

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 2022年1月12日提出

【計算期間】 ハイブリッド証券ファンド米ドルコース 第24特定期間  
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース 第24特定期間  
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース 第24特定期間  
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース 第24特定期間  
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース 第24特定期間  
ハイブリッド証券ファンド中国元コース 第24特定期間  
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース 第24特定期間  
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース 第17特定期間  
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース 第17特定期間  
ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド 第24期  
(自 2021年4月13日至 2021年10月12日)

【ファンド名】 ハイブリッド証券ファンド米ドルコース  
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース  
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース  
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース  
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース  
ハイブリッド証券ファンド中国元コース  
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース  
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース  
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース  
ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【事務連絡者氏名】 酒井 隆

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【電話番号】 03-6774-5100

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 第一部【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】

###### a. ファンドの目的及び基本的性格

###### 各通貨コース

各ファンドは、追加型投信 / 海外 / 債券に属し、主として投資信託証券に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

###### マネープールファンド

当ファンドは、追加型投信 / 国内 / 債券に属し、主としてわが国の短期公社債に実質的に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

委託者は、受託者と合意のうえ、各ファンドにつき金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

各ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、以下のように分類・区分されます。

##### 「各通貨コース」

###### 商品分類表

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資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。
債券	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債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

## 属性区分表

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分の定義

その他資産（投資信託証券（債券  その他債券））	投資信託証券への投資を通じて、実質的に債券  その他債券に投資を行います。
年12回（毎月）	目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（含む日本）	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世界（含む日本）の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジなし（注）	目論見書または投資信託約款において、為替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。

（注）属性区分の「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。

各ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。このため、組み入れている資産を示す「属性区分表」の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と、収益の源泉となる資産を示す「商品分類表」の投資対象資産（債券）とは異なります。

## 「マネープールファンド」

## 商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	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国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
債券	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債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

## 属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分の定義

その他資産（投資信託証券（債券一般））	投資信託証券への投資を通じて、実質的に債券一般に投資を行います。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	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。

当ファンドはファミリーファンド方式で運用します。このため、組み入れている資産を示す「属性区分表」の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と、収益の源泉となる資産を示す「商品分類表」の投資対象資産（債券）とは異なります。

商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

## ファンドの仕組み

## &lt;各通貨コース&gt;

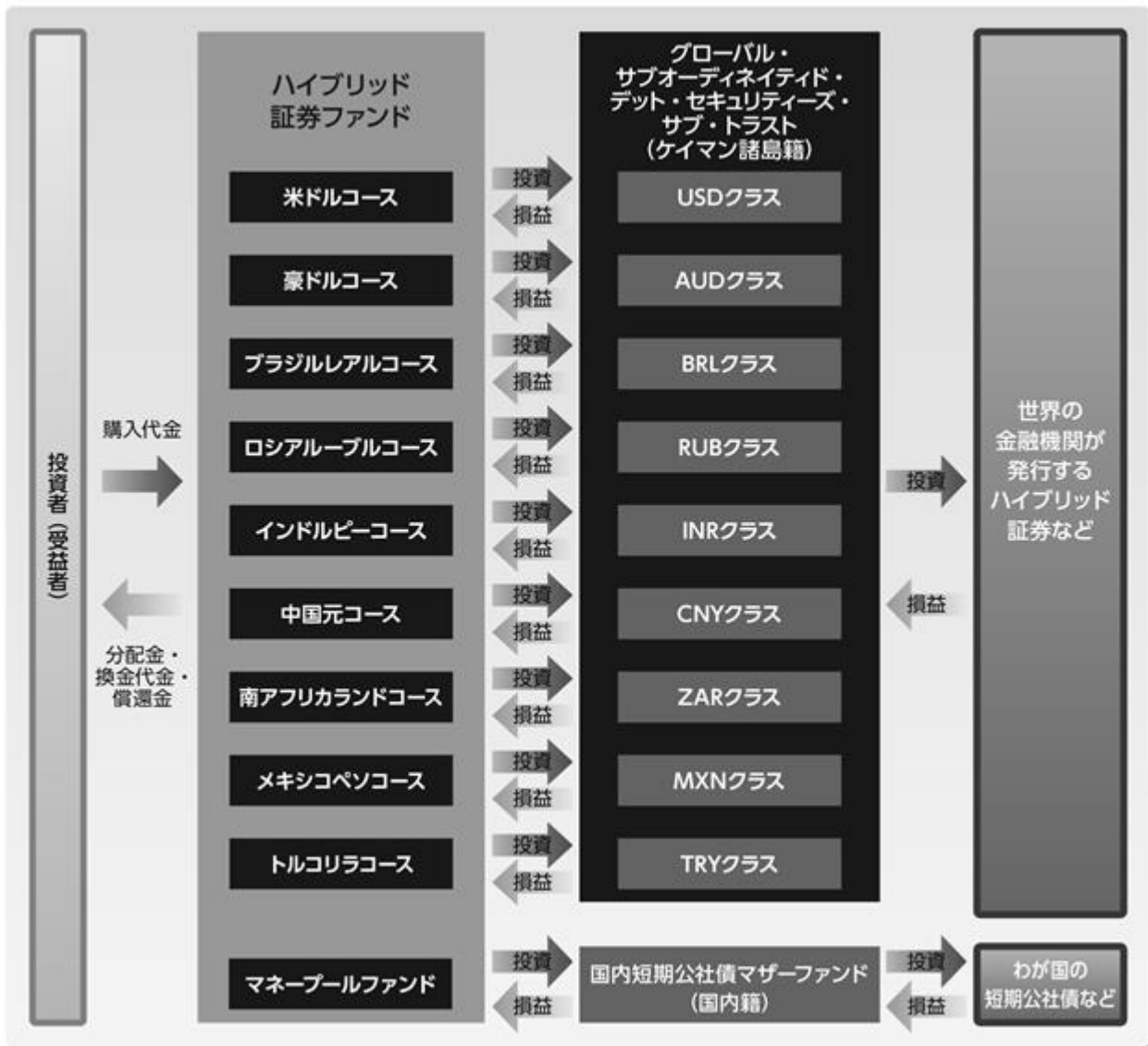
各通貨コースの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

ファンド・オブ・ファンズとは、投資信託証券への投資を目的とする投資信託のことで、一般に投資対象に選んだ複数の投資信託証券を組み入れて運用する仕組みを「ファンド・オブ・ファンズ方式」といいます。

## &lt;マネープールファンド&gt;

マネープールファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。



各通貨コースはケイマン諸島籍外国投資信託以外に国内短期公社債マザーファンドにも投資を行います。

グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラストの各クラスの受益証券は円建てで発行されます。

## b. ファンドの特色

ファンドの特色をよりご理解いただくため、「ハイブリッド証券ファンド」を構成する他のファンドに関する記載をする場合があります。

# 1 各通貨コースは、主として世界の金融機関が発行する債券や優先証券を実質的な投資対象とし、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

●各通貨コースは、ケイマン諸島籍外国投資信託「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト」(以下「サブデット・ファンド」という場合があります。運用:ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント)と国内投資信託「国内短期公社債マザーファンド」(運用:アセットマネジメントOne)を投資対象とするファンド・オブ・ファンズの形式で運用を行います。

※詳しくは後述の「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラストの特徴」および「ファンドの仕組み」をご覧ください。

●各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向などを勘案して決定するものとし、サブデット・ファンドの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。

※サブデット・ファンドが、償還した場合または商品の同一性が失われた場合は、委託会社は受託会社と合意のうえ投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

## 【マネープールファンド】

マネープールファンドは、国内短期公社債マザーファンド(以下「マザーファンド」という場合があります。)への投資を通じて、わが国の短期公社債に実質的に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

マネープールファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

※詳しくは後述の「ファンドの仕組み」をご覧ください。

※マザーファンドと同様の運用方針に基づき、わが国の短期公社債などに直接投資する場合があります。

※マネープールファンドは、各通貨コースからのスイッチング以外の購入のお申し込みはできません。

# 2 投資対象とする外国投資信託における為替取引の対象通貨や決算頻度の違いにより、10の通貨コースとその他にマネープールファンドがあります。また、各通貨コースおよびマネープールファンド間でのスイッチングが可能です。

●通貨コースは以下の10コースから選択できます。

各通貨コース				マネープールファンド
円コース	米ドルコース	豪ドルコース	ブラジル レアルコース	
ロシア ルーブルコース	インド ルピーコース	中国 元コース	南アフリカ ランドコース	
メキシコ ペソコース	トルコ リラコース			

●各通貨コースが投資対象とする外国投資信託では、原則として投資対象資産の発行通貨を売り予約し、各通貨コースの対象通貨を買い予約する為替取引を行います。

●円コースでは、実質的に円を買い予約する為替取引により、対円で為替ヘッジを行い為替変動リスクを軽減する運用を行いますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、為替変動の影響を受ける場合があります。

※スイッチングのお取り扱いの有無や対象ファンドなどは、販売会社により異なります。また、販売会社によっては一部のファンドのみのお取り扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社でご確認ください。



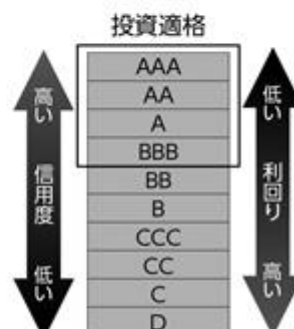
## グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラストの特徴

## 投資方針

主に世界の金融機関が発行する劣後債および普通社債等に投資しつつ、優先証券やCoCo債などにも分散投資を行うことにより、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行うことを目的とします。原則として、投資対象資産の発行通貨を売り予約し、各クラスの対象通貨を買い予約する為替取引を行います。  
なお、金融機関以外の事業法人の発行する普通社債や劣後債にも投資を行うことがあります。

## 主な投資制限

- 取得時点において、BBB-格(投資適格)相当以上の格付けを有する銘柄を投資対象とします。  
※取得後に格付けがBBB-格(投資適格)相当未満に下がる場合がありますが、市場環境や当該銘柄の投資判断に基づき、そのまま保有を継続することがあります。
- 同一発行体の証券への投資割合は、原則として純資産総額の10%以下とします。



## ゴールドマン・サックス・グループのご紹介

ゴールドマン・サックスは、1869年(明治2年)創立の世界の主要な金融機関のひとつであり、世界の主要都市に拠点を有し、世界中の政府機関・企業・金融機関などに対して、資産運用業務・投資銀行業務・証券売買業務・為替商品取引など、多岐にわたる金融サービスを提供しています。

## ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントは、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2021年9月末現在、グループ全体で約2兆1,467億米ドル(約239兆5,172億円、1米ドル=111.575円で換算)の資産を運用しています。

## 各通貨コースの収益の源泉

## 1. ハイブリッド証券への投資

## 1. ハイブリッド証券とは

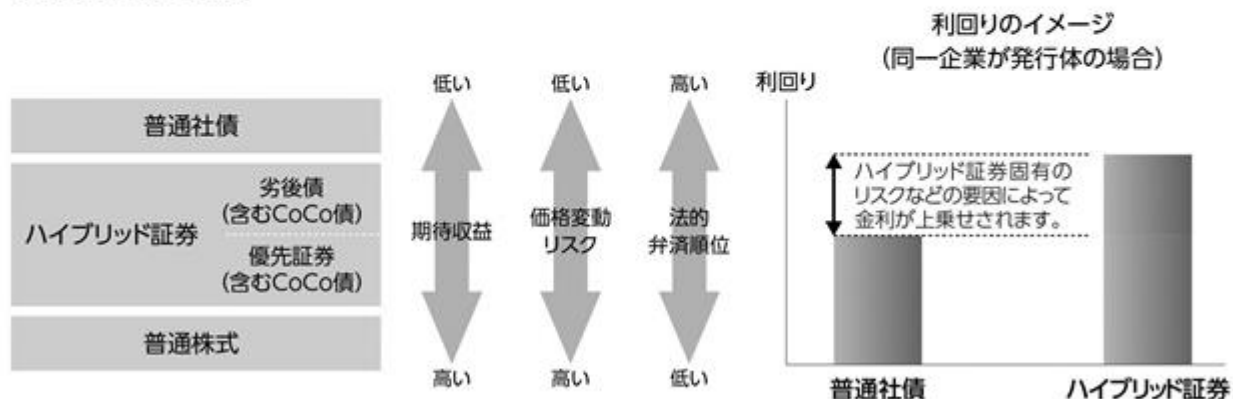
- 劣後債(期限付劣後債、永久劣後債)および優先証券などの総称です。
- 利息(または配当)が定められており、満期や繰上償還時に額面で償還されるなど、債券に類似した性質を持っています。一方、市場環境などにより利息(または配当)の支払いや繰上償還が見送られることがあり、発行体にとっては資本性を有するなど、株式に類似した性質も併せ持っています。
- 法的弁済順位からみると、債券と株式の中間に位置する証券であり、一般に、同一企業の発行するものであっても格付けが普通社債より低くなる一方で、利回りが高くなる傾向があります。
- ハイブリッド証券の中でも、期限付劣後債は、永久劣後債や優先証券とは異なり、一般に、普通社債と同様に利払い繰り延べがなく、相対的に流動性が高いという特徴を有しています。(発行体の債務不履行の場合は除きます。)なお、劣後債は優先証券より法的弁済順位が高く位置づけられています。

