,624	29.990	19,782,123.760	
CHEVRON CORP	178,509	104.700	18,689,892.300	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,189	194.380	2,952,437.820	
STATE STREET CORP	32,404	79.860	2,587,783.440	
STARBUCKS CORP	108,834	104.970	11,424,304.980	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	46.070	808,390.290	
STRYKER CORP	31,488	233.810	7,362,209.280	
NETFLIX INC	40,985	520.810	21,345,397.850	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	21.060	1,030,992.300	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	44.660	437,355.380	
SYNOPSYS INC	14,700	233.050	3,425,835.000	
SYSCO CORP	45,296	77.650	3,517,234.400	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,978	711.070	7,806,126.460	
TELEFLEX INC	4,559	403.660	1,840,285.940	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	11.260	994,505.720	
TERADYNE INC	14,284	112.000	1,599,808.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	84,848	178.900	15,179,307.200	
TEXTRON INC	19,486	52.570	1,024,379.020	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	36,824	445.370	16,400,304.880	
GLOBE LIFE INC	8,329	96.650	804,997.850	
DAVITA INC	6,497	109.030	708,367.910	
TRACTOR SUPPLY CO	10,462	169.060	1,768,705.720	
TRIMBLE INC	22,442	70.930	1,591,811.060	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,013	411.330	1,650,667.290	
TYSON FOODS INC	27,929	73.570	2,054,736.530	

UGI CORP	20,072	40.700	816,930.400	
UNION PACIFIC CORP	62,263	212.900	13,255,792.700	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	141,137	75.550	10,662,900.350	
UNITEDHEALTH GROUP INC	87,873	370.600	32,565,733.800	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	133.480	1,032,734.760	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,139	176.440	1,436,045.160	
VF CORP	31,852	76.660	2,441,774.320	
VIACOMCBS INC	53,381	70.100	3,742,008.100	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,620	211.540	5,208,114.800	
VULCAN MATERIALS CO	12,170	160.550	1,953,893.500	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66,871	51.780	3,462,580.380	
WALMART INC	130,875	133.110	17,420,771.250	
WASTE MANAGEMENT INC	39,476	124.820	4,927,394.320	
WATERS CORP	5,810	269.050	1,563,180.500	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,393	278.080	2,055,845.440	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,306	123.140	1,269,080.840	
VAIL RESORTS INC	3,590	278.350	999,276.500	
WESTERN DIGITAL CORP	29,077	63.660	1,851,041.820	
WABTEC CORP	16,257	76.040	1,236,182.280	
WHIRLPOOL CORP	5,656	211.060	1,193,755.360	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,911	171.190	2,723,804.090	
WYNN RESORTS LTD	10,347	125.180	1,295,237.460	
NASDAQ INC	10,097	147.330	1,487,591.010	
CME GROUP INC	33,441	204.780	6,848,047.980	
WILLIAMS COS INC	117,323	23.490	2,755,917.270	
LKQ CORP	28,690	41.030	1,177,150.700	
ALLIANT ENERGY CORP	22,829	53.320	1,217,242.280	
WEC ENERGY GROUP INC	29,002	91.950	2,666,733.900	
CARMAX INC	15,805	128.350	2,028,571.750	
XILINX INC	23,520	119.960	2,821,459.200	
TJX COMPANIES INC	111,703	64.330	7,185,853.990	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,871	463.810	2,259,218.510	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	5.010	544,587.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	66.710	1,374,226.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	33.840	578,664.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,239	134.630	1,378,476.570	
CBRE GROUP INC	32,268	74.160	2,392,994.880	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	25.720	327,467.040	
REGIONS FINANCIAL CORP	85,582	19.920	1,704,793.440	

DOMINO'S PIZZA INC	3,641	366.220	1,333,407.020	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,737	330.990	1,236,909.630	
T-MOBILE US INC	52,107	122.360	6,375,812.520	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,277	59.160	1,791,187.320	
MOSAIC CO/THE	32,592	30.210	984,604.320	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,685	500.930	1,845,927.050	
CELANESE CORP	11,763	142.920	1,681,167.960	
DEXCOM INC	8,706	355.730	3,096,985.380	
DISCOVERY INC-A	14,886	61.940	922,038.840	
EXPEDIA GROUP INC	12,481	166.140	2,073,593.340	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	44.750	826,756.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,614	222.470	2,361,296.580	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	25.610	871,329.030	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	52,322	112.610	5,891,980.420	
LIVE NATION	13,804	81.550	1,125,716.200	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,528	1,422.960	3,597,242.880	
TRANSDIGM GROUP INC	4,745	592.820	2,812,930.900	
MASTERCARD INC	82,308	359.650	29,602,072.200	
WESTERN UNION CO	35,367	24.240	857,296.080	
OWENS CORNING	9,965	86.450	861,474.250	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	94.880	1,220,726.080	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	20.160	349,776.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,959	148.870	1,482,596.330	
DELTA AIR LINES INC	14,723	45.610	671,516.030	
INSULET CORP	6,122	263.630	1,613,942.860	
DISCOVER FINANCIAL	29,245	92.930	2,717,737.850	
TE CONNECTIVITY LTD	31,275	124.890	3,905,934.750	
MASIMO CORP	4,505	225.620	1,016,418.100	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,684	307.310	3,590,610.040	
VMWARE INC	7,464	144.540	1,078,846.560	
MERCADOLIBRE INC	4,207	1,387.850	5,838,684.950	
ULTA BEAUTY INC	5,136	301.000	1,545,936.000	
INVESCO LTD	33,443	23.250	777,549.750	
MSCI INC	7,870	424.030	3,337,116.100	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	143,903	88.550	12,742,610.650	
VISA INC	156,310	208.070	32,523,421.700	
KEURIG DR PEPPER INC	48,480	34.365	1,666,015.200	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,804	144.910	2,579,977.640	
DISCOVERY INC-C	30,421	54.540	1,659,161.340	
MARATHON PETROLEUM CORP	59,587	53.170	3,168,240.790	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	88.370	1,037,817.280	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	185,992	16.190	3,011,210.480	
XYLEM INC	17,743	101.110	1,793,994.730	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	102.130	2,516,074.680	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	194.120	676,314.080	
SPLUNK INC	14,641	134.940	1,975,656.540	
EPAM SYSTEMS INC	5,539	368.510	2,041,176.890	
ZILLOW GROUP INC	5,366	133.220	714,858.520	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	47.670	706,183.380	
HCA HEALTHCARE INC	25,277	184.590	4,665,881.430	
VERISK ANALYTICS INC	14,868	176.930	2,630,595.240	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,257	163.710	860,623.470	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,806	273.860	2,137,751.160	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,747	165.470	2,771,126.090	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,284	187.280	4,735,187.520	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	79.730	930,209.910	
LEAR CORP	4,681	170.840	799,702.040	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,472	103.060	1,079,244.320	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	67.305	1,362,455.110	
DOLLAR GENERAL CORP	23,373	197.080	4,606,350.840	
FORTINET INC	12,146	171.300	2,080,609.800	
HORIZON PHARMA PLC	21,512	82.120	1,766,565.440	
TESLA INC	70,248	630.270	44,275,206.960	
GENERAC HOLDINGS INC	6,112	296.880	1,814,530.560	
ENPHASE ENERGY INC	10,163	147.980	1,503,920.740	
GENERAL MOTORS CO	120,055	55.810	6,700,269.550	
XPO LOGISTICS INC	7,614	116.500	887,031.000	
ALLY FINANCIAL INC	33,857	43.470	1,471,763.790	
VOYA FINANCIAL INC	10,611	61.780	655,547.580	
APTIV PLC	25,523	139.850	3,569,391.550	
PHILLIPS 66	41,861	82.030	3,433,857.830	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	100.970	724,156.840	
FACEBOOK INC	222,734	282.140	62,842,170.760	
IQVIA HOLDINGS INC	18,388	186.110	3,422,190.680	
SERVICENOW INC	18,316	472.320	8,651,013.120	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,460	321.000	2,715,660.000	
WORKDAY INC	16,293	246.070	4,009,218.510	
ABBVIE INC	163,693	103.060	16,870,200.580	
ZOETIS INC	44,381	155.430	6,898,138.830	
NEWS CORP/NEW-CL A	37,019	25.450	942,133.550	