•ハイブリッド証券では、パーゼルⅢ\*<sup>1</sup>対応型の転換社債の一種であるCoCo債(Contingent Capital Securities:偶発転換社債)の発行が広がっています。CoCo債は、劣後債および優先証券などにおいて、偶発条件に関する条項が実質的に付帯されている仕組み\*<sup>2</sup>を有しているもので、従来のハイブリッド証券よりもリスクが高い一方、利回りが高くなる傾向があります。また、普通株式より弁済順位が劣後する可能性があります。

\*1 パーゼルⅢとは、主要国の中央銀行、監督当局が加盟するパーゼル銀行監督委員会が、国際業務を展開する銀行の健全性を維持するために示した、自己資本規制等に関する国際統一基準のことです。

\*2 CoCo債の仕組みの詳細については、以下「2 劣後債、優先証券およびCoCo債の特徴」の「3)CoCo債」をご覧ください。

※法的弁済順位とは、発行体が破綻などとなった場合における、債権者などに対する残余財産の弁済順位をいいます。弁済順位の高位のものから弁済されます。



## 2. 劣後債、優先証券およびCoCo債の特徴

### 1) 劣後債

劣後債は、①破産手続開始時の法的整理の決定がなされた場合に他の優先する債権が全額支払われない限り元利金支払請求権が発生しないこと(法的弁済順位の劣後)、②償還期限が少なくとも一般的に5年以上の期限を有する(期限付劣後債)もしくは期限がない(永久劣後債)など長い償還期限で発行されていることなど、株式に類似した性質を有していることが特徴です。

償還期限が長い(もしくは永久である)ことから、正式な期限の前に繰上償還(「コール」と呼ぶことがあります。)ができる条項が付与されているのが一般的です。また、発行体の財務状況などによりクーポン(利息)の支払いを繰り延べる条件が付与されている証券もあります。

### 2) 優先証券

優先証券は、①法的弁済順位が普通株式より優先されるものの劣後債より劣っていることから、劣後債と普通株式の中間に位置する証券です。また②償還期限の定めがないことから、劣後債よりも株式に近い性質を有しています。

償還期限の定めがないことから、繰上償還(コール)条項が付与されています。クーポン(利息/配当)の支払い繰り延べについては、発行体の任意で繰り延べることができる証券と、財務状況や収益動向によって強制的に繰り延べとなる証券があります。

### 3) CoCo債

パーゼルⅢ基準に対応した、金融機関が自己資本増強のために発行する転換社債の一種です。

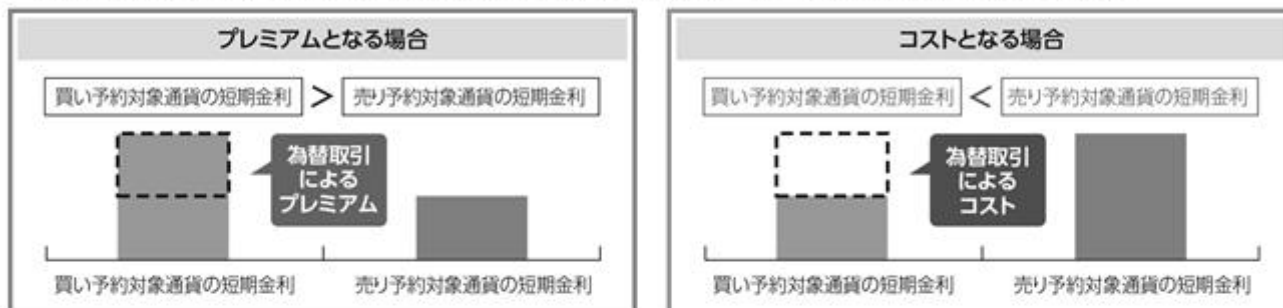
発行体が実質的破綻状態であると規制当局が判断した場合や特定の財務条項に抵触した場合など、あらかじめ定められた条件に抵触した場合に元本の全額または一部削減や普通株式への転換が破綻前に執行されるなどの仕組みを有しています。

なお、CoCo債の定義や条件は各国・地域の規制や発行体の業種、個別銘柄等により異なります。

※上記はあくまでも劣後債、優先証券およびCoCo債の一般的な特性の一部を記したものであり、すべての証券に当てはまるとは限りません。発行国の制度などにより異なる場合があります。

## 2. 為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)とコスト(金利差相当分の費用)

- ◆各通貨コースでは、原則として実質的に組み入れるハイブリッド証券などの発行通貨を売り予約し、各通貨コースの対象通貨を買い予約する為替取引を行います。
- ◆通貨(国)により金利水準は異なるため、ハイブリッド証券などの発行通貨よりも短期金利の高い通貨のコースを選択した場合は、当該通貨とハイブリッド証券などの発行通貨の短期金利差相当分のプレミアムが期待されます。  
一方、当該通貨の短期金利がハイブリッド証券などの発行通貨の短期金利よりも低い場合には、通常、短期金利差相当分のコストが発生します。金利差の変動により、プレミアムまたはコストは変動します。

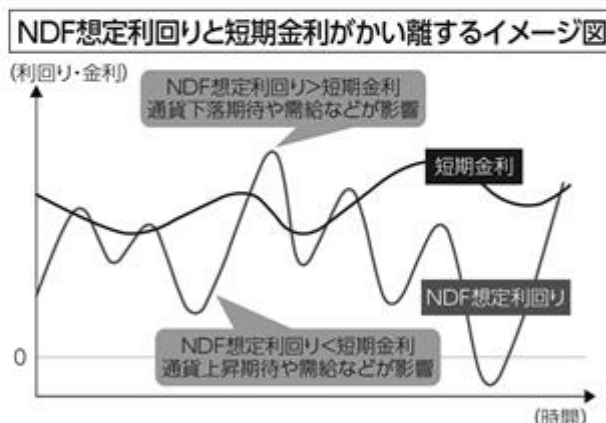


※上記の図はあくまでもイメージであり、実際の為替取引によって得られるプレミアムまたはコストの大きさを保証するものではありません。

- ◆一部の新興国通貨(ブラジルリアル、インドルピー、中国元)では、規制や為替市場が未発達なことなどから、為替取引が機動的に行えないことがあるため、「NDF取引」を使用する場合があります。

## NDF(ノン・デリバラブル・フォワード)取引について

- ◆NDF取引とは、為替先渡取引の一種で、主に金融機関との相対取引で行われます。また、当該通貨の受け渡しは発生せず、主に米ドルなどの主要通貨で差金決済を行います。
- ◆NDF取引は、通常の買い予約・売り予約する為替取引と比べ、取引参加者が少ないことや、当局による金融・資本市場における制約などから、市場裁定が働きにくいだけでなく、取引参加者の為替見通しを反映した需給の影響をより強く受けることがあります。そのため、取引価格から推計されるNDF想定利回りが、取引時点における短期金利水準から大きくかい離することがあります。



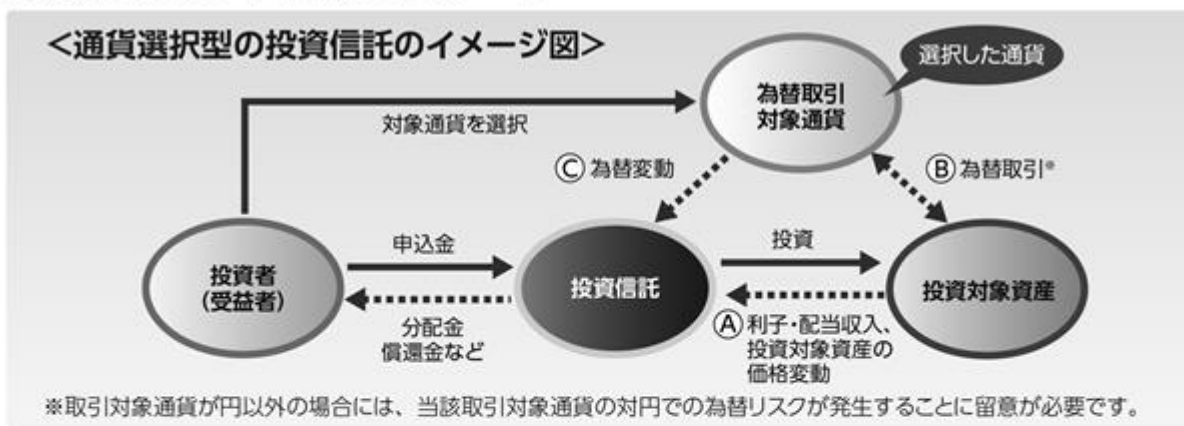
※上記はイメージ図であり、各ファンドのパフォーマンスとは異なります。

NDF想定利回りは、通貨に対する需給や通貨の上昇期待が反映され、マイナスになる場合もあります。その場合、為替取引によるプレミアムの減少やコストの発生により、ファンドのパフォーマンスに影響を与えることがあります。

## 3. 為替変動による損益(円コースを除く)

- ◆実質的に各通貨コースの対象通貨を買い予約する為替取引を行うことによって、各通貨コースは対象通貨の変動の影響を受けます。各通貨コースの対象通貨に対して円安となった場合には為替差益が発生し、円高となった場合には為替差損が発生します。新興国の通貨の値動きは先進国の通貨と比べて相対的に大きくなる傾向があります。また、通貨危機や経済危機においては大きく下落する可能性もあります。

## 通貨選択型ファンドの収益のイメージ



◆通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。

◆通貨選択型の投資信託の収益源としては、以下の3つの要素が挙げられます。

## ①投資対象資産による収益(上図A部分)

- ・投資対象資産が値上がりした場合や利子・配当が支払われた場合は、基準価額の上昇要因となります。
- ・逆に、投資対象資産が値下がりした場合には、基準価額の下落要因となります。

## ②為替取引によるプレミアム(金利差相当分の収益)(上図B部分)

- ・「選択した通貨」(コース)の短期金利が、投資信託の「投資対象資産の通貨」の短期金利よりも高い場合は、その金利差による「プレミアム」が期待できます。
- ・逆に、「選択した通貨」(コース)の短期金利のほうが低い場合には、「コスト」が生じます。
- ・なお、「選択した通貨」と「投資対象資産の通貨」が同一通貨の場合、為替取引によるプレミアムやコストは発生しません。
- ※新興国通貨の場合などは、金利差がそのまま反映されない場合があります。

## ③為替変動による収益(上図C部分)

- ・上図B部分とは異なり、上図C部分については為替取引を行っていないため、「選択した通貨」(円を除く。以下同じ)の円に対する為替変動の影響を受けることとなります。
- ・「選択した通貨」が対円で上昇(円安)した場合は、為替差益を得ることができます。
- ・逆に、「選択した通貨」が対円で下落(円高)した場合は、為替差損が発生します。

◆これまで説明しました内容についてまとめますと、以下のようになります。

これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

収益の源泉	利子・配当収入 投資対象資産の価格変動	為替取引による プレミアム/コスト	為替差益/為替差損
収益を得られる ケース	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資対象資産の市況の好転(金利の低下、発行体の信用状況の改善など)*</li> </ul> <p>投資対象資産 (ハイブリッド証券など) 価格の上昇</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・選択した通貨の短期金利が投資対象資産の通貨の短期金利を上回る</li> </ul> <p>プレミアム (金利差相当分の収益) の発生</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・選択した通貨が対円で上昇(円安)</li> </ul> <p>為替差益の発生</p>
損失やコストが 発生するケース	<ul style="list-style-type: none"> <li>・投資対象資産の市況の悪化(金利の上昇、発行体の信用状況の悪化など)*</li> </ul> <p>投資対象資産 (ハイブリッド証券など) 価格の下落</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・選択した通貨の短期金利が投資対象資産の通貨の短期金利を下回る</li> </ul> <p>コスト (金利差相当分の費用) の発生</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・選択した通貨が対円で下落(円高)</li> </ul> <p>為替差損の発生</p>