CDW CORP	12,768	156.410	1,997,042.880	
HOWMET AEROSPACE INC	38,127	30.350	1,157,154.450	
TWILIO INC	12,700	326.500	4,146,550.000	
COUPA SOFTWARE INC	6,246	253.000	1,580,238.000	
SNAP INC	87,156	50.510	4,402,249.560	
TRADE DESK INC A	4,006	668.060	2,676,248.360	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	19,546	43.270	845,755.420	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	44.320	368,919.680	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	44.180	627,576.900	
OKTA INC	11,797	218.590	2,578,706.230	
BLACK KNIGHT INC	16,065	73.500	1,180,777.500	
BAKER HUGHES CO	67,872	22.070	1,497,935.040	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	77.990	1,027,986.190	
ALTICE USA INC-A	21,506	34.010	731,419.060	
BROADCOM INC	37,518	457.270	17,155,855.860	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,799	308.170	2,095,247.830	
MONGODB INC	4,875	283.580	1,382,452.500	
BURLINGTON STORES INC	6,445	288.800	1,861,316.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	28.290	1,013,460.960	
VEEVA SYSTEMS INC	12,417	254.390	3,158,760.630	
TWITTER INC	71,674	62.060	4,448,088.440	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	58.040	766,940.560	
EVERGY INC	21,039	59.040	1,242,142.560	
ALLEGION PLC	9,022	121.650	1,097,526.300	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	80.800	925,483.200	
STERIS PLC	7,390	187.750	1,387,472.500	
DOCUSIGN INC	15,982	198.460	3,171,787.720	
WIX.COM LTD	4,918	277.760	1,366,023.680	
DROPBOX INC	28,170	26.540	747,631.800	
KKR & CO INC	47,267	47.980	2,267,870.660	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	18,206	314.960	5,734,161.760	
MODERNA INC	24,999	131.610	3,290,118.390	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,727	118.500	3,167,149.500	
ARAMARK	23,702	38.070	902,335.140	
CIGNA CORP	33,811	240.540	8,132,897.940	
DELL TECHNOLOGIES INC	22,587	86.350	1,950,387.450	
DOW INC	69,727	62.040	4,325,863.080	
AMCOR PLC	146,149	11.310	1,652,945.190	
PINTEREST INC	46,163	69.600	3,212,944.800	
PELOTON INTERACTIVE INC	22,084	101.790	2,247,930.360	
FOX CORP-A	31,751	40.120	1,273,850.120	
FOX CORP-B	13,009	37.950	493,691.550	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	15,857	181.600	2,879,631.200	
CHEWY INC	6,586	79.000	520,294.000	
AVANTOR INC	44,509	27.980	1,245,361.820	

DYNATRACE INC	15,949	48.040	766,189.960	
CLOUDFLARE INC	18,311	67.830	1,242,035.130	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	72.980	515,603.700	
CARRIER GLOBAL CORP	75,077	40.140	3,013,590.780	
OTIS WORLDWIDE CORP	37,535	67.170	2,521,225.950	
UBER TECHNOLOGIES INC	87,513	52.570	4,600,558.410	
CORTEVA INC	68,639	46.190	3,170,435.410	
MATCH GROUP INC	22,846	139.800	3,193,870.800	
SLACK TECHNOLOGIES INC	41,793	40.450	1,690,526.850	
BLACKSTONE GROUP INC	61,318	72.150	4,424,093.700	
CARLYLE GROUP INC	12,509	36.760	459,830.840	
10X GENOMICS INC	5,312	169.050	897,993.600	
DATADOG INC	16,194	81.260	1,315,924.440	
INGERSOLL RAND INC	31,282	48.340	1,512,171.880	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	364.370	1,577,722.100	
PPD INC	10,828	36.620	396,521.360	
AON PLC	21,269	225.210	4,789,991.490	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	223.460	1,578,521.440	
AIRBNB INC	4,882	178.850	873,145.700	
ZENDESK INC	11,922	129.010	1,538,057.220	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	43.350	730,924.350	
VIATRIS INC	112,866	14.010	1,581,252.660	
DRAFTKINGS INC	14,671	66.630	977,528.730	
SNOWFLAKE INC	2,127	208.600	443,692.200	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	284.460	1,434,247.320	
IHS MARKIT LTD	34,411	96.190	3,309,994.090	
FNF GROUP	24,567	38.840	954,182.280	
CATALENT INC	14,673	102.980	1,511,025.540	
SYNCHRONY FINANCIAL	51,026	39.490	2,015,016.740	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,668	42.240	1,802,296.320	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	134.470	464,862.790	
WAYFAIR INC	6,310	326.680	2,061,350.800	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	18,175	135.260	2,458,350.500	
HUBSPOT INC	4,272	438.040	1,871,306.880	
QORVO INC	10,168	171.790	1,746,760.720	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,947	151.640	446,883.080	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,950	156.840	2,344,758.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	28.750	489,267.500	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,257	267.590	1,139,130.630	
GODADDY INC	14,540	74.630	1,085,120.200	
ETSY INC	11,499	199.180	2,290,370.820	
TRANSUNION	16,760	88.350	1,480,746.000	
SQUARE INC	35,908	213.510	7,666,717.080	

	DUPONT DE NEMOURS INC	50,834	76.680	3,897,951.120	
	CARVANA CO	5,347	252.850	1,351,988.950	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	18,296	50.890	931,083.440	
	TELADOC HEALTH INC	10,454	181.990	1,902,523.460	
	WESTROCK CO	22,778	49.420	1,125,688.760	
	KRAFT HEINZ CO	61,360	38.230	2,345,792.800	
	NOVOCURE LTD	7,408	128.880	954,743.040	
	FORTIVE CORP	29,219	69.260	2,023,707.940	
	WASTE CONNECTIONS INC	25,225	105.750	2,667,543.750	
	ALPHABET INC-CL A	28,011	2,032.530	56,933,197.830	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	116,257	14.760	1,715,953.320	
	PAYPAL HOLDINGS INC	103,406	234.270	24,224,923.620	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	30.730	1,084,062.210	
	SUNRUN INC	10,000	55.250	552,500.000	
	ZILLOW GROUP INC-C	13,376	127.360	1,703,567.360	
	ALPHABET INC-CL C	27,322	2,045.060	55,875,129.320	
	ZSCALER INC	7,359	175.100	1,288,560.900	
	CABLE ONE INC	392	1,765.200	691,958.400	
	LINDE PLC	48,703	269.770	13,138,608.310	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	50.190	594,600.930	
	ROKU INC	10,265	318.450	3,268,889.250	
	AVALARA INC	7,102	128.520	912,749.040	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,000	651.560	8,470,280.000	
	VISTRA CORP	38,032	16.820	639,698.240	
アメリカ・ドル　小計		28,901,318		3,162,622,199.590 (344,346,305,094)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	41,197	16.855	694,375.430	
	ASHTEAD GROUP	43,256	43.280	1,872,119.680	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	22.810	500,291.730	
	BHP GROUP PLC	196,644	20.575	4,045,950.300	
	BARCLAYS PLC	1,652,001	1.842	3,042,985.840	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103,359	7.646	790,282.910	
	BT GROUP PLC	795,507	1.462	1,163,031.230	
	BUNZL PLC	28,834	23.180	668,372.120	
	AVIVA PLC	363,464	3.985	1,448,404.040	
	CRODA INTERNATIONAL	12,568	63.940	803,597.920	
	DIAGEO PLC	217,062	30.085	6,530,310.270	
	SCHRODERS PLC	11,354	35.450	402,499.300	
	DCC PLC	7,898	66.140	522,373.720	
	NATIONAL GRID PLC	329,689	8.622	2,842,578.550	
	KINGFISHER PLC	197,159	3.250	640,766.750	
	BAE SYSTEMS PLC	305,621	4.999	1,527,799.370	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	213,470	28.500	6,083,895.000	
	HALMA PLC	39,204	23.590	924,822.360	