\*投資対象資産の価格の上昇/下落の要因は、資産の種類(株式、債券、不動産など)により異なります。

## ■ 分配方針

### 【各通貨コース】

原則として、毎月12日(休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

#### ●円コース/米ドルコース/豪ドルコース/ブラジルリアルコース/ロシアルーブルコース/インドルピーコース/中国元コース/南アフリカランドコース

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に安定した分配を行うことを目標に委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

「原則として、利子・配当等収益を中心に安定分配を行う」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移することなどを示唆するものではありません。また、基準価額水準、運用の状況などによっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

#### ●メキシコペソコース/トルコリラコース\*

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

\*メキシコペソコースとトルコリラコース(2013年7月11日設定)の分配方針の記載は、2012年6月1日より実施された一般社団法人投資信託協会によるルールに則ったものであり、実質的に他の通貨コースの分配方針と異なるものではありません。

◆上記にかかる分配金額のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。

◆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た運用を行います。

※運用状況により分配金額は変動します。

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

### 【マネープールファンド】

原則として、年2回(毎年4月、10月の各月12日。休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

◆分配金額は、委託会社が基準価額水準や市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

◆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た運用を行います。

※運用状況により分配金額は変動します。

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



## 収益分配金に関する留意事項

◆投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



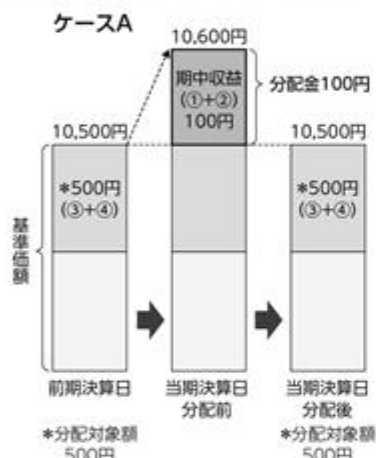
◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 分配金額と基準価額の関係(イメージ)

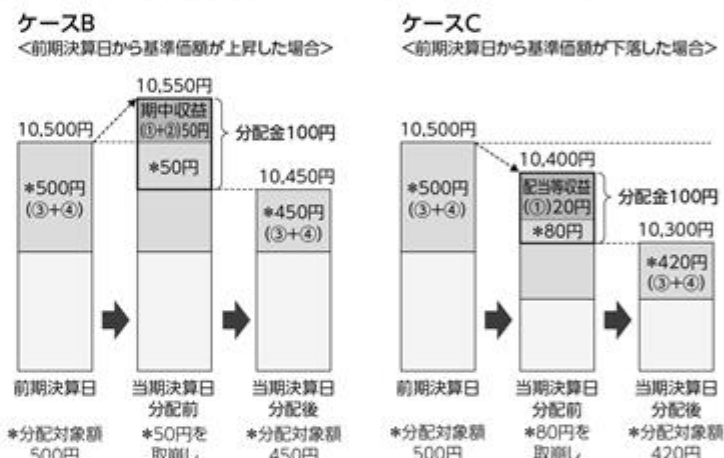
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益(経費控除後)、②有価証券売買益・評価益(経費控除後)、③分配準備積立金、④収益調整金

#### 計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合



#### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円  
 ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円  
 ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。  
 ※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

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

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(2) 【ファンドの沿革】

米ドルコース / 豪ドルコース / ブラジルリアルコース / ロシアループルコース / インドルピーコース / 中国元コース / 南アフリカランドコース / マネープールファンド

2009年11月16日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年1月15日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2015年7月13日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2019年1月12日	信託期間を2024年10月15日までに変更

メキシコペソコース / トルコリラコース

2013年7月11日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年1月15日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2015年7月13日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2019年1月12日	信託期間を2024年10月15日までに変更(当初は2019年10月15日まで)

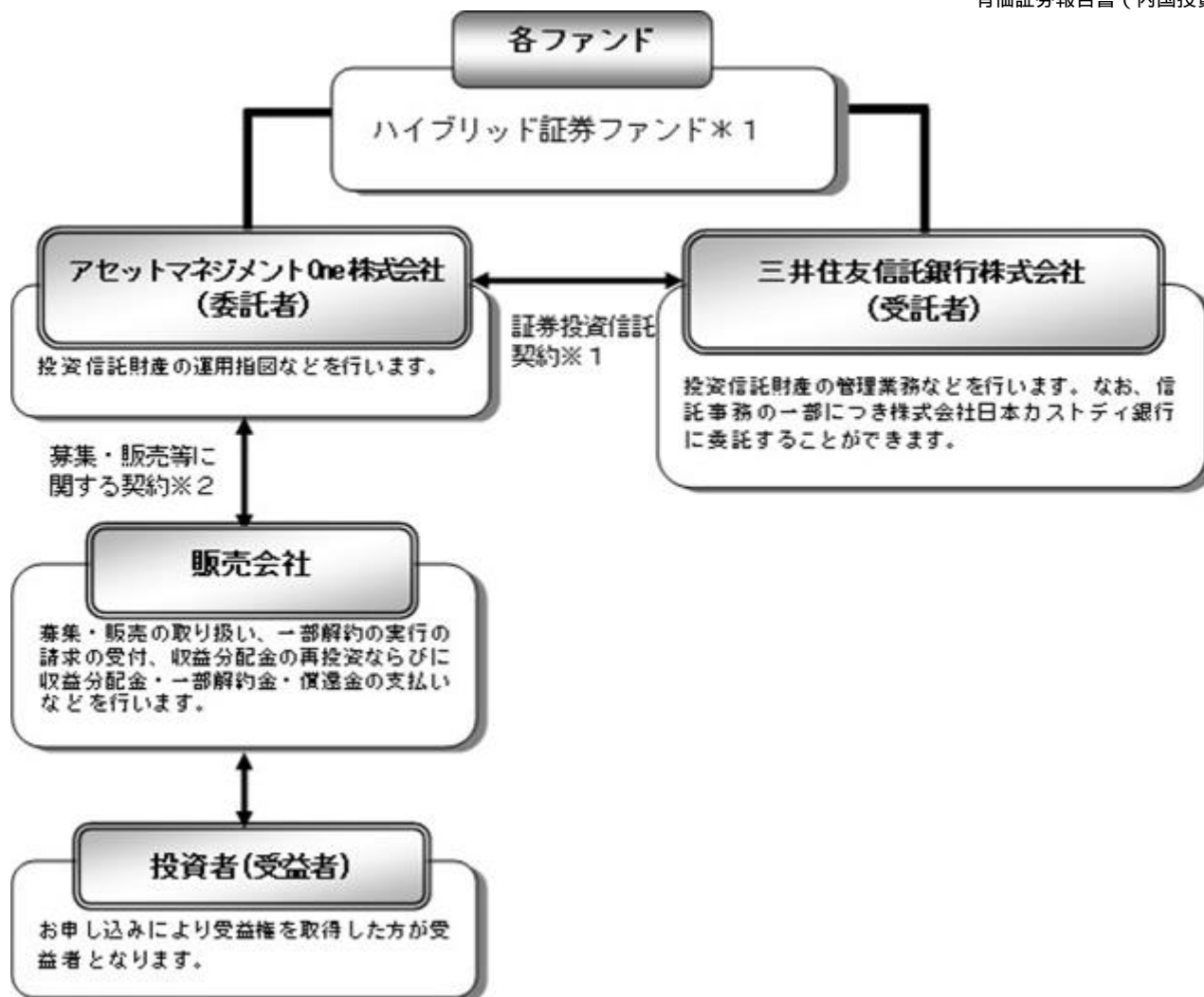
(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み

各通貨コース

図中の\*1、\*2には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

*1	米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	
*2	USDクラス	AUDクラス	BRLクラス	
*1	ロシアループルコース	インドルピーコース	中国元コース	南アフリカランドコース
*2	RUBクラス	INRクラス	CNYクラス	ZARクラス
*1	メキシコペソコース	トルコリラコース		
*2	MXNクラス	TRYクラス		



#### 1 証券投資信託契約

委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

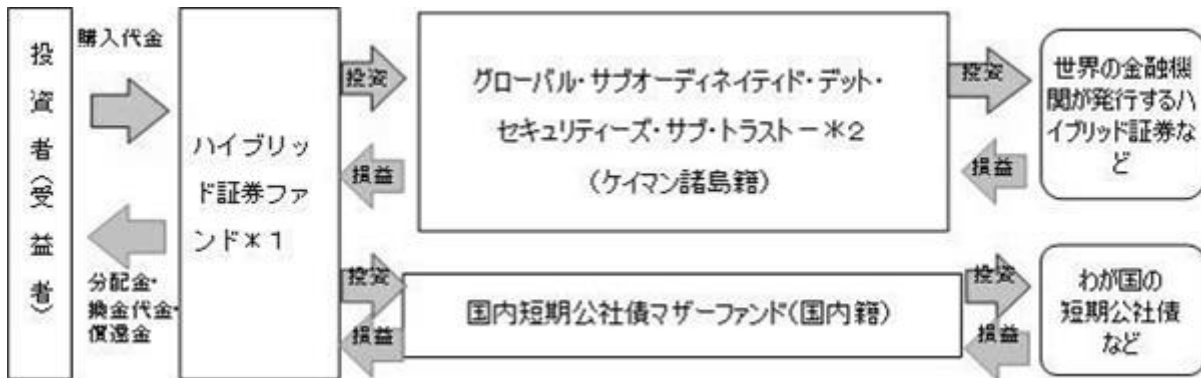
#### 2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

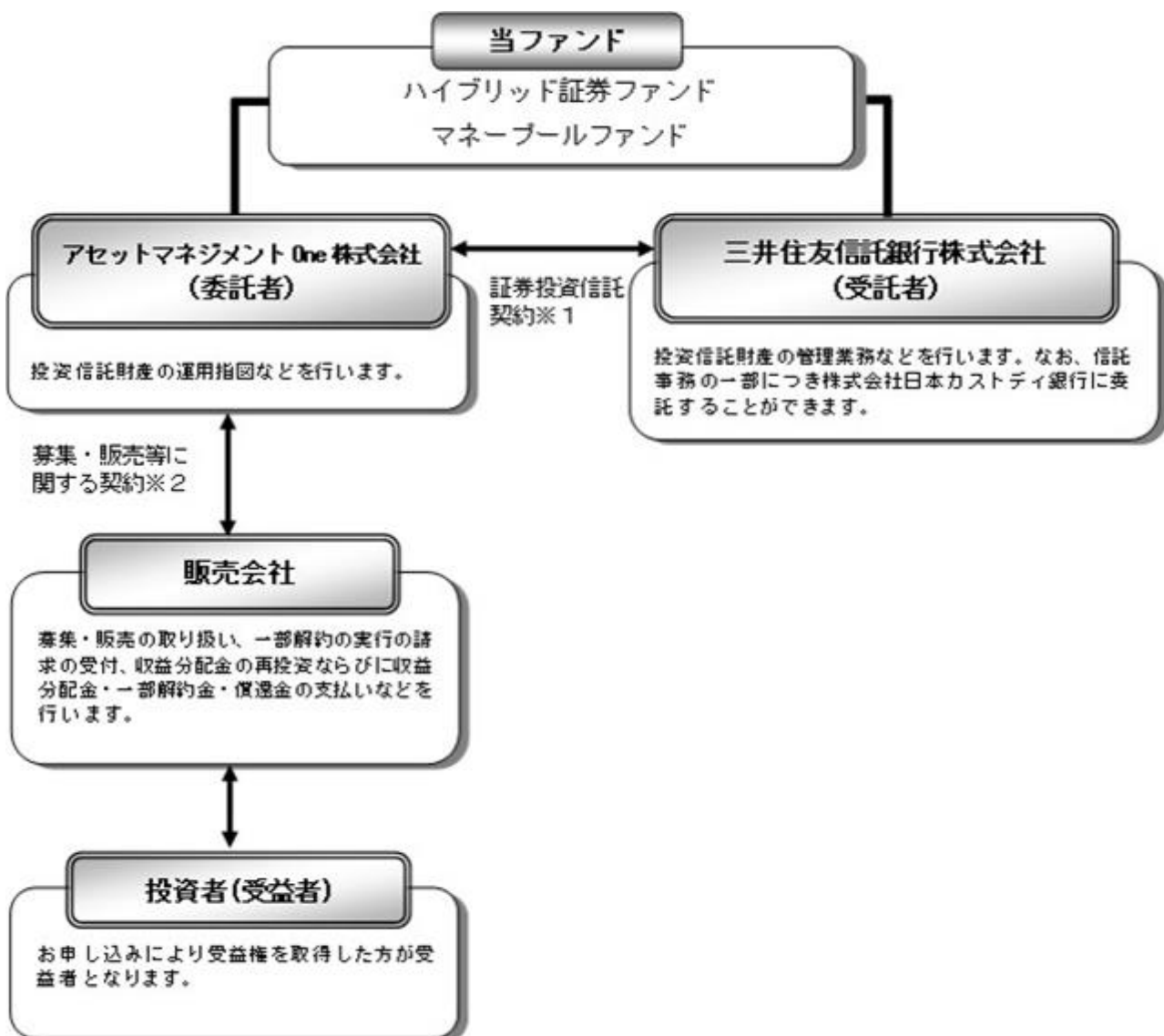


## &lt;ファンド・オブ・ファンズ方式の仕組み&gt;

各ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。「ファンド・オブ・ファンズ方式」とは、複数の投資信託証券を組み合わせ、一つにまとめて運用する仕組みです。