NEXT PLC	11,467	76.680	879,289.560	
IMPERIAL BRANDS PLC	87,708	14.955	1,311,673.140	
JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	30.020	573,592.140	
ANGLO AMERICAN PLC	115,169	27.830	3,205,153.270	
COMPASS GROUP PLC	168,849	14.700	2,482,080.300	
HSBC HOLDINGS PLC	1,892,559	4.237	8,018,772.480	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	580,200	2.726	1,581,625.200	
UNILEVER PLC	242,987	40.560	9,855,552.720	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.792	412,539.900	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	9.100	616,197.400	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	95,487	6.808	650,075.490	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	23.300	726,167.800	
PEARSON PLC	65,009	7.860	510,970.740	
PERSIMMON PLC	28,126	29.450	828,310.700	
PRUDENTIAL PLC	236,277	15.535	3,670,563.190	
RIO TINTO PLC	103,874	54.220	5,632,048.280	
VODAFONE GROUP PLC	2,423,237	1.339	3,244,714.340	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	66,705	64.340	4,291,799.700	
RELX PLC	174,163	17.995	3,134,063.180	
RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	4.913	834,060.350	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	803,266	1.080	867,527.280	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.959	828,762.780	
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	12.660	630,328.740	
SSE PLC	101,064	14.290	1,444,204.560	
BP PLC	1,898,747	3.015	5,724,722.200	
SAGE GROUP PLC(THE)	108,448	6.014	652,206.270	
SMITHS GROUP PLC	40,317	14.750	594,675.750	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	114.300	751,408.200	
STANDARD CHARTERED PLC	240,093	4.880	1,171,653.840	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,710,308	0.422	2,831,749.970	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.781	617,640.110	
TESCO PLC	679,368	2.290	1,555,752.720	
3I GROUP PLC	88,651	11.520	1,021,259.520	
SMITH & NEPHEW PLC	76,928	13.420	1,032,373.760	
GLAXOSMITHKLINE PLC	468,929	12.848	6,024,799.790	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	28,904	70.800	2,046,403.200	
WPP PLC	111,598	9.294	1,037,191.810	
ASTRAZENECA PLC	121,980	71.300	8,697,174.000	
WHITBREAD PLC	18,594	33.480	622,527.120	
INTERTEK GROUP PLC	13,842	55.300	765,462.600	
BURBERRY GROUP PLC	38,950	19.935	776,468.250	

	INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	49.400	822,608.800	
	SAINSBURY (J) PLC	201,309	2.426	488,375.630	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	29.930	475,677.490	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,581	43.990	509,448.190	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	380,934	14.632	5,573,826.280	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	343,523	13.872	4,765,351.050	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,200	22.190	403,858.000	
	AVEVA GROUP PLC	10,408	33.900	352,831.200	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.894	597,069.820	
	EXPERIAN PLC	86,674	24.530	2,126,113.220	
	MONDI PLC	48,450	18.715	906,741.750	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	15.280	428,008.080	
	FRESNILLO PLC NPR	17,385	9.100	158,203.500	
	OCADO GROUP PLC	42,789	20.550	879,313.950	
	INFORMA PLC	128,510	5.690	731,221.900	
	GLENCORE PLC	939,882	2.781	2,613,811.840	
	ENTAIN PLC	49,618	15.400	764,117.200	
	EVRAZ PLC	48,765	5.338	260,307.570	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.162	356,338.420	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	22.790	346,590.320	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,721	7.204	372,598.080	
	FERGUSON PLC	20,531	86.420	1,774,289.020	
	M&G PLC	204,940	2.032	416,438.080	
	JD SPORTS FASHION PLC	50,883	8.180	416,222.940	
	AUTO TRADER GROUP PLC	107,290	5.732	614,986.280	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.691	718,125.420	
イギリス・ポンド　小計		27,349,039		154,530,472.900 (23,035,857,595)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	25.900	2,651,098.100	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	21.800	2,849,325.400	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	461.100	811,536.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	14.040	1,433,961.360	
	ICL GROUP LTD	88,694	19.830	1,758,802.020	
	NICE LTD	5,535	734.000	4,062,690.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	87.590	914,789.960	
	AZRIELI GROUP	4,414	212.400	937,533.600	
イスラエル・シュケル　小計		446,043		15,419,736.440 (506,846,737)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	68.100	1,147,757.400	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	265,715	28.000	7,440,020.000	

WESTPAC BANKING CORPORATION	337,983	24.190	8,175,808.770	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	153,517	19.350	2,970,553.950	
TELSTRA CORP LTD	364,409	3.300	1,202,549.700	
AMP LTD	302,414	1.385	418,843.390	
ASX LTD	19,162	72.250	1,384,454.500	
BHP GROUP LTD	273,735	44.880	12,285,226.800	
AMPOL LTD	20,946	24.940	522,393.240	
COMPUTERSHARE LT	56,367	14.990	844,941.330	
CSL LIMITED	42,459	266.020	11,294,943.180	
REA GROUP LTD	6,583	140.610	925,635.630	
TRANSURBAN GROUP	250,816	12.830	3,217,969.280	
COCA-COLA AMATIL LTD	52,693	13.450	708,720.850	
COCHLEAR LTD	7,124	213.080	1,517,981.920	
ORIGIN ENERGY LTD	195,801	4.740	928,096.740	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	164,811	86.370	14,234,726.070	
RIO TINTO LIMITED	33,859	109.700	3,714,332.300	
APA GROUP	118,205	10.120	1,196,234.600	
ARISTOCRAT LEISU	51,717	34.810	1,800,268.770	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	4.840	1,089,871.200	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.920	198,735.480	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,839	38.500	1,533,801.500	
ORICA LTD	41,311	14.020	579,180.220	
CIMIC GROUP LTD	8,709	17.750	154,584.750	
LEND LEASE CORP LTD	62,116	13.000	807,508.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	49,693	18.550	921,805.150	
SYDNEY AIRPORT	116,056	5.890	683,569.840	
MACQUARIE GROUP LTD	32,872	151.510	4,980,436.720	
SUNCORP GROUP LTD	117,454	9.990	1,173,365.460	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	310,028	25.840	8,011,123.520	
NEWCREST MINING LTD	73,202	25.050	1,833,710.100	
OIL SEARCH LTD	197,895	4.130	817,306.350	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	5.130	319,506.660	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	144,868	9.640	1,396,527.520	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93,404	10.250	957,391.000	
SANTOS LTD	159,618	7.060	1,126,903.080	
SONIC HEALTHCARE	40,148	35.060	1,407,588.880	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	30.970	260,333.820	
TABCORP HOLDINGS LTD	205,649	4.830	993,284.670	
WESFARMERS LTD	101,575	52.130	5,295,104.750	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	24.200	2,085,943.200	

	WOOLWORTHS GROUP LTD	119,554	40.330	4,821,612.820	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	45.970	459,470.150	
	SEEK LTD	39,505	27.810	1,098,634.050	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.825	301,245.450	
	AGL ENERGY LTD	49,076	10.340	507,445.840	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.310	1,311,081.460	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.840	389,074.240	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.320	608,964.480	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.910	587,086.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	10.900	628,570.300	
	XERO LTD	10,498	123.470	1,296,188.060	
	AFTERPAY LTD	18,322	107.500	1,969,615.000	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	2.910	823,978.140	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.700	1,113,331.500	
	COLES GROUP LTD	121,032	15.980	1,934,091.360	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	27.860	379,007.440	
オーストラリア・ドル　小計		6,691,349		130,788,437.080 (10,814,895,862)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	25,088	73.850	1,852,748.800	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	78,479	39.600	3,107,768.400	
	BARRICK GOLD CORP	169,916	25.300	4,298,874.800	
	ATCO LTD	7,193	41.130	295,848.090	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	27.870	592,850.640	
	BANK OF MONTREAL	60,468	110.560	6,685,342.080	
	BANK OF NOVA SCOTIA	113,110	78.150	8,839,546.500	
	NATIONAL BANK OF CANADA	32,775	86.860	2,846,836.500	
	BCE INC	14,959	57.420	858,945.780	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	121,186	56.560	6,854,280.160	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	38.710	1,091,312.320	
	SAPUTO INC	25,395	37.390	949,519.050	
	BLACKBERRY LTD	46,671	12.090	564,252.390	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	56,193	19.770	1,110,935.610	
	CGI INC	19,859	102.390	2,033,363.010	
	CCL INDUSTRIES INC	15,358	67.450	1,035,897.100	
	CAE INC	25,006	34.340	858,706.040	
	CAMECO CORP	32,627	21.120	689,082.240	
	ROGERS COMM-CL B	31,543	60.800	1,917,814.400	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,099	125.860	5,298,580.140	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,774	37.840	4,040,328.160	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	175.340	852,503.080	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	33.750	307,766.250	

CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,137	146.240	9,671,874.880	
YAMANA GOLD INC	84,317	5.620	473,861.540	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	37.290	593,321.190	
OPEN TEXT CORP	25,261	59.900	1,513,133.900	
EMPIRE CO LTD	15,093	38.620	582,891.660	
KINROSS GOLD CORP	138,786	8.330	1,156,087.380	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	71.220	709,564.860	
FORTIS INC	47,754	53.930	2,575,373.220	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	23.600	1,172,778.400	
TELUS CORP	31,890	26.150	833,923.500	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	33.180	837,795.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	30.210	650,783.820	
ENBRIDGE INC	189,707	46.300	8,783,434.100	
IGM FINANCIAL INC	6,069	39.100	237,297.900	
MANULIFE FINANCIAL CORP	185,900	26.680	4,959,812.000	
LOBLAW CO LTD	15,136	69.000	1,044,384.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,476	108.840	2,990,487.840	
SUN LIFE FINANCIAL INC	56,678	63.780	3,614,922.840	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	538.030	1,290,195.940	
METRO INC	27,229	56.870	1,548,513.230	
EMERA INC	22,433	55.460	1,244,134.180	
ONEX CORP	6,646	78.540	521,976.840	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	38.330	719,300.780	
POWER CORP OF CANADA	56,227	32.950	1,852,679.650	
QUEBECOR INC-B	16,042	35.260	565,640.920	
ROYAL BANK OF CANADA	131,481	115.960	15,246,536.760	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,706	448.750	5,701,817.500	
SHAW COMM INC-B	43,484	33.560	1,459,323.040	
SUNCOR ENERGY INC	138,967	26.560	3,690,963.520	
LUNDIN MINING CORP	64,310	13.110	843,104.100	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	23.260	954,032.160	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	110.150	1,657,647.350	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	92.500	686,072.500	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	167,311	81.570	13,647,558.270	
TC ENERGY CORP	88,954	58.720	5,223,378.880	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	78.300	563,760.000	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	107.690	665,954.960	
INTACT FINANCIAL CORP	12,515	152.970	1,914,419.550	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,993	47.720	1,956,185.960	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,959	1,734.690	3,398,257.710	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	17,652	153.690	2,712,935.880	

	B2GOLD CORP	101,675	5.670	576,497.250	
	KEYERA CORP	16,668	26.250	437,535.000	
	PARKLAND CORP	14,497	37.790	547,841.630	
	ALTAGAS LTD	23,944	20.590	493,006.960	
	PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	35.830	1,806,190.300	
	DOLLARAMA INC	26,906	51.740	1,392,116.440	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	9.650	1,155,191.850	
	NORTHLAND POWER INC	17,568	43.720	768,072.960	
	TMX GROUP LTD	5,058	129.750	656,275.500	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	41.630	909,199.200	
	INTER PIPELINE LTD	41,863	17.940	751,022.220	
	NUTRIEN LTD	54,998	68.460	3,765,163.080	
	SSR MINING INC	18,000	17.850	321,300.000	
	WSP GLOBAL INC	10,194	120.610	1,229,498.340	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,771	69.410	608,795.110	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	41.890	690,556.650	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	55.830	605,476.350	
	AIR CANADA	10,722	26.450	283,596.900	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	82.390	2,074,250.640	
	SHOPIFY INC	10,307	1,390.460	14,331,471.220	
	FIRSTSERVICE CORP	3,503	188.170	659,159.510	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	39.320	732,688.880	
	HYDRO ONE LTD	27,340	29.480	805,983.200	
カナダ・ドル　小計		3,702,760		203,050,108.440 (17,582,108,890)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.880	485,000.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	168,800	28.300	4,777,040.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.830	285,012.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.880	680,732.000	
	CAPITALAND LTD	232,915	3.710	864,114.650	
	GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.920	392,656.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.220	704,178.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	310,353	11.610	3,603,198.330	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	824,922	2.370	1,955,065.140	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	160,850	5.530	889,500.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	25.440	2,605,056.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.710	312,255.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	20.390	428,190.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	5.330	966,862.000	
シンガポール・ドル　小計		2,835,140		18,948,859.620 (1,532,962,743)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	236,603	12.235	2,894,837.700	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	95.840	1,382,875.360	
	NESTLE SA-REGISTERED	265,991	104.060	27,679,023.460	

	CIE FINANC RICHEMONT	49,203	90.600	4,457,791.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	64,801	304.650	19,741,624.650	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	271.500	941,290.500	
	SIKA INHABER	13,545	262.000	3,548,790.000	
	SGS SA-REG	540	2,757.000	1,488,780.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	205,397	80.610	16,557,052.170	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	159.500	679,310.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,094.000	554,910.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	18.945	378,502.150	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	504.000	1,254,456.000	
	ABB LTD	165,776	29.050	4,815,792.800	
	ADECCO GROUP AG-REG	16,592	63.420	1,052,264.640	
	GEBERIT AG	3,614	588.400	2,126,477.600	
	LONZA GROUP AG-REG	7,199	554.200	3,989,685.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	8,205.000	779,475.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	86,800.000	781,200.000	
	GIVAUDAN-REG	889	3,616.000	3,214,624.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,585	400.300	5,438,075.500	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,336	314.600	1,049,505.600	
	LAFARGEHOLCIM LTD	47,895	53.940	2,583,456.300	
	TEMENOS GROUP	5,723	139.050	795,783.150	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	253.000	1,188,594.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,444	272.500	1,483,490.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1,128.000	1,036,632.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,441	270.200	659,558.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	51.950	238,554.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	267.200	444,353.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,761	458.500	1,265,918.500	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	96.000	240,000.000	
	VIFOR PHARMA AG	4,645	125.150	581,321.750	
	EMS-CHEMIE HOLDING	827	836.000	691,372.000	
	SWISS PRIME SITE AG	6,341	93.200	590,981.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,658	1,205.000	1,997,890.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,118	61.500	1,237,257.000	
	SWISS RE LTD	27,418	92.820	2,544,938.760	
	ALCON INC	46,815	65.020	3,043,911.300	
	UBS GROUP AG	331,428	14.920	4,944,905.760	
スイス・フラン　小計		1,609,949		130,375,263.150 (15,170,465,620)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	62,938	515.000	32,413,070.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	437.700	15,779,522.700	
	ERICSSON LM-B SHS	264,968	114.400	30,312,339.200	
	LUNDBERGS B	7,382	471.800	3,482,827.600	
	SKF AB-B SHS	34,849	245.000	8,538,005.000	

	SANDVIK AB	103,400	233.000	24,092,200.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,990	109.350	15,854,656.500	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	229.000	7,248,537.000	
	SWEDBANK AB	79,825	161.600	12,899,720.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	158.600	8,397,077.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	101.150	14,083,114.500	
	VOLVO AB-B SHS	135,155	225.400	30,463,937.000	
	SWEDISH MATCH AB	13,845	665.000	9,206,925.000	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	115.400	5,430,147.000	
	INDUSTRIVARDEN A	11,955	320.800	3,835,164.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	309.200	3,525,807.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	257.900	4,949,358.900	
	SECURITAS AB-B SHS	39,647	144.900	5,744,850.300	
	INVESTOR AB-B SHS	43,274	684.400	29,616,725.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,493	206.500	16,002,304.500	
	ASSA ABLOY AB-B	96,038	238.700	22,924,270.600	
	TELIA CO AB	268,273	37.990	10,191,691.270	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	282.400	4,162,293.600	
	BOLIDEN AB	23,180	318.800	7,389,784.000	
	ALFA LAVAL AB	28,392	270.700	7,685,714.400	
	KINNEVIK AB-B	21,722	426.700	9,268,777.400	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	433.400	3,886,297.800	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	426.700	3,844,140.300	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	124.500	4,194,654.000	
	NIBE INDUSTRIER AB	28,834	266.000	7,669,844.000	
	HEXAGON AB	27,559	769.200	21,198,382.800	
	EPIROC AB-A	60,750	189.200	11,493,900.000	
	EPIROC AB-B	30,899	172.700	5,336,257.300	
	ESSITY AB-B	60,444	276.600	16,718,810.400	
	EQT AB	20,934	266.000	5,568,444.000	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	13,641	1,260.000	17,187,660.000	
	NORDEA BANK ABP	295,752	85.490	25,283,838.480	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	218.600	3,266,977.000	
スウェーデン・クローナ　小計		2,415,019		469,148,026.750 (5,934,722,538)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,374	982.000	10,187,268.000	
	A P MOLLER A/S	568	13,630.000	7,741,840.000	
	AP MOLLER MAERSK A	255	12,830.000	3,271,650.000	
	DANSKE BANK A/S	59,305	119.300	7,075,086.500	
	GENMAB A/S	6,582	2,020.000	13,295,640.000	
	NOVOZYMES-B SHS	17,740	400.900	7,111,966.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,528.000	2,055,264.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	160,056	422.100	67,559,637.600	