## マネープールファンド



1 証券投資信託契約

委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

b. 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10月29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10月29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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

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】

各通貨コースが投資する外国投資信託の\*には下記表をあてはめてご覧ください。

各通貨コース	外国投資信託 グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト -
米ドルコース	USDクラス
豪ドルコース	AUDクラス
ブラジルリアルコース	BRLクラス
ロシアルーブルコース	RUBクラス
インドルピーコース	INRクラス
中国元コース	CNYクラス
南アフリカランドコース	ZARクラス
メキシコペソコース	MXNクラス
トルコリラコース	TRYクラス

(注) 各通貨コースが組み入れる外国投資信託の各クラスの運用方針につきましては、後述の「各ファンドが投資する投資信託証券の概要」をご参照ください。

### (1)【投資方針】

#### a. 基本方針

##### 各通貨コース

各ファンドは、投資信託証券を主要投資対象として、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

##### マネープールファンド

当ファンドは、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

#### b. 運用の方法

##### (イ) 主要投資対象

##### 各通貨コース

投資信託証券を主要投資対象とします。

##### マネープールファンド

国内短期公社債マザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資する場合があります。

##### (ロ) 投資態度

##### 各通貨コース

以下の投資信託証券を通じて、主として世界の金融機関が発行する債券や優先証券に実質的に投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

ケイマン諸島籍外国投資信託

グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - \*  
（以下、「サブデット・ファンド」といいます。）円建受益証券

内国証券投資信託（親投資信託）

国内短期公社債マザーファンド受益証券

各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向などを勘案して決定するものとし、サブデット・ファンドの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。

各ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

サブデット・ファンドが、償還した場合または約款に規定する事項の変更により商品の同一性が失われた場合は、委託者は受託者と合意のうえ投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### マネープールファンド

マザーファンドへの投資を通じて主として本邦通貨建ての短期公社債に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

マネープールファンドのマザーファンドの運用方針につきましては、「各ファンドが投資する投資信託証券の概要」をご参照ください。

### (2) 【投資対象】

#### a. 投資の対象とする資産の種類

##### 各通貨コース

各ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ. 有価証券

ロ. 金銭債権

ハ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

##### マネープールファンド

当ファンドにおいて投資の対象とする資産(本邦通貨表示のものに限ります。)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

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

#### b. 有価証券および金融商品の指図範囲等

##### 各通貨コース

(イ) 委託者は、信託金を、主として次の第1号に掲げる外国投資信託の受益証券および第2号に掲げるアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内短期公社債マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、第3号から第7号に掲げる有価証券(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. ケイマン諸島籍外国投資信託 グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - \* (以下、「サブデット・ファンド」といいます。) 円建受益証券
2. 証券投資信託 マザーファンド受益証券
3. コマーシャル・ペーパー
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
5. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
7. 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。)

なお、第1号に掲げる外国投資信託の受益証券および第2号に掲げる証券投資信託の受益証券を以下「投資信託証券」といい、第5号の証券を以下「公社債」といいます。公社債にかかる運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引(売り戻し条件付きの買い入れ)および債券貸借取引(現金担保付き債券借り入れ)に限り行うことができるものとします。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

#### マネープールファンド

(イ) 委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された国内短期公社債マザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券(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。有価証券は、本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券(新株引受権証券と社債券と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。新株予約権付社債については、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(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。以下同じ。)に限ります。)

5. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  6. 転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。 )の行使により取得した株券
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。 )
  8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。 )
  9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。 )
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  12. 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。 )
  13. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )
  14. 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。 )
  15. 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。 )
  16. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  17. 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。 )
  18. 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。 )
  19. 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
  20. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第6号の証券および第11号ならびに第15号の証券または証書のうち第6号の証券の性質を有するものを以下「株式」といい、第1号から第5号までの証券および第13号の証券のうち投資法人債券ならびに第11号および第15号の証券または証書のうち第1号から第5号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第12号および第13号の証券(投資法人債券を除きます。 )を以下「投資信託証券」といいます。
- (ロ) 委託者は、信託金を、上記(イ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することを指図することができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。 )
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

#### c. 先物

##### マネープールファンドのみ

(イ) 委託者は、わが国の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。 )ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。 )。

(ロ) 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### d. スワップ

##### マネープールファンドのみ

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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。

(ロ) 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。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資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投資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投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

(ニ) 上記(ハ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資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投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(ホ) 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。

(ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

#### e. 金利先渡取引

##### マネープールファンドのみ

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。



- (ロ) 金利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、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。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資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投資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投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。 )を超えないものとし、なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有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当該保有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、委託者は、すみやかに、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、
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの投資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投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資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投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引の評価は、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、
- (ヘ) 委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとし、

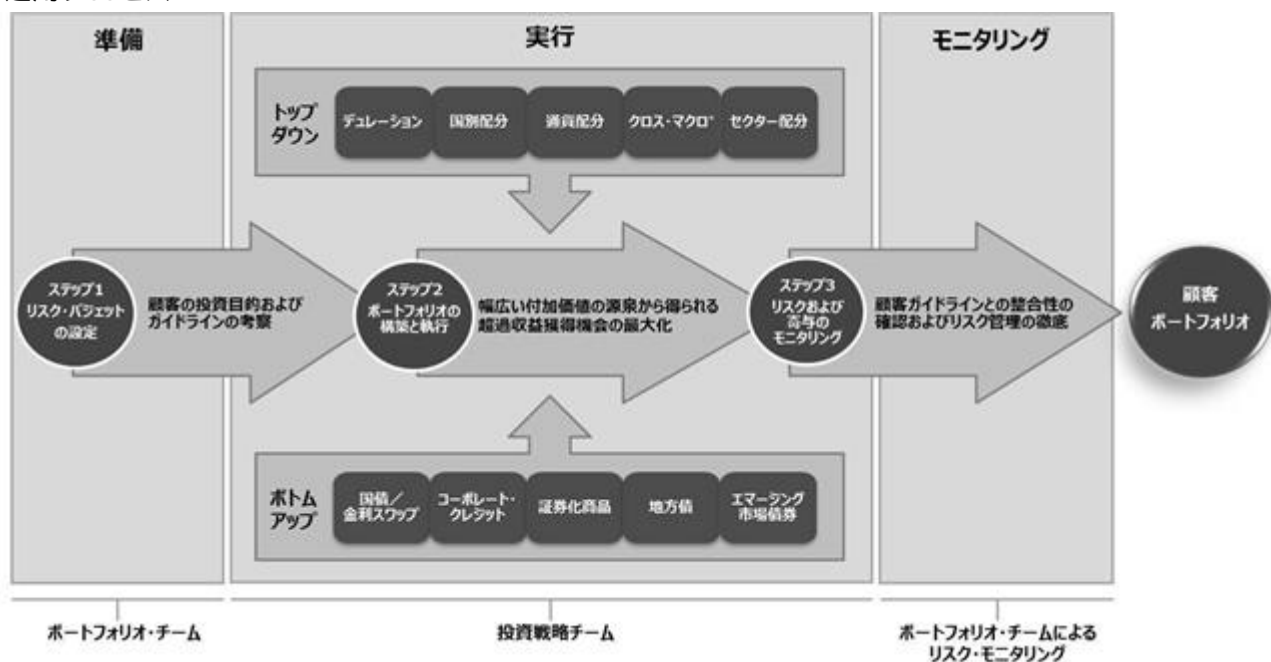
## 各ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - USDクラス/AUDクラス/BRLクラス/RUBクラス/INRクラス/CNYクラス/ZARクラス/MXNクラス/TRYクラス (以下、当概要において、個別クラスを「クラス」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託/円建受益証券
運用方針	<p>主に世界の金融機関が発行する劣後債および普通社債等に投資しつつ、優先証券やCoCo債などにも分散投資を行うことにより、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行うことを目的とします。なお、金融機関以外の事業法人の発行する普通社債や劣後債にも投資を行うことがあります。</p> <p>原則として、買付時において、投資適格(BBB-格)相当以上の格付けを有する証券に投資します。</p> <p>米ドル以外の通貨建債券へ投資した場合、原則として債券の発行通貨売り/米ドル買いの為替取引を行います。そのうえで、クラスごとに以下の為替取引を行います。</p> <p>USDクラス：原則として、為替取引は行いません。</p> <p>AUDクラス：原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。</p> <p>BRLクラス：原則として、米ドル売り、ブラジルリアル買いの為替取引を行います。</p> <p>RUBクラス：原則として、米ドル売り、ロシアルーブル買いの為替取引を行います。</p> <p>INRクラス：原則として、米ドル売り、インドルピー買いの為替取引を行います。</p> <p>CNYクラス：原則として、米ドル売り、中国元買いの為替取引を行います。</p> <p>ZARクラス：原則として、米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行います。</p> <p>MXNクラス：原則として、米ドル売り、メキシコペソ買いの為替取引を行います。</p> <p>TRYクラス：原則として、米ドル売り、トルコリラ買いの為替取引を行います。</p>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・同一発行体の証券への投資割合は、原則として純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・金融機関以外の事業法人が発行する普通社債や劣後性証券への投資割合の合計は、原則として純資産総額の20%以下とします。</li> <li>・他ファンドへの投資は、純資産総額の5%以内とします。</li> <li>・有価証券の空売りは行わないものとします。</li> <li>・純資産総額の10%を超える借り入れは行わないものとします。</li> <li>・流動性に欠ける資産への投資は、純資産総額の15%以内とします。</li> <li>・通常の状態において、日本において有価証券に属する証券に純資産総額の50%以上を投資します。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年3月31日

関係法人	投資顧問会社：ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー 副投資顧問会社：ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社 ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル 受託会社：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー(ケイマン)リミテッド 管理事務代行会社兼保管受託銀行：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
信託報酬等	純資産総額に対し年率0.55% 上記料率には、投資顧問会社、副投資顧問会社、受託会社、管理事務代行会社兼保管受託銀行への報酬が含まれます。 この他に、株式登録機関兼名義書換事務代行会社の報酬、監査報酬、弁護士費用、当初設定にかかる諸費用などが投資信託財産から支払われます。
収益分配方針	原則として、毎月、分配を行います。
設定日	2009年11月16日(USDクラス/AUDクラス/BRLクラス/RUBクラス/INRクラス/CNYクラス/ZARクラス) 2013年7月11日(MXNクラス/TRYクラス)

上記投資信託証券については、資金流入にともない発生する取引費用などによる当該投資信託証券の純資産への影響を軽減するため、純資産価格の調整が行われることがあります。純流入額が純資産総額に対し所定の割合を超える場合には純資産価格が上方へ調整され、逆に純流出額が純資産総額に対し所定の割合を超える場合には純資産価格が下方に調整されます。したがって、資金流入の動向が純資産価格に影響を与えることになります。

### 運用プロセス



\* 「クロス・マクロ」とは、トップダウンのマクロ経済分析において、各資産クラス間から生じる非効率性を捉えることで収益を上げる戦略をいいます。

上記の運用プロセスは、ハイブリッド証券を含む債券全般に係る運用プロセスです。

運用プロセスがその目的を達成できる保証はありません。

運用プロセスは2021年10月29日時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

（出所）ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントのデータを基にアセットマネジメントOne  
作成

ファンド名	国内短期公社債マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。</li> <li>・ファンドの資金動向、市況動向などによっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資は行いません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年10月31日（休業日の場合は翌営業日）
収益分配方針	運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	2008年7月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

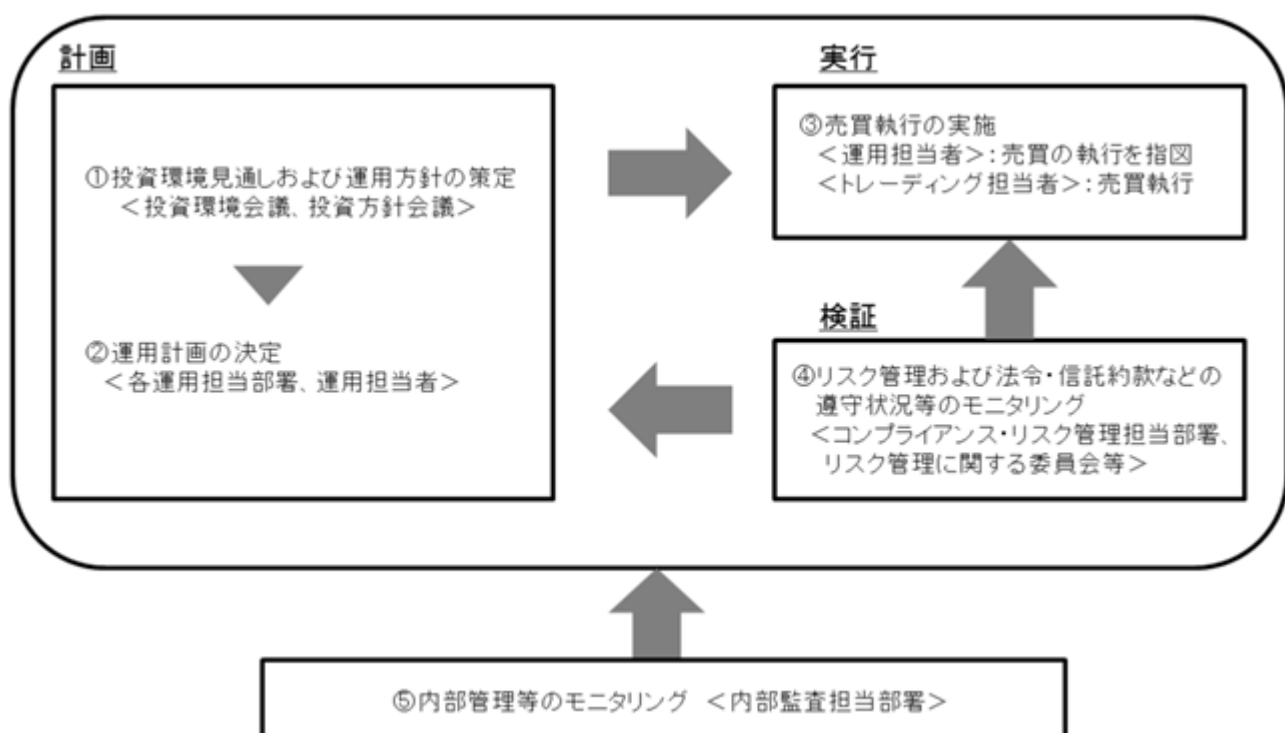
前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。

また、各概要は2022年1月12日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

### （3）【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年10月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

マネープールファンドについては、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】

##### 各通貨コース

a. 収益分配は原則として、毎月12日(該当日が休業日の場合は翌営業日。)の決算時に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利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
2. 分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に安定した分配を行うことを目標に委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
3. 上記2.にかかわらず、上記2.にかかる分配金額のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。
4. 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た運用を行います。

##### マネープールファンド

a. 収益分配は年2回、原則として、4月、10月の各月12日(該当日が休業日の場合は翌営業日。)の決算時に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利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
2. 分配金額は、委託者が基準価額水準や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には、分配を行わないことがあります。
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た運用を行います。

##### b. 収益分配方式

##### 各通貨コース

投資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. 分配金、配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等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利益金額は、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った後、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。

##### マネープールファンド

投資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. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等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った後、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。

c. 損失の繰り越し

各ファンド共通

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

d. 分配金の取り扱い

各ファンド共通

「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払われます。

「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

(5) 【投資制限】

各通貨コース

投資信託約款に定める投資制限

a. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

c. 公社債の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借り入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借り入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 借り入れの指図は、当該借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り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。

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券(外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。)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。

e. 外国為替予約の指図

委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産(外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。)について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

f. 資金の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、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り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、資金借り入れ(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。

(ロ) 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投資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

開始日から投資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投資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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払わ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。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

g. 利害関係人等との取引等

(イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者(第三者との間において投資信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。)および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

(ロ) 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができます。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

(ハ) 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。)または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

(ニ) 上記(イ)(ロ)(ハ)の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

h. デリバティブ取引等に係る投資制限

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投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

i. 信用リスク集中回避のための投資制限

(イ) 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えないものとします。

(ロ) 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投資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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

j. ファンドの投資制限



投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外には投資を行いません。

#### マネープールファンド

投資信託約款に定める投資制限

##### a. 株式への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

なお、株式は転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得したものに限りします。

上記において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じ。

##### b. 投資信託証券への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

##### c. 投資する株式等の範囲

(イ) 委託者が投資することを指図する株式は、わが国の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、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、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

(ロ) 上記(イ)の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

##### d. 同一銘柄への投資制限

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(ロ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

##### e. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

f．有価証券の貸し付けの指図および範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

- 1．株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- 2．公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資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。

(ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

(ハ) 委託者は、有価証券の貸し付けにあたって必要と認めたときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

g．公社債の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借り入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借り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。

(ロ) 借り入れの指図は、当該借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する借り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。

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

h．資金の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、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り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、資金借り入れ（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。

(ロ) 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投資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投資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投資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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払わ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。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

i．利害関係人等との取引等

(イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において投資信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係

人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

(ロ) 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができます。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

(ハ) 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。)または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

(二) 上記(イ)(ロ)(ハ)の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

j. デリバティブ取引等に係る投資制限

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投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

k. 信用リスク集中回避のための投資制限

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投資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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

法令に定める投資制限

a. 同一法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率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取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのもつリスク

各ファンドは、投資信託証券への投資を通じて値動きのある有価証券等(各通貨コースが投資する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。

各ファンド共通

##### a. 信用リスク

公社債などの格付けの引き下げ等は、基準価額の下落要因となります。

公社債などの信用力の低下や格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合には、当該公社債などの価格は下落します。これらの影響を受け、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

##### b. 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。

有価証券などを売買する際、当該有価証券などの市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、希望する時期に、希望する価格で、希望する数量を売買することができない可能性があります。特に流動性の低い有価証券などを売却する場合にはその影響を受け、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

各通貨コースが実質的に投資対象とするハイブリッド証券は、一般に市場における流動性が相対的に低いため、市況によっては大幅な安値での売却を余儀なくされる可能性があることから、大きなリスクを伴います。

##### c. 金利変動リスク

金利の上昇(公社債の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

公社債の価格は、金利水準の変化にともない変動します。一般に、金利が上昇した場合には公社債の価格は下落し、各ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

各通貨コース

##### d. ハイブリッド証券(劣後債および優先証券など)への投資に伴う固有のリスク

ハイブリッド証券への投資は、普通社債と比較して相対的にリスクが大きくなります。

ハイブリッド証券(劣後債および優先証券など)への投資には、普通社債への投資と比較して、次のような固有のリスクがあり、価格変動リスクや信用リスクは相対的に大きいものとなります。

また、ハイブリッド証券に関する規制や税制などの変更があった場合、これらのリスク特性が一部変化する可能性があります。

##### 劣後リスク(法的弁済順位が劣後するリスク)

一般にハイブリッド証券の法的な弁済順位は株式に優先し、普通社債より劣後します。したがって、発行体が破綻などに陥った場合、他の優先する債権が全額支払われない限り、元利金の支払いを受けることができません(法的弁済順位の劣後)。またハイブリッド証券は一般に普通社債と比較して低い格付けが格付会社により付与されていますが、その格付けがさらに下落する場合には、ハイブリッド証券の価格が大きく下落する可能性があります。加えて、ハイ

ブリッド証券の中でもCoCo債は発行体が実質的破綻状態であると規制当局が判断した場合や特定の財務条項に抵触した場合など、元本の全額または一部削減や普通株式への転換が破綻前に執行される可能性があり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、普通株式に転換された場合には、株価変動リスクを負うこととなります。したがって、状況によって普通株式より弁済順位が劣後する可能性があります。

#### 繰上償還延期リスク

一般にハイブリッド証券には、繰上償還(コール)条項が付与されています。繰上償還日に償還されることを前提として取引されている証券は、市場環境などの要因によって、予定された期日に繰上償還が実施されなかった場合、あるいは繰上償還されないと見込まれる場合には、当該証券の価格が大きく下落する可能性があります。

#### 利払い繰延リスク

ハイブリッド証券には、利息または配当の支払繰延条項を有する証券があります。これらの証券においては、発行体の財務状況や収益動向などの要因によって、利息または配当の支払いが繰り延べまたは停止される可能性があります。

#### e. 為替変動リスク

為替相場の円高等は、基準価額の下落要因となります。

外貨建資産は、為替相場の変動により円換算価格が変動します。一般に、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、投資先の通貨に対して円高となった場合には、当該外貨建資産の円換算価格が下落し、各通貨コースの基準価額が下落する可能性があります。

各通貨コースが主要投資対象とする外国投資信託では原則として、各通貨コースの対象通貨を買い予約する為替取引を行うため、各通貨コースの基準価額は実質的に当該対象通貨の為替変動の影響を受けます。ただし、為替取引の状況によっては外国投資信託が保有する有価証券の発行通貨の影響を受ける場合があります。対象通貨が新興国通貨の場合には、為替変動リスクが相対的に高くなる可能性があります。各通貨コースの対象通貨の金利が実質的な投資対象資産の発行通貨の金利よりも低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

#### f. 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、税制など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。これらの影響を受け、各通貨コースの基準価額が下落する可能性があります。

#### g. 特定の業種への集中投資リスク

特定の業種への集中投資は、基準価額の変動を大きくする要因となります。

各通貨コースは、投資信託証券を通じて、金融機関が発行する債券や優先証券に集中的に投資するため、個別金融機関の財務内容および収益動向などに加えて、金融機関を監督する金融当局の行政方針や金融システムの状況など、金融セクター固有の要因によるリスクが伴います。したがって、幅広い業種に分散投資を行うファンドと比較して基準価額の変動が大きくなる可能性があります。金融機関の財務状況に対する懸念が高まる局面や、予想外の金融行政の変化などが起こった場合には、債券および優先証券の価格下落に伴い各通貨コースの基準価額は大きく下落する可能性があります。また、発行金融機関が経営不安、倒産、国有化などに陥った場合には、実質的に組み入れを行っている債券や優先証券の価値が大きく減少すること、もしくは無くなることもあり、各通貨コースの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

## h. 特定の投資信託証券に投資するリスク

組入れる投資信託証券の運用成果の影響を大きく受けます。

各通貨コースが組み入れる投資信託証券における運用会社の運用の巧拙が、各通貨コースの運用成果に大きな影響を及ぼします。また、外国投資信託を通じて各国の有価証券に投資する場合、国内籍の投資信託から直接投資を行う場合に比べて、税制が相対的に不利となる可能性があります。

## 各ファンド共通

## i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 各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。
- (ロ) 各ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- (ハ) 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。
- (ニ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ホ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ト) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより各ファンドの運用に影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (チ) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券(ベビーファンド)が投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券(ベビーファンド)の価額が変動する可能性があります。

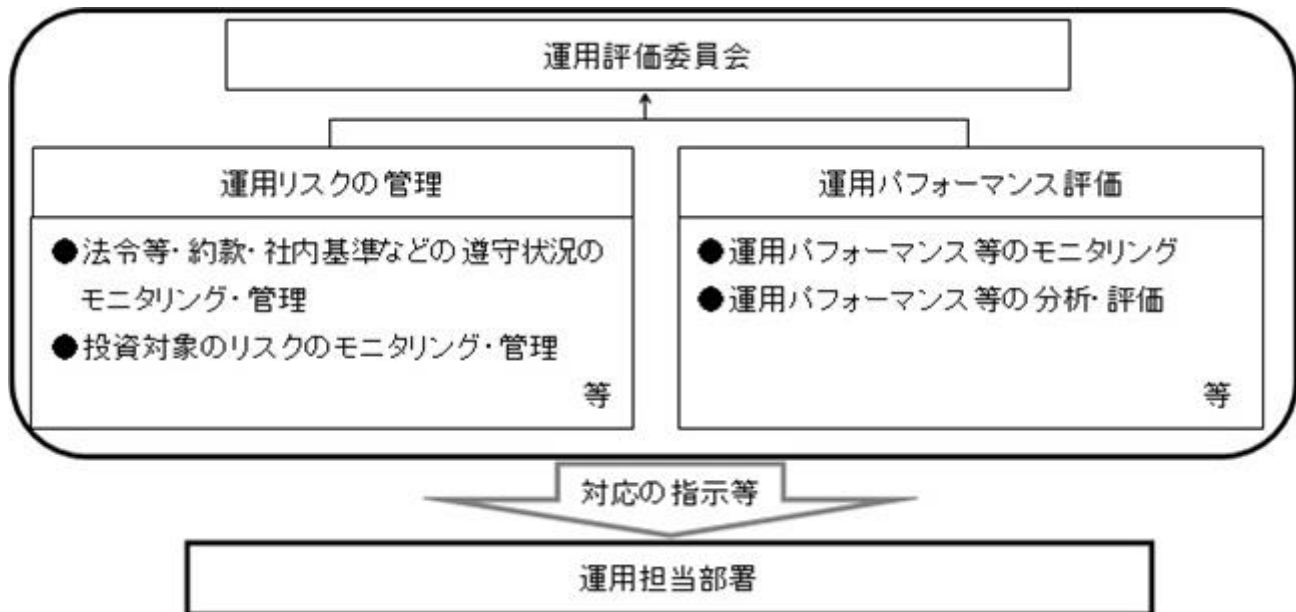
マネープールファンドはファミリーファンド方式で運用しているため、他のベビーファンドの影響を受けマザーファンドの基準価額が下落した場合には、マネープールファンドの基準価額が下落する可能性があります。