	GN STORE NORD A/S	12,895	488.100	6,294,049.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,955	1,132.500	21,466,537.500	
	COLOPLAST-B	10,734	954.600	10,246,676.400	
	DSV PANALPINA A S	19,707	1,156.500	22,791,145.500	
	DEMANT A/S	10,739	260.500	2,797,509.500	
	H LUNDBECK A/S	4,840	219.000	1,059,960.000	
	TRYG A/S	35,598	145.800	5,190,188.400	
	PANDORA A/S	8,251	651.000	5,371,401.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	564.600	5,271,105.600	
	AMBU A/S B	14,156	282.300	3,996,238.800	
	ORSTED A/S	18,119	983.200	17,814,600.800	
デンマーク・クローネ　小計		419,023		220,597,765.100 (3,816,341,336)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.440	820,081.440	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	15.210	454,687.740	
	A2 MILK CO LTD	85,759	9.040	775,261.360	
	FISHER & PAYKEL	49,044	31.400	1,539,981.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.420	705,533.660	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.590	406,827.060	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.250	651,850.500	
ニュージーランド・ドル　小計		620,442		5,354,223.360 (406,653,264)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,537	206.000	8,968,622.000	
	DNB ASA	80,709	179.300	14,471,123.700	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	49.890	6,437,606.040	
	TELENOR ASA	63,038	149.450	9,421,029.100	
	SCHIBSTED ASA	7,537	373.500	2,815,069.500	
	ORKLA ASA	65,283	84.320	5,504,662.560	
	EQUINOR ASA	95,078	167.800	15,954,088.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	431.900	6,561,856.700	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	208.400	3,476,737.200	
	ADEVINTA ASA	22,265	138.100	3,074,796.500	
	SCHIBSTED ASA	7,445	320.800	2,388,356.000	
ノルウェー・クローネ　小計		545,804		79,073,947.700 (1,002,657,657)	
ユーロ	CRH PLC	71,653	37.920	2,717,081.760	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	15,040	189.600	2,851,584.000	
	KERRY GROUP PLC-A	14,730	105.000	1,546,650.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	68.400	920,116.800	
	UMICORE	17,654	45.080	795,842.320	
	AIR LIQUIDE	43,785	136.100	5,959,138.500	
	AIRBUS SE	54,963	95.970	5,274,799.110	
	AXA SA	180,829	22.515	4,071,364.930	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,707	21.590	1,094,764.130	

ADIDAS AG	17,202	278.800	4,795,917.600	
ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	16.890	1,647,940.410	
DASSAULT AVIATION SA	295	930.500	274,497.500	
DANONE	58,282	58.300	3,397,840.600	
SAFRAN SA	30,006	116.650	3,500,199.900	
INTESA SANPAOLO	1,546,942	2.295	3,550,231.890	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,217	82.590	2,578,212.030	
ACCOR SA	17,380	32.520	565,197.600	
BOUYGUES	21,417	33.850	724,965.450	
BNP PARIBAS	105,045	51.120	5,369,900.400	
THALES SA	10,513	82.520	867,532.760	
CAPGEMINI SA	14,912	142.050	2,118,249.600	
UNICREDIT SPA	193,910	9.087	1,762,060.170	
NATIXIS	70,166	4.040	283,470.640	
KONINKLIJKE DSM NV	16,592	145.500	2,414,136.000	
COMMERZBANK AG	83,118	5.360	445,512.480	
EIFFAGE	9,074	86.640	786,171.360	
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,030	36.290	1,416,398.700	
UNITED INTERNET	9,882	35.500	350,811.000	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	40.780	226,165.880	
PUBLICIS GROUPE	22,295	50.440	1,124,559.800	
FAURECIA	6,117	44.550	272,512.350	
IBERDROLA SA	566,596	10.925	6,190,061.300	
ENI SPA	241,802	10.246	2,477,503.290	
JERONIMO MARTINS	19,517	13.395	261,430.210	
KESKO OYJ-B	24,085	24.900	599,716.500	
KBC GROUPE	24,938	62.280	1,553,138.640	
HANNOVER RUECK SE	4,868	153.900	749,185.200	
WARTSILA OYJ	34,935	9.032	315,532.920	
L'OREAL	23,123	318.200	7,357,738.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	25,744	553.400	14,246,729.600	
GEA GROUP AG	17,655	34.830	614,923.650	
BOLLORE	71,347	4.084	291,381.140	
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.462	543,516.200	
MICHELIN(CGDE)-B	16,415	124.500	2,043,667.500	
CONTINENTAL AG	10,336	110.900	1,146,262.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	93,399	44.620	4,167,463.380	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	28.340	600,978.040	
OMV AG	12,817	43.220	553,950.740	
VERBUND AG	6,924	61.500	425,826.000	
PERNOD-RICARD	19,038	158.300	3,013,715.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	15,330	84.680	1,298,144.400	
RENAULT SA	19,019	37.000	703,703.000	
REPSOL SA	135,990	10.690	1,453,733.100	
REMY COINTREAU	1,860	160.000	297,600.000	

MERCK KGAA	11,874	143.800	1,707,481.200	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	48,349	49.310	2,384,089.190	
RWE AG	59,273	32.540	1,928,743.420	
SEB SA	2,439	146.400	357,069.600	
SOCIETE GENERALE-A	79,846	22.110	1,765,395.060	
VINCI S.A.	49,066	87.920	4,313,882.720	
SODEXO	7,429	81.000	601,749.000	
SOFINA	1,382	287.500	397,325.000	
SOLVAY SA	7,183	106.350	763,912.050	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,922	124.950	6,237,753.900	
VIVENDI SA	80,900	28.140	2,276,526.000	
SAP SE	96,663	102.820	9,938,889.660	
TELEFONICA S.A	455,887	4.003	1,824,915.660	
TOTAL SE	233,708	40.065	9,363,511.020	
VALEO	19,653	28.180	553,821.540	
E.ON SE	209,842	9.150	1,920,054.300	
VOEST-ALPINE AG	9,875	34.760	343,255.000	
HENKEL AG & CO KGAA	8,602	81.500	701,063.000	
SIEMENS AG-REG	71,126	135.560	9,641,840.560	
UPM-KYMMENE OYJ	52,379	31.940	1,672,985.260	
ING GROEP NV-CVA	368,016	10.170	3,742,722.720	
PUMA AG	9,239	84.020	776,260.780	
BAYER AG	92,459	53.650	4,960,425.350	
STORA ENSO OYJ-R SHS	53,250	16.110	857,857.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,241	94.000	1,526,654.000	
DAIMLER AG	80,109	71.650	5,739,809.850	
BASF SE	86,200	69.980	6,032,276.000	
BEIERSDORF AG	8,371	89.220	746,860.620	
HOCHTIEF AG	1,707	73.350	125,208.450	
HEIDELBERGCEMENT AG	15,228	74.620	1,136,313.360	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	20,191	61.500	1,241,746.500	
ASM INTERNATIONAL NV	4,382	228.000	999,096.000	
ORANGE	184,093	10.425	1,919,169.520	
SAMPO OYJ-A SHS	47,480	36.730	1,743,940.400	
RANDSTAD NV	12,924	60.720	784,745.280	
ALLIANZ SE	38,200	212.550	8,119,410.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,662	4.902	1,169,921.120	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	99,280	23.140	2,297,339.200	
HERMES INTL	2,880	938.400	2,702,592.000	
ENDESA S.A.	27,736	22.300	618,512.800	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	11.025	308,589.750	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	29.270	708,451.080	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	13,275	261.200	3,467,430.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	22.660	1,395,720.040	