また、各通貨コースが主要投資対象とする投資信託証券にはファミリーファンド方式を採用している場合があり、上記のような要因で、各通貨コースの基準価額が変動する可能性があります。

## （２）リスク管理体制

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

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



リスク管理体制は2021年10月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 流動性リスク管理体制

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

流動性リスク管理体制は2022年1月1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

#### 米ドルコース



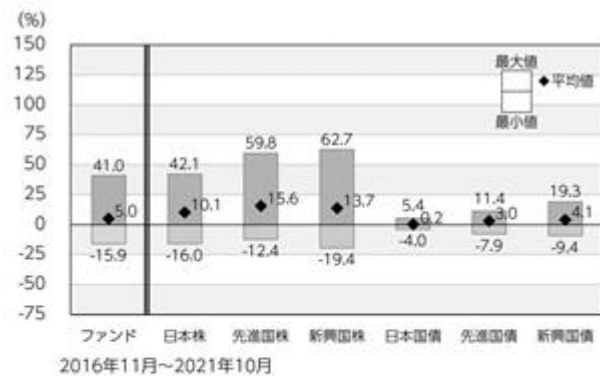
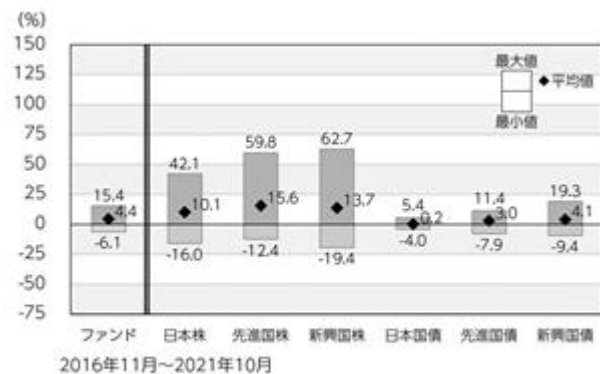
#### 豪ドルコース



\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## <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

#### ブラジルリアルコース



#### ロシアルーブルコース



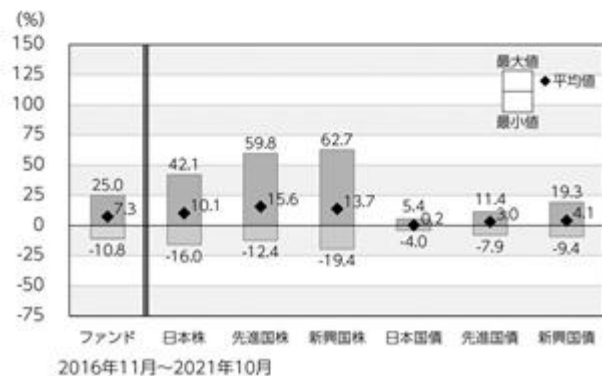
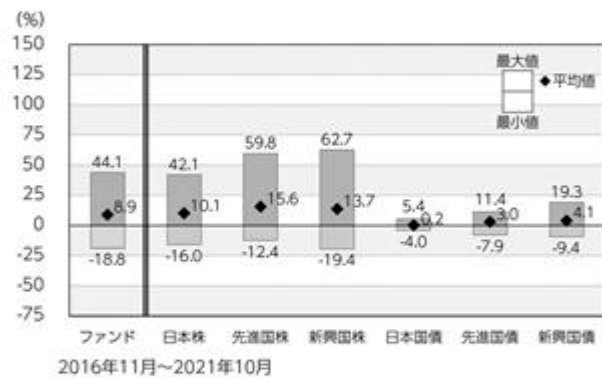
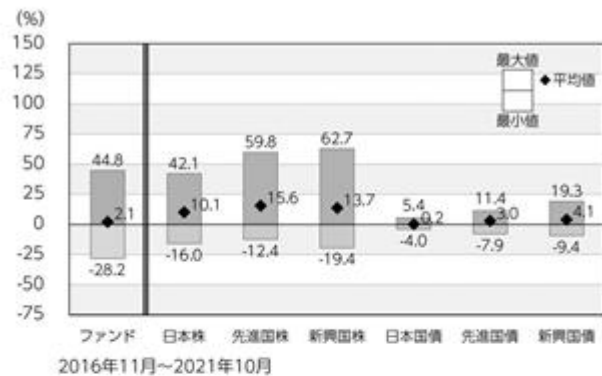
#### インドルピーコース



\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## <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

#### 中国元コース



2016/11 2017/11 2018/11 2019/11 2020/11 2021/10

#### 南アフリカランドコース



2016/11 2017/11 2018/11 2019/11 2020/11 2021/10

#### メキシコペソコース

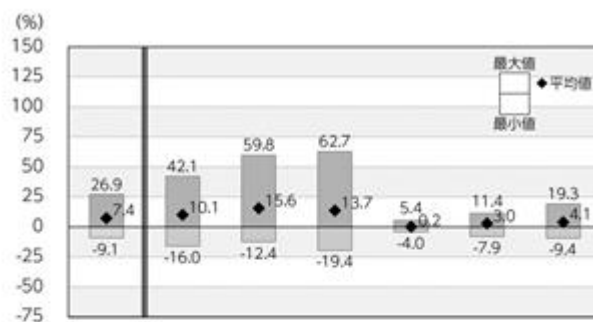


2016/11 2017/11 2018/11 2019/11 2020/11 2021/10

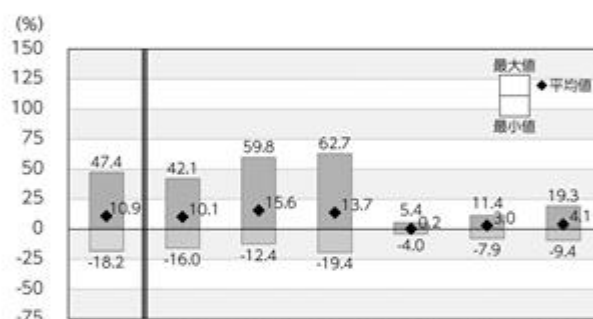
\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

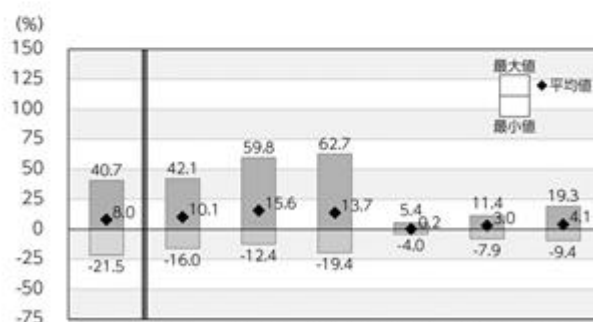
### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2016年11月～2021年10月



2016年11月～2021年10月



2016年11月～2021年10月

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

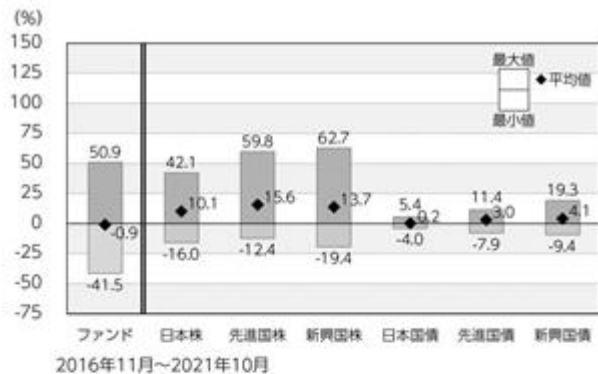
## <参考情報>

### 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

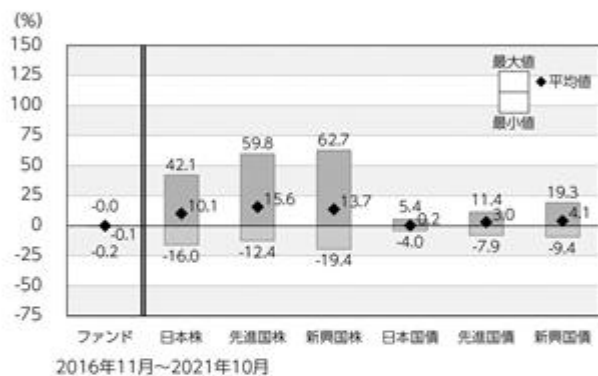
#### トルコリラコース



### 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



#### マネーパールファンド



\*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。

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) <sup>*</sup> (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広く網羅し、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・ディバースファイド(円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド]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】

#### (イ) 申込手数料

##### 各通貨コース

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税等が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

<http://www.am-one.co.jp/>

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

ファンドの受益権の取得申込者が「償還乗り換え」<sup>1</sup>または「償還前乗り換え」<sup>2</sup>によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができます。

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社ごとに異なりますので、詳しくは各販売会社でご確認ください。

1「償還乗り換え」とは、取得申込受付日前の一定期間内に既に償還となった証券投資信託の償還金等をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合があります。

2「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合があります。

#### マネープールファンド

申込手数料はかかりません。

#### (ロ) スイッチング手数料

##### 各ファンド共通

「ハイブリッド証券ファンド」構成ファンド間において、乗り換え（以下「スイッチング」<sup>3</sup>といいます。）が可能です。ただし、マネープールファンドのお買い付けは各通貨コースからのスイッチングの場合に限定します。

ファンド間のスイッチング手数料につきましては、販売会社にお問い合わせください。ただし、マネープールファンドへのスイッチングにつきましては無手数料とします。

スイッチングのお取り扱いの有無や対象ファンドなどは、販売会社により異なります。また販売会社によっては、一部のファンドのみのお取り扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社でご確認ください。

なお、スイッチングの際には、換金時と同様の費用・税金がかかりますのでご注意ください。

3「スイッチング」とは、「ハイブリッド証券ファンド」を構成するファンドを換金した場合の手取金をもって、その換金請求受付日の販売会社の営業時間内に「ハイブリッド証券ファンド」を構成する他のファンドの取得申し込みをすることをいいます。

(2)【換金(解約)手数料】

a. 解約時手数料

各ファンド共通

ご解約時の手数料はありません。

b. 信託財産留保額

各通貨コース

ご解約時に、解約申込受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額が信託財産留保額として控除されます。

「信託財産留保額」とは、ご解約による組入有価証券などの売却等費用について受益者間の公平を期するため、投資信託を途中解約される投資家にご負担いただくものです。なお、これは運用資金の一部として投資信託財産に組み入れられます。

マネープールファンド

信託財産留保額はありません。

(3)【信託報酬等】

各通貨コース

各ファンド	ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.155% (税抜1.05%) $\text{信託報酬} = \text{運用期間中の基準価額} \times \text{信託報酬率}$ 運用管理費用(信託報酬)は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。		
	支払先	内訳(税抜)	主な役務
	委託会社	年率0.40%	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0.62%	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0.03%	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
投資対象とする 外国投資信託	サブデット・ファンドの純資産総額に対して年率0.55% サブデット・ファンドは、余資運用の一環として主に短期債券等を投資対象とするファンドへ投資することがあり、かかる場合においては当該ファンドの管理報酬等(サブデット・ファンドの純資産総額の年率0.0175%相当を上限とします。)を間接的に負担します。		

実質的な負担	各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.705%（税抜1.6%）程度 上記はサブデット・ファンドを100%組入れた場合の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。
--------	--

マネープールファンド

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.066%～年率0.660%（税抜0.06%～税抜0.60%）

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。

当月の最初の営業日（委託会社の営業日をいいます。以下同じ。）から翌月の最初の営業日前日までの日々の信託報酬率は、月中平均コール・レート（短資協会が日々発表する無担保コール翌日物の加重平均レートの前月における平均値）に応じた下表の率とします。