DASSAULT SYSTEMES SA	12,183	180.200	2,195,376.600	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,734	26.290	571,386.860	
HEINEKEN NV	22,683	87.920	1,994,289.360	
AKZO NOBEL	17,959	94.340	1,694,252.060	
ASML HOLDING NV	39,429	492.200	19,406,953.800	
AEGON NV	150,349	3.929	590,721.220	
VOLKSWAGEN AG	2,758	285.200	786,581.600	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,631	218.850	3,858,544.350	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	632,053	4.395	2,777,872.930	
KERING	6,827	571.200	3,899,582.400	
CNP ASSURANCES	13,987	16.100	225,190.700	
FORTUM OYJ	39,409	22.870	901,283.830	
AGEAS	14,365	49.670	713,509.550	
UCB SA	10,571	78.880	833,840.480	
NEMETSCHEK SE	5,095	54.500	277,677.500	
CARREFOUR SA	62,346	15.090	940,801.140	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	20.920	493,963.040	
ATOS SE	8,972	64.000	574,208.000	
NOKIA OYJ	518,532	3.385	1,755,230.820	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	85,907	47.210	4,055,669.470	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,406	72.000	1,901,232.000	
SANOFI	105,249	81.900	8,619,893.100	
STMICROELECTRONICS NV	58,060	31.250	1,814,375.000	
ELISA OYJ	13,642	52.320	713,749.440	
BANCO SANTANDER SA	1,632,228	2.877	4,695,919.950	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	14.485	687,356.700	
QIAGEN N.V.	20,763	41.400	859,588.200	
DEUTSCHE BANK AG-REG	171,364	10.614	1,818,857.490	
BMW VORZUG	4,116	65.550	269,803.800	
ENEL SPA	754,700	8.426	6,359,102.200	
COLRUYT NV	4,673	49.920	233,276.160	
VOPAK (KON.)	5,364	42.000	225,288.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	299,358	16.725	5,006,762.550	
SARTORIUS AG	3,044	440.600	1,341,186.400	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	63.620	488,983.320	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	123,689	34.455	4,261,704.490	
RATIONAL AG	479	668.000	319,972.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	130.000	490,230.000	
BECHTLE AG	2,511	159.800	401,257.800	
KONINKLIJKE KPN NV	347,824	2.889	1,004,863.530	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,330	81.510	923,508.300	
TELEPERFORMANCE	5,312	304.300	1,616,441.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	18,277	136.300	2,491,155.100	
EURAZEO	3,007	65.950	198,311.650	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	88.200	873,532.800	

HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	76.200	762,304.800	
INDITEX	100,423	27.970	2,808,831.310	
ESSILORLUXOTTICA	26,983	133.600	3,604,928.800	
SNAM SPA	171,294	4.662	798,572.620	
CREDIT AGRICOLE SA	113,047	12.065	1,363,912.050	
ORPEA	4,932	100.150	493,939.800	
ENAGAS	23,477	18.400	431,976.800	
WENDEL	2,220	103.000	228,660.000	
TENARIS SA	36,959	9.428	348,449.450	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.432	329,475.600	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.471	234,367.710	
ATLANTIA SPA	45,299	15.795	715,497.700	
ILIAD SA	1,046	159.400	166,732.400	
PROXIMUS	13,739	17.950	246,615.050	
SES FDR	28,847	7.164	206,659.900	
TERNA SPA	149,799	6.328	947,928.070	
BIOMERIEUX	3,248	108.400	352,083.200	
GRIFOLS SA	23,518	22.230	522,805.140	
FERROVIAL SA	49,718	21.740	1,080,869.320	
LANXESS AG	6,856	63.500	435,356.000	
NESTE OYJ	36,796	49.200	1,810,363.200	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	18.380	329,204.180	
RECORDATI SPA	10,303	45.190	465,592.570	
GALAPAGOS NV	3,426	66.240	226,938.240	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	9.484	524,503.130	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,873	196.300	956,569.900	
KONE OYJ	29,890	68.160	2,037,302.400	
ELIA GROUP	2,862	89.800	257,007.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	360.600	860,752.200	
ENGIE	166,061	11.965	1,986,919.860	
ALSTOM	25,045	40.950	1,025,592.750	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	11.290	618,443.620	
IPSEN SA	3,646	67.400	245,740.400	
DEUTSCHE WOHNEN	34,511	40.410	1,394,589.510	
ARKEMA SA	6,393	103.500	661,675.500	
LEGRAND SA	23,806	74.800	1,780,688.800	
AMPLIFON SPA	11,372	31.840	362,084.480	
ADP	2,313	102.100	236,157.300	
ORION OYJ	8,051	34.920	281,140.920	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	10.065	403,485.720	
SYMRISE AG	11,308	100.900	1,140,977.200	
SCOR SE	15,667	29.840	467,503.280	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,870	40.400	843,148.000	
PRYSMIAN SPA	22,328	26.260	586,333.280	
DIASORIN SPA	2,223	140.000	311,220.000	
CAIXABANK	307,331	2.604	800,289.920	

	BUREAU VERITAS SA	29,810	23.860	711,266.600	
	GETLINK	37,646	13.270	499,562.420	
	SUEZ SA	26,620	18.150	483,153.000	
	AMADEUS IT GROUP SA	41,118	58.200	2,393,067.600	
	BRENNTAG SE	14,044	71.200	999,932.800	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	29.870	511,254.920	
	EDENRED	21,488	44.610	958,579.680	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.372	233,369.220	
	LEG IMMOBILIEN SE	7,807	113.900	889,217.300	
	KION GROUP AG	5,903	78.460	463,149.380	
	VONOVIA SE	52,078	56.000	2,916,368.000	
	KNORR-BREMSE AG	6,860	101.140	693,820.400	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,805	46.380	1,104,075.900	
	FERRARI NV	11,542	169.550	1,956,946.100	
	CNH INDUSTRIAL NV	89,378	13.060	1,167,276.680	
	AROUNDTOWN SA	83,054	6.222	516,761.980	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	39.200	317,206.400	
	MONCLER SPA	17,567	48.180	846,378.060	
	FAURECIA SE	3,168	44.200	140,025.600	
	NEXI SPA	43,097	15.015	647,101.450	
	TEAMVIEWER AG	13,668	36.730	502,025.640	
	PROSUS NV	45,716	93.100	4,256,159.600	
	JDE PEET'S BV	7,308	31.280	228,594.240	
	SIEMENS ENERGY AG	35,831	29.380	1,052,714.780	
	WORLDLINE SA	23,128	70.840	1,638,387.520	
	NN GROUP NV	30,503	40.880	1,246,962.640	
	FINECOBANK SPA	53,818	14.015	754,259.270	
	ARGENX SE	4,588	242.800	1,113,966.400	
	ZALANDO SE	15,498	86.480	1,340,267.040	
	STELLANTIS NV	186,045	14.206	2,642,955.270	
	AENA SME SA	6,256	136.900	856,446.400	
	CELLNEX TELECOM SAU	32,090	44.940	1,442,124.600	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	77.240	836,972.640	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	10.330	353,812.830	
	EXOR NV	9,966	71.400	711,572.400	
	SCOUT24 AG	9,670	64.700	625,649.000	
	COVESTRO AG	16,337	54.120	884,158.440	
	HELLOFRESH SE	12,838	63.400	813,929.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	69,499	52.920	3,677,887.080	
	POSTE ITALIANE SPA	61,877	10.470	647,852.190	
	AMUNDI SA	5,924	67.200	398,092.800	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.300	217,099.200	
	ADYEN NV	1,655	1,896.000	3,137,880.000	
	UNIPER SE	18,203	31.120	566,477.360	
	DELIVERY HERO SE	12,739	109.250	1,391,735.750	

ユーロ　小計		17,180,819		409,069,015.090 (52,626,728,791)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	97.150	3,196,235.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.480	3,194,720.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.700	1,734,462.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,500	74.850	12,163,125.000	
	PCCW LTD	331,000	4.370	1,446,470.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	45.450	2,249,775.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	113,440	435.800	49,437,152.000	
	MTR CORP	126,000	43.950	5,537,700.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	147.900	9,717,030.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	33.100	3,821,395.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	134,500	45.300	6,092,850.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,075,292	12.060	12,968,021.520	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	197,000	67.500	13,297,500.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	27.800	8,826,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	37.950	6,188,354.700	
	SINO LAND CO	255,400	10.900	2,783,860.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,500	113.000	13,616,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	53.400	2,643,300.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	128,500	124.000	15,934,000.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	23.550	3,909,300.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.740	1,519,440.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	14.820	1,843,608.000	
	AIA GROUP LTD	1,123,827	92.750	104,234,954.250	
	HKT TRUST / HKT LTD	442,000	10.920	4,826,640.000	
	SANDS CHINA LTD	248,400	37.200	9,240,480.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.500	2,448,700.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	41.400	6,199,650.000	
	ESR CAYMAN LTD	147,400	23.850	3,515,490.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.830	1,800,900.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	23.250	3,501,450.000	
	WH GROUP LTD	897,000	6.960	6,243,120.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	255,332	61.000	15,575,252.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	47.950	10,780,694.400	
香港・ドル　小計		8,125,349		350,488,628.870 (4,913,850,577)	
合計		100,842,054		481,690,396,704	

			(481,690,396,704)	

（２）株式以外の有価証券

2021年3月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	108,972.000	1,038,503.160	
		GOODMAN GROUP	148,357.000	2,674,876.710	
		GPT GROUP	158,232.000	726,284.880	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	803,779.920	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,392,667.500	
		STOCKLAND	194,018.000	855,619.380	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	609,606.040	
	オーストラリア・ドル　小計		1,795,958.000	8,101,337.590 (669,899,606)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	880,744.060	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	369,636.000	783,628.320	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	401,907.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	515,891.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	291,992.000	
	シンガポール・ドル　小計		1,316,742.000	2,874,162.380 (232,519,737)	
投資信託受益証券　合計			3,112,700	902,419,343 (902,419,343)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	761,763.400	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,006.000	1,998,999.000	
		AMERICAN TOWER CORP	41,326.000	9,381,002.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,114,865.660	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,329.000	2,279,015.650	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,947.000	1,330,304.250	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	9,643.000	1,056,969.230	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	40,285.000	6,754,988.800	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,436.000	3,563,329.240	
		DUKE REALTY TRUST	31,929.000	1,340,698.710	
		EQUINIX INC	8,367.000	5,541,798.780	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,087.000	1,030,050.610	
		EQUITY RESIDENTIAL	36,160.000	2,586,524.800	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,390.000	1,765,493.100	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,782.000	1,674,058.540	

		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,924.000	1,721,318.160	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,091,660.640	
		INVITATION HOMES INC	50,475.000	1,569,772.500	
		IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	896,587.860	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,146,686.970	
		MID AMERICA	10,854.000	1,566,557.820	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	22,693.000	829,429.150	
		PROLOGIS INC	68,817.000	7,144,580.940	
		PUBLIC STORAGE	14,905.000	3,594,191.700	
		REALTY INCOME CORP	34,522.000	2,182,826.060	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	803,244.600	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,838.000	2,680,461.480	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	29,811.000	3,261,323.400	
		SUN COMMUNITIES INC	9,670.000	1,443,537.600	
		UDR INC	27,057.000	1,176,979.500	
		VENTAS INC	36,076.000	1,934,395.120	
		VEREIT INC	20,534.000	783,372.100	
		VICI PROPERTIES INC	47,083.000	1,267,945.190	
		VORNADO REALTY TRUST	18,506.000	836,286.140	
		WELLTOWER INC	39,719.000	2,827,198.420	
		WEYERHAEUSER CO	68,678.000	2,322,003.180	
		WP CAREY INC	15,529.000	1,073,209.190	
	アメリカ・ドル　小計		1,175,918.000	84,333,429.490 (9,182,223,802)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	359,009.290	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	389,169.860	
		SEGRO PLC	118,741.000	1,102,391.440	
	イギリス・ポンド　小計		244,403.000	1,850,570.590 (275,864,558)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	432,061.280	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	262,067.820	
	カナダ・ドル　小計		21,421.000	694,129.100 (60,104,639)	
	ユーロ	COVIVIO	4,663.000	335,969.150	
		GECINA SA	3,670.000	442,235.000	
		KLEPIERRE	17,099.000	342,492.970	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	873,392.000	
	ユーロ　小計		38,352.000	1,994,089.120 (256,539,565)	
	香港・ドル	LINK REIT	207,400.000	14,486,890.000	
	香港・ドル　小計		207,400.000	14,486,890.000 (203,106,198)	
投資証券　合計			1,687,494	9,977,838,762	

		(9,977,838,762)	
合計		10,880,258,105 (10,880,258,105)	

（注）投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

2．合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式	593銘柄	68.27	－	－	71.77
	投資証券	37銘柄	－	－	1.82	
イギリス・ポンド	株式	85銘柄	4.57	－	－	4.73
	投資証券	3銘柄	－	－	0.05	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.10	－	－	0.10
オーストラリア・ドル	株式	58銘柄	2.14	－	－	2.33
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.13	－	
カナダ・ドル	株式	87銘柄	3.49	－	－	3.58
	投資証券	2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.30	－	－	0.36
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式	40銘柄	3.01	－	－	3.08
スウェーデン・クローナ	株式	38銘柄	1.18	－	－	1.20
デンマーク・クローネ	株式	19銘柄	0.76	－	－	0.77
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.08	－	－	0.08
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.20	－	－	0.20
ユーロ	株式	234銘柄	10.43	－	－	10.74
	投資証券	4銘柄	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	33銘柄	0.97	－	－	1.04
	投資証券	1銘柄	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間（2021年3月26日から2021年9月25日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2021年3月25日現在	第3期中間計算期間末 2021年9月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	－	18,382,064
コール・ローン	14,128,493	21,100,173
親投資信託受益証券	3,594,842,899	7,933,299,234
未収入金	－	21,368,000
流動資産合計	3,608,971,392	7,994,149,471
資産合計	3,608,971,392	7,994,149,471
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,940,368	99,132,278
未払受託者報酬	219,838	666,717
未払委託者報酬	878,371	2,663,669
未払利息	－	5
その他未払費用	35,097	106,593
流動負債合計	14,073,674	102,569,262
負債合計	14,073,674	102,569,262
純資産の部		
元本等		
元本	2,782,334,703	5,295,289,181
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	812,563,015	2,596,291,028
（分配準備積立金）	421,395,305	381,225,819
元本等合計	3,594,897,718	7,891,580,209
純資産合計	3,594,897,718	7,891,580,209
負債純資産合計	3,608,971,392	7,994,149,471

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自　2020年3月26日 至　2020年9月25日	第3期中間計算期間 自　2021年3月26日 至　2021年9月25日
営業収益		
受取利息	－	19
有価証券売買等損益	189,019,140	720,695,335
営業収益合計	189,019,140	720,695,354
営業費用		
支払利息	673	1,201
受託者報酬	110,324	666,717
委託者報酬	462,086	2,663,669
その他費用	17,839	106,593
営業費用合計	590,922	3,438,180
営業利益又は営業損失（△）	188,428,218	717,257,174
経常利益又は経常損失（△）	188,428,218	717,257,174
中間純利益又は中間純損失（△）	188,428,218	717,257,174
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	26,071,014	47,037,960
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△141,553,253	812,563,015
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,435,926	1,262,009,135
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	27,435,926	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	1,262,009,135
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,935,249	148,500,336
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	148,500,336
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,935,249	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	37,304,628	2,596,291,028

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第3期中間計算期間 自　2021年3月26日 至　2021年9月25日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第2期 2021年3月25日現在	第3期中間計算期間末 2021年9月25日現在
１．　期首元本額	759,056,145円	2,782,334,703円
期中追加設定元本額	2,509,518,622円	2,950,406,739円
期中一部解約元本額	486,240,064円	437,452,261円
２．　受益権の総数	2,782,334,703口	5,295,289,181口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2021年3月25日現在	第3期中間計算期間末 2021年9月25日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 2021年3月25日現在	第3期中間計算期間末 2021年9月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2920円 (12,920円)	1.4903円 (14,903円)

（参考）

当ファンドは、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年9月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	48,259,685,688
コール・ローン	280,151,916
株式	586,098,483,179
投資信託受益証券	1,096,669,906
投資証券	12,637,702,796
派生商品評価勘定	5,330,902
未収入金	389,970,644
未収配当金	914,221,891
差入委託証拠金	4,224,319,603
流動資産合計	653,906,536,525
資産合計	653,906,536,525
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	547,654,676
未払解約金	42,358,805,000
未払利息	70
流動負債合計	42,906,459,746
負債合計	42,906,459,746
純資産の部	
元本等	
元本	110,100,054,395
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	500,900,022,384
元本等合計	611,000,076,779
純資産合計	611,000,076,779
負債純資産合計	653,906,536,525