月中平均コール・レート	0.15%未満	0.15%以上 0.30%未満	0.30%以上 0.60%未満	0.60%以上 1.00%未満	1.00%以上	-
信託報酬 (対純資産総額・年率) 税込 (税抜)	0.066% (0.06%)	0.165% (0.15%)	0.330% (0.30%)	0.550% (0.50%)	0.660% (0.60%)	-
支払先	内訳（税抜）（年率）					主な役務
委託会社	0.02%	0.05%	0.10%	0.20%	0.30%	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	0.02%	0.05%	0.10%	0.20%	0.20%	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	0.02%	0.05%	0.10%	0.10%	0.10%	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

#### (4) 【その他の手数料等】

##### 各通貨コース

- a. 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人に支払うファンドの監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。
- b. 投資信託財産にかかる監査報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額とともに投資信託財産中から支払われます。
- c. 証券取引に伴う手数料・税金等、各ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税等および資産を外国で保管する場合の費用についても投資信託財産が負担します。
- d. 各通貨コースが投資対象とする投資信託証券においても、有価証券等の売買手数料、税金、株式登録機関兼名義書換事務代行会社の報酬、弁護士費用、監査報酬、外国籍投資信託の設立に関連した費用等がかかります。
- e. 「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。  
手数料などの合計額については、購入金額や保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

##### マネープールファンド

- a. 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人に支払うファンドの監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。
- b. 投資信託財産にかかる監査報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額とともに投資信託財産中から支払われます。
- c. 証券取引に伴う手数料・税金等、当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税等および資産を外国で保管する場合の費用ならびに先物取引・オプション取引等に要する費用についても投資信託財産が負担します。
- d. 「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。  
手数料などの合計額については、購入金額や保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

#### (5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA(ジュニアニーサ)」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

#### 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。

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

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



## 個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

### < 個別元本について >

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

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金(特別分配金)が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の<収益分配金の課税について>を参照。)

### < 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金(特別分配金)が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	1,561,781,852	96.89
内 ケイマン諸島	1,561,781,852	96.89
親投資信託受益証券	3,414,776	0.21
内 日本	3,414,776	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	46,743,994	2.90
純資産総額	1,611,940,622	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。

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	1,274,490,568	96.84
内 ケイマン諸島	1,274,490,568	96.84
親投資信託受益証券	4,520,230	0.34
内 日本	4,520,230	0.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	37,067,143	2.82
純資産総額	1,316,077,941	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。

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,348,447,848	96.67
内 ケイマン諸島	3,348,447,848	96.67
親投資信託受益証券	16,285,673	0.47
内 日本	16,285,673	0.47
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	98,967,630	2.86
純資産総額	3,463,701,151	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。

## ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	414,766,629	97.31
内 ケイマン諸島	414,766,629	97.31
親投資信託受益証券	2,340,381	0.55
内 日本	2,340,381	0.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,129,745	2.14
純資産総額	426,236,755	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。

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	427,782,815	97.17
内 ケイマン諸島	427,782,815	97.17
親投資信託受益証券	2,243,284	0.51
内 日本	2,243,284	0.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,215,004	2.32
純資産総額	440,241,103	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。

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	505,142,841	97.51
内 ケイマン諸島	505,142,841	97.51
親投資信託受益証券	1,138,261	0.22
内 日本	1,138,261	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,777,391	2.27
純資産総額	518,058,493	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。

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	167,410,371	96.21
内 ケイマン諸島	167,410,371	96.21
親投資信託受益証券	238,309	0.14
内 日本	238,309	0.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,358,337	3.65
純資産総額	174,007,017	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。

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	824,572,815	95.97
内 ケイマン諸島	824,572,815	95.97
親投資信託受益証券	8,087,477	0.94
内 日本	8,087,477	0.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	26,506,924	3.09
純資産総額	859,167,216	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。

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,075,980,437	96.87

	内 ケイマン諸島	1,075,980,437	96.87
親投資信託受益証券		1,097,889	0.10
	内 日本	1,097,889	0.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		33,716,407	3.04
純資産総額		1,110,794,733	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。

#### ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

2021年10月29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	961,737	96.82
	内 日本	961,737
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	31,540	3.18
純資産総額	993,277	100.00

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

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

(参考)

#### 国内短期公社債マザーファンド

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	77,882,770	100.00
純資産総額	77,882,770	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。

## (2) 【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーデ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - USDクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	1,501,568,938	1.0283	1.0401	-	96.89
				1,544,185,275	1,561,781,852	-	
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,391,713	1.0067	1.0068	-	0.21
				3,414,776	3,414,776	-	

(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10月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	96.89
親投資信託受益証券	0.21
合計	97.10

(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。

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - AUDクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	1,578,903,083	0.7740 1,222,188,140	0.8072 1,274,490,568	- -	96.84
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,489,701	1.0067 4,520,230	1.0068 4,520,230	- -	0.34

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.84
親投資信託受益証券	0.34
合計	97.18

(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。

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - BRLクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	13,600,519,288	0.2471 3,362,048,367	0.2462 3,348,447,848	- -	96.67
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	16,175,679	1.0067 16,285,673	1.0068 16,285,673	- -	0.47

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.67
親投資信託受益証券	0.47
合計	97.14

(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。

## ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - RUBクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	1,086,914,647	0.3687 400,795,411	0.3816 414,766,629	- -	97.31
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,324,574	1.0067 2,340,381	1.0068 2,340,381	- -	0.55

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	97.31
親投資信託受益証券	0.55
合計	97.86

(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。

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - INRクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	791,311,165	0.5309 420,175,028	0.5406 427,782,815	- -	97.17
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,228,133	1.0067 2,243,284	1.0068 2,243,284	- -	0.51

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	97.17
親投資信託受益証券	0.51
合計	97.68

(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。

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - CNYクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	550,084,767	0.8977 493,866,103	0.9183 505,142,841	- -	97.51
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,130,574	1.0067 1,138,261	1.0068 1,138,261	- -	0.22

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	97.51
親投資信託受益証券	0.22
合計	97.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - ZARクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	325,258,153	0.5156 167,703,842	0.5147 167,410,371	- -	96.21
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	236,700	1.0067 238,309	1.0068 238,309	- -	0.14

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.21
親投資信託受益証券	0.14
合計	96.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - M X Nクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	1,300,998,446	0.6129  797,396,379	0.6338  824,572,815	-  -	95.97
2	国内短期公社債マザーファ ンド  日本	親投資 信託受 益証券	8,032,854	1.0067  8,087,477	1.0068  8,087,477	-  -	0.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	95.97
親投資信託受益証券	0.94
合計	96.91

(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。

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

2021年10月29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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - T R Yクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	5,056,299,048	0.2215  1,120,108,615	0.2128  1,075,980,437	-  -	96.87
2	国内短期公社債マザーファ ンド  日本	親投資 信託受 益証券	1,090,474	1.0067  1,097,889	1.0068  1,097,889	-  -	0.10

(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10月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.87
親投資信託受益証券	0.10
合計	96.96

(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。

## ハイブリッド証券ファンドマネーブルファンド

2021年10月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内短期公社債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	955,242	1.0067 961,737	1.0068 961,737	- -	96.82

(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10月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.82
合計	96.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内短期公社債マザーファンド

該当事項はありません。

## 投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

該当事項はありません。

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

該当事項はありません。

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

該当事項はありません。

## ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

該当事項はありません。

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

該当事項はありません。

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド  
該当事項はありません。

（参考）

国内短期公社債マザーファンド  
該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド中国元コース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド  
該当事項はありません。

（参考）

国内短期公社債マザーファンド  
該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

直近日(2021年10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5特定期間末 (2012年4月12日)	1,184	1,190	0.8323	0.8368
第6特定期間末 (2012年10月12日)	1,131	1,137	0.8487	0.8532
第7特定期間末 (2013年4月12日)	1,792	1,800	1.0993	1.1038
第8特定期間末 (2013年10月15日)	2,574	2,585	1.0663	1.0708
第9特定期間末 (2014年4月14日)	2,787	2,805	1.1001	1.1071
第10特定期間末 (2014年10月14日)	3,751	3,774	1.1353	1.1423
第11特定期間末 (2015年4月13日)	4,202	4,225	1.2438	1.2508
第12特定期間末 (2015年10月13日)	3,610	3,631	1.1914	1.1984
第13特定期間末 (2016年4月12日)	2,498	2,515	1.0438	1.0508
第14特定期間末 (2016年10月12日)	2,130	2,145	0.9983	1.0053
第15特定期間末 (2017年4月12日)	1,827	1,839	1.0236	1.0306
第16特定期間末 (2017年10月12日)	2,067	2,081	1.0438	1.0508
第17特定期間末 (2018年4月12日)	1,827	1,841	0.9441	0.9511
第18特定期間末 (2018年10月12日)	1,641	1,654	0.9309	0.9379
第19特定期間末 (2019年4月12日)	1,259	1,266	0.9491	0.9541
第20特定期間末 (2019年10月15日)	1,137	1,143	0.9439	0.9489
第21特定期間末 (2020年4月13日)	1,068	1,074	0.8946	0.8996
第22特定期間末 (2020年10月12日)	1,009	1,014	0.9078	0.9128
第23特定期間末 (2021年4月12日)	1,430	1,438	0.9244	0.9294
第24特定期間末 (2021年10月12日)	1,577	1,586	0.9178	0.9228
2020年10末日	997	-	0.8985	-

11月末日	1,023	-	0.9043	-
12月末日	1,025	-	0.9018	-
2021年1月末日	990	-	0.9011	-
2月末日	1,398	-	0.9053	-
3月末日	1,437	-	0.9302	-
4月末日	1,425	-	0.9198	-
5月末日	1,440	-	0.9264	-
6月末日	1,422	-	0.9285	-
7月末日	1,404	-	0.9219	-
8月末日	1,513	-	0.9203	-
9月末日	1,577	-	0.9262	-
10月末日	1,611	-	0.9276	-

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

直近日(2021年10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5特定期間末 (2012年 4月12日)	6,860	6,910	0.9595	0.9665
第6特定期間末 (2012年10月12日)	6,550	6,597	0.9819	0.9889
第7特定期間末 (2013年 4月12日)	7,617	7,658	1.3119	1.3189
第8特定期間末 (2013年10月15日)	5,624	5,658	1.1444	1.1514
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	5,523	5,560	1.1812	1.1892
第10特定期間末 (2014年10月14日)	5,691	5,731	1.1444	1.1524
第11特定期間末 (2015年 4月13日)	5,671	5,712	1.1149	1.1229
第12特定期間末 (2015年10月13日)	4,826	4,864	1.0184	1.0264
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	3,531	3,562	0.9189	0.9269
第14特定期間末 (2016年10月12日)	3,166	3,195	0.8647	0.8727
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	3,053	3,081	0.8711	0.8791
第16特定期間末 (2017年10月12日)	3,056	3,083	0.9136	0.9216
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	2,651	2,677	0.8153	0.8233
第18特定期間末 (2018年10月12日)	2,127	2,151	0.7246	0.7326
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	1,958	1,977	0.7201	0.7271

第20特定期間末 (2019年10月15日)	1,653	1,671	0.6599	0.6669
第21特定期間末 (2020年4月13日)	1,278	1,294	0.5552	0.5622
第22特定期間末 (2020年10月12日)	1,328	1,335	0.6416	0.6451
第23特定期間末 (2021年4月12日)	1,355	1,362	0.6886	0.6921
第24特定期間末 (2021年10月12日)	1,231	1,238	0.6577	0.6612
2020年10月末日	1,257	-	0.6161	-
11月末日	1,330	-	0.6541	-
12月末日	1,354	-	0.6706	-
2021年1月末日	1,349	-	0.6746	-
2月末日	1,391	-	0.7023	-
3月末日	1,361	-	0.6901	-
4月末日	1,367	-	0.6972	-
5月末日	1,341	-	0.6975	-
6月末日	1,302	-	0.6825	-
7月末日	1,244	-	0.6678	-
8月末日	1,235	-	0.6576	-
9月末日	1,226	-	0.6525	-
10月末日	1,316	-	0.6851	-

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

直近日(2021年10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5特定期間末 (2012年4月12日)	49,856	50,570	0.7676	0.7786
第6特定期間末 (2012年10月12日)	40,328	40,979	0.6820	0.6930
第7特定期間末 (2013年4月12日)	53,724	54,396	0.8793	0.8903
第8特定期間末 (2013年10月15日)	41,236	41,842	0.7480	0.7590
第9特定期間末 (2014年4月14日)	36,359	36,891	0.7521	0.7631
第10特定期間末 (2014年10月14日)	29,584	30,043	0.7088	0.7198
第11特定期間末 (2015年4月13日)	23,463	23,891	0.6037	0.6147
第12特定期間末 (2015年10月13日)	16,704	17,098	0.4665	0.4775
第13特定期間末 (2016年4月12日)	14,109	14,376	0.4224	0.4304
第14特定期間末 (2016年10月12日)	13,798	13,985	0.4434	0.4494