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年3月26日 至　2021年9月25日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年9月25日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	104,889,479,890円
同期中追加設定元本額	39,741,003,242円
同期中一部解約元本額	34,530,428,737円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,584,094,741円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,439,076円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,900,373円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	15,493,999円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	22,569,438円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	13,727,730円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	11,716,633円
たわらノーロード　先進国株式	25,457,802,264円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	348,662,709円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,641,532,327円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	511,003,569円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	57,777,673円
たわらノーロード　バランス（標準型）	462,186,679円
たわらノーロード　バランス（積極型）	564,302,571円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	706,796円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	132,841,788円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	377,099,877円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	278,594,457円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	427,493,418円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	1,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	671,136円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	10,642,204円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,872,544円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,968,885円
たわらノーロード　全世界株式	135,123,443円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	48,985,916,732円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	1,429,552,074円
Ｏｎｅグローバルバランス	58,485円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	153,849,036円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	785,433,595円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,007,435,617円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	96,263,219円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	291,972,023円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	262,144,167円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	20,963,552円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	677,580,152円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	131,955,592円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	180,149,751円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	171,716,522円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	298,849,092円
投資のソムリエ	5,922,603,353円
クルーズコントロール	88,431,256円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	307,017,345円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	176,592,037円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	123,983,967円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	677,564円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	1,869,891円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	196,646,650円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,893,963,720円
ワールドアセットバランス（基本コース）	242,061,754円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	758,752,159円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	23,078,959円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	12,355,908円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,950,158円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	64,038,488円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	42,373,077円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,535,795,013円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	158,224,899円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	18,545,460円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	9,010,331円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	7,332,811円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	15,788,136円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	70,244円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	4,509,540円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	4,620,941円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	6,873,573円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	2,879,329円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	4,494,851円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	232,307,786円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	202,523,514円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	4,459,128円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	1,002,228,901円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	59,475,918円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,194,421,289円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,191,529,257円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,072,566,973円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	156,284,880円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,659,050円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	7,611,529円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	726,287円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,874,314円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	60,808,396円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,425,076円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,031,315円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,143,643円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	756,273円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,993,060円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,641,226円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	225,121,683円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	329,949,434円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,076,678,751円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	104,957,020円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	57,780,378円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	362,954,850円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	14,893,557円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,078,297円

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	143,072,916円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,467,531円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,449,178円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	70,645,393円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	161,930,792円
計	110,100,054,395円
２．　受益権の総数	110,100,054,395口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年9月25日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年9月25日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	42,576,786,488	－	43,101,709,490	△524,923,002
アメリカ・ドル	31,245,941,000	－	31,587,756,850	△341,815,850
イギリス・ポンド	1,789,512,000	－	1,820,005,200	△30,493,200
オーストラリア・ドル	829,300,500	－	847,245,000	△17,944,500
カナダ・ドル	1,514,026,837	－	1,552,582,159	△38,555,322
シンガポール・ドル	100,841,250	－	102,333,875	△1,492,625
スイス・フラン	1,238,337,760	－	1,251,896,784	△13,559,024
スウェーデン・クローナ	392,815,000	－	400,640,000	△7,825,000
デンマーク・クローネ	387,180,000	－	392,400,000	△5,220,000
ノルウェー・クローネ	80,460,800	－	82,368,000	△1,907,200

ユーロ	4,608,504,141	－	4,670,277,622	△61,773,481
香港・ドル	389,867,200	－	394,204,000	△4,336,800
合計	42,576,786,488	－	43,101,709,490	△524,923,002

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2021年9月25日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	10,718,615,827	－	10,701,215,055	△17,400,772
合計	10,718,615,827	－	10,701,215,055	△17,400,772

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

１． 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年9月25日現在
1口当たり純資産額	5.5495円
（1万口当たり純資産額）	(55,495円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	7,846,044,923円
Ⅱ　負債総額	30,149,811円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,815,895,112円
Ⅳ　発行済数量	5,308,194,257口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4724円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年9月30日現在

Ⅰ　資産総額	663,455,410,622円
Ⅱ　負債総額	30,136,702,276円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	633,318,708,346円
Ⅳ　発行済数量	115,505,591,889口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.4830円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（2021年9月30日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（2）会社の機構（2021年9月30日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長があたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年9月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,477,811,772,523
追加型株式投資信託	830	15,745,450,676,086
単位型公社債投資信託	28	60,443,549,223
単位型株式投資信託	218	1,335,153,410,848
合計	1,102	18,618,859,408,680

３【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第36期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		第35期 （2020年3月31日現在）		第36期 （2021年3月31日現在）
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		32,932,013		36,734,502
金銭の信託		28,548,165		25,670,526
有価証券		996		－
未収委託者報酬		11,487,393		16,804,456
未収運用受託報酬		4,674,225		5,814,654
未収投資助言報酬		331,543		317,567
未収収益		11,674		7,412
前払費用		480,129		724,591
その他		2,815,351		2,419,487
流動資産計		81,281,494		88,493,198
固定資産				
有形固定資産		1,278,455		1,119,327
建物	※1	1,006,793	※1	915,815
器具備品	※1	270,768	※1	202,902
建設仮勘定		894		609
無形固定資産		3,524,781		3,991,834
ソフトウエア		3,299,065		2,878,179
ソフトウエア仮勘定		221,784		1,109,723
電話加入権		3,931		3,931
投資その他の資産		9,482,127		11,153,554
投資有価証券		261,361		261,360
関係会社株式		5,299,196		5,299,196
長期差入保証金		1,302,402		1,324,203
繰延税金資産		2,508,004		3,676,823
その他		111,162		591,970
固定資産計		14,285,364		16,264,717
資産合計		95,566,859		104,757,915

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第35期（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第36期（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							△12,000,000	△12,000,000	△12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△ 7	△ 7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			△12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	△ 6	△ 6	73,353,137

重要な会計方針

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

（未適用の会計基準等）

1. 収益認識に関する会計基準等

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年３月31日　企業会計基準委員会）

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

・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2020年３月31日　企業会計基準委員会）

（1）概要

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

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

（2）適用予定日

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

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号　2019年７月４日　企業会計基準委員会）

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

・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号　2019年７月４日　企業会計基準委員会）

・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2020年３月31日　企業会計基準委員会）

（1）概要

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

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

（2）適用予定日

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

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年6月16日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第35期（2020 年3月31日現在）

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

第36期（2021年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
①非上場株式	259,369	259,369
②関係会社株式	5,299,196	5,299,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期（2020年3月31日現在）

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

第36期（2021年3月31日現在）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第35期（2020年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計			
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	2,988	3,000	△ 11
小計	2,988	3,000	△ 11
合計	2,988	3,000	△ 11

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

第36期（2021年3月31日現在）

（千円）

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

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

（注）上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～4.42%	1.00%～3.76%

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号　平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号　平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第35期 （2020年3月31日現在）	第36期 （2021年3月31日現在）
流動資産	－千円	－千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	－千円	－千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

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

のれん	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

（2）損益計算書項目

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

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

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	5,793,912	未払手数料	1,112,061
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	10,294,840	未払手数料	1,231,431

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,435,839	未払手数料	1,457,765
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	12,767,199	未払手数料	2,524,882

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

（1株当たり情報）

	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	第36期 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

(3) 通常の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(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

(5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2021年3月末日現在　　247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2021年3月末日現在

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
・委託会社の金融商品取引業者登録番号
・詳細情報の入手方法
①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
②請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
・目論見書の使用開始日
・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

２０２１年5月２６日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

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

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の２０２０年４月１日から２０２１年３月３１日までの第３６期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の２０２１年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２１年5月7日

アセットマネジメントOne株式会社

取 締 役 会　御 中

EY新日本有限責任監査法人

東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　丘 本　正 彦　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＯｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンドの２０２０年3月２６日から２０２１年3月２５日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンドの２０２１年3月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

２０２１年１１月５日

アセットマネジメントOne株式会社
取 締 役 会 御 中

EY新日本有限責任監査法人
東 京 事 務 所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘 本 正 彦

中間監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＯｎｅ ＤＣ 先進国株式インデックスファンドの２０２１年3月２６日から２０２１年9月２５日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Ｏｎｅ ＤＣ 先進国株式インデックスファンドの２０２１年9月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（２０２１年3月２６日から２０２１年9月２５日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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