第15特定期間末 (2017年 4月12日)	13,556	13,730	0.4691	0.4751
第16特定期間末 (2017年10月12日)	13,225	13,392	0.4766	0.4826
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	10,432	10,590	0.3954	0.4014
第18特定期間末 (2018年10月12日)	8,299	8,446	0.3394	0.3454
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	7,642	7,722	0.3325	0.3360
第20特定期間末 (2019年10月15日)	6,610	6,687	0.3027	0.3062
第21特定期間末 (2020年4月13日)	4,606	4,677	0.2263	0.2298
第22特定期間末 (2020年10月12日)	4,021	4,049	0.2105	0.2120
第23特定期間末 (2021年4月12日)	3,745	3,772	0.2092	0.2107
第24特定期間末 (2021年10月12日)	3,495	3,519	0.2151	0.2166
2020年10月末日	3,758	-	0.1995	-
11月末日	4,050	-	0.2176	-
12月末日	4,094	-	0.2225	-
2021年1月末日	3,873	-	0.2124	-
2月末日	3,802	-	0.2103	-
3月末日	3,706	-	0.2065	-
4月末日	3,842	-	0.2172	-
5月末日	3,985	-	0.2264	-
6月末日	4,174	-	0.2394	-
7月末日	4,039	-	0.2332	-
8月末日	3,909	-	0.2269	-
9月末日	3,601	-	0.2205	-
10月末日	3,463	-	0.2142	-

## ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

直近日(2021年10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5特定期間末 (2012年 4月12日)	344	347	0.7792	0.7852
第6特定期間末 (2012年10月12日)	322	325	0.7677	0.7737
第7特定期間末 (2013年 4月12日)	285	287	1.0176	1.0236
第8特定期間末 (2013年10月15日)	237	238	0.9579	0.9639
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	175	177	0.9262	0.9322

第10特定期間末 (2014年10月14日)	187	188	0.8822	0.8882
第11特定期間末 (2015年 4月13日)	889	895	0.8013	0.8073
第12特定期間末 (2015年10月13日)	649	654	0.6824	0.6884
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	528	534	0.5694	0.5754
第14特定期間末 (2016年10月12日)	484	489	0.5911	0.5971
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	2,176	2,196	0.6712	0.6772
第16特定期間末 (2017年10月12日)	2,725	2,748	0.6929	0.6989
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	1,734	1,752	0.5777	0.5837
第18特定期間末 (2018年10月12日)	1,114	1,126	0.5507	0.5567
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	998	1,009	0.5689	0.5749
第20特定期間末 (2019年10月15日)	843	852	0.5635	0.5695
第21特定期間末 (2020年4月13日)	588	596	0.4599	0.4659
第22特定期間末 (2020年10月12日)	501	505	0.4501	0.4536
第23特定期間末 (2021年4月12日)	410	413	0.4550	0.4585
第24特定期間末 (2021年10月12日)	421	424	0.4938	0.4973
2020年10月末日	420	-	0.4326	-
11月末日	438	-	0.4522	-
12月末日	449	-	0.4638	-
2021年1月末日	434	-	0.4512	-
2月末日	437	-	0.4650	-
3月末日	420	-	0.4660	-
4月末日	422	-	0.4690	-
5月末日	434	-	0.4828	-
6月末日	440	-	0.4885	-
7月末日	433	-	0.4830	-
8月末日	429	-	0.4813	-
9月末日	422	-	0.4913	-
10月末日	426	-	0.5106	-

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

直近日(2021年10月末日)、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5特定期間末 (2012年 4月12日)	955	964	0.7708	0.7778
第6特定期間末 (2012年10月12日)	887	895	0.7806	0.7876
第7特定期間末 (2013年 4月12日)	861	868	0.9921	0.9991
第8特定期間末 (2013年10月15日)	739	745	0.8719	0.8789
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	618	623	0.9433	0.9503
第10特定期間末 (2014年10月14日)	624	628	0.9827	0.9897
第11特定期間末 (2015年 4月13日)	792	797	1.0811	1.0881
第12特定期間末 (2015年10月13日)	789	795	1.0221	1.0291
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	593	597	0.8926	0.8996
第14特定期間末 (2016年10月12日)	475	478	0.8646	0.8716
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	690	695	0.9258	0.9328
第16特定期間末 (2017年10月12日)	1,309	1,319	0.9492	0.9562
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	1,316	1,326	0.8736	0.8806
第18特定期間末 (2018年10月12日)	1,078	1,088	0.7772	0.7842
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	1,089	1,098	0.8496	0.8566
第20特定期間末 (2019年10月15日)	619	625	0.8290	0.8360
第21特定期間末 (2020年4月13日)	453	457	0.7283	0.7353
第22特定期間末 (2020年10月12日)	449	453	0.7726	0.7796
第23特定期間末 (2021年4月12日)	406	409	0.7679	0.7749
第24特定期間末 (2021年10月12日)	435	439	0.7598	0.7668
2020年10月末日	436	-	0.7520	-
11月末日	441	-	0.7604	-
12月末日	435	-	0.7646	-
2021年1月末日	412	-	0.7659	-
2月末日	405	-	0.7727	-
3月末日	413	-	0.7863	-
4月末日	402	-	0.7674	-
5月末日	418	-	0.7953	-



6月末日	430	-	0.7790	-
7月末日	433	-	0.7743	-
8月末日	440	-	0.7808	-
9月末日	439	-	0.7765	-
10月末日	440	-	0.7726	-

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

直近日(2021年10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5特定期間末 (2012年 4月12日)	1,875	1,887	0.8394	0.8449
第6特定期間末 (2012年10月12日)	1,702	1,713	0.8552	0.8607
第7特定期間末 (2013年 4月12日)	1,896	1,905	1.1168	1.1223
第8特定期間末 (2013年10月15日)	1,544	1,551	1.1004	1.1059
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	1,323	1,332	1.1275	1.1355
第10特定期間末 (2014年10月14日)	1,186	1,194	1.1769	1.1849
第11特定期間末 (2015年 4月13日)	1,275	1,283	1.3018	1.3098
第12特定期間末 (2015年10月13日)	1,129	1,136	1.2138	1.2218
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	980	987	1.0763	1.0843
第14特定期間末 (2016年10月12日)	701	707	0.9969	1.0049
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	655	660	1.0113	1.0193
第16特定期間末 (2017年10月12日)	681	686	1.0894	1.0974
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	644	649	1.0444	1.0524
第18特定期間末 (2018年10月12日)	577	581	0.9433	0.9513
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	580	585	0.9722	0.9802
第20特定期間末 (2019年10月15日)	523	527	0.9128	0.9208
第21特定期間末 (2020年4月13日)	430	435	0.8548	0.8628
第22特定期間末 (2020年10月12日)	466	470	0.9010	0.9090

第23特定期間末 (2021年4月12日)	498	502	0.9279	0.9359
第24特定期間末 (2021年10月12日)	504	509	0.9303	0.9383
2020年10月末日	459	-	0.8878	-
11月末日	475	-	0.9124	-
12月末日	476	-	0.9145	-
2021年1月末日	478	-	0.9203	-
2月末日	481	-	0.9236	-
3月末日	488	-	0.9325	-
4月末日	498	-	0.9349	-
5月末日	506	-	0.9560	-
6月末日	507	-	0.9433	-
7月末日	509	-	0.9376	-
8月末日	509	-	0.9329	-
9月末日	510	-	0.9378	-
10月末日	518	-	0.9505	-

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

直近日(2021年10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5特定期間末 (2012年4月12日)	452	458	0.7627	0.7722
第6特定期間末 (2012年10月12日)	377	382	0.7031	0.7126
第7特定期間末 (2013年4月12日)	498	504	0.8754	0.8849
第8特定期間末 (2013年10月15日)	471	477	0.7445	0.7540
第9特定期間末 (2014年4月14日)	298	301	0.7261	0.7341
第10特定期間末 (2014年10月14日)	241	244	0.7059	0.7139
第11特定期間末 (2015年4月13日)	247	250	0.7182	0.7262
第12特定期間末 (2015年10月13日)	193	195	0.6163	0.6243
第13特定期間末 (2016年4月12日)	146	148	0.4798	0.4878
第14特定期間末 (2016年10月12日)	130	131	0.4741	0.4791
第15特定期間末 (2017年4月12日)	130	131	0.5116	0.5166
第16特定期間末 (2017年10月12日)	134	135	0.5388	0.5438
第17特定期間末 (2018年4月12日)	129	130	0.5554	0.5604

第18特定期間末 (2018年10月12日)	100	101	0.4565	0.4615
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	92	93	0.4814	0.4864
第20特定期間末 (2019年10月15日)	88	89	0.4466	0.4516
第21特定期間末 (2020年4月13日)	68	69	0.3470	0.3520
第22特定期間末 (2020年10月12日)	73	74	0.3832	0.3862
第23特定期間末 (2021年4月12日)	82	83	0.4423	0.4453
第24特定期間末 (2021年10月12日)	152	153	0.4379	0.4409
2020年10月末日	73	-	0.3802	-
11月末日	78	-	0.4115	-
12月末日	81	-	0.4266	-
2021年1月末日	78	-	0.4146	-
2月末日	78	-	0.4248	-
3月末日	81	-	0.4360	-
4月末日	83	-	0.4502	-
5月末日	88	-	0.4707	-
6月末日	85	-	0.4565	-
7月末日	115	-	0.4477	-
8月末日	134	-	0.4423	-
9月末日	151	-	0.4347	-
10月末日	174	-	0.4374	-

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

直近日(2021年10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特定期間末 (2013年10月15日)	589	593	0.9664	0.9724
第2特定期間末 (2014年 4月14日)	629	632	1.0104	1.0164
第3特定期間末 (2014年10月14日)	680	684	1.0292	1.0352
第4特定期間末 (2015年 4月13日)	585	589	1.0163	1.0223
第5特定期間末 (2015年10月13日)	484	488	0.9103	0.9163
第6特定期間末 (2016年 4月12日)	392	395	0.7457	0.7517
第7特定期間末 (2016年10月12日)	352	355	0.6698	0.6758
第8特定期間末 (2017年 4月12日)	2,486	2,508	0.6924	0.6984

第9特定期間末 (2017年10月12日)	6,978	7,036	0.7216	0.7276
第10特定期間末 (2018年 4月12日)	6,281	6,336	0.6863	0.6923
第11特定期間末 (2018年10月12日)	3,403	3,433	0.6616	0.6676
第12特定期間末 (2019年 4月12日)	2,599	2,622	0.6831	0.6891
第13特定期間末 (2019年10月15日)	1,941	1,959	0.6667	0.6727
第14特定期間末 (2020年4月13日)	1,290	1,305	0.5229	0.5289
第15特定期間末 (2020年10月12日)	1,131	1,143	0.5813	0.5873
第16特定期間末 (2021年4月12日)	953	962	0.6165	0.6225
第17特定期間末 (2021年10月12日)	857	866	0.5936	0.5996
2020年10月末日	1,047	-	0.5719	-
11月末日	1,098	-	0.6110	-
12月末日	1,042	-	0.6138	-
2021年1月末日	1,002	-	0.6001	-
2月末日	965	-	0.5885	-
3月末日	954	-	0.6092	-
4月末日	940	-	0.6203	-
5月末日	933	-	0.6246	-
6月末日	945	-	0.6298	-
7月末日	934	-	0.6232	-
8月末日	900	-	0.6101	-
9月末日	899	-	0.6086	-
10月末日	859	-	0.6131	-

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

直近日(2021年10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特定期間末 (2013年10月15日)	12	12	1.0017	1.0087
第2特定期間末 (2014年 4月14日)	12	12	1.0040	1.0110
第3特定期間末 (2014年10月14日)	327	329	0.9968	1.0038
第4特定期間末 (2015年 4月13日)	63	64	1.0039	1.0109
第5特定期間末 (2015年10月13日)	111	112	0.9054	0.9124
第6特定期間末 (2016年 4月12日)	75	76	0.8473	0.8543

第7特定期間末 (2016年10月12日)	44	44	0.7688	0.7758
第8特定期間末 (2017年 4月12日)	74	75	0.6693	0.6763
第9特定期間末 (2017年10月12日)	3,233	3,265	0.7121	0.7191
第10特定期間末 (2018年 4月12日)	4,810	4,867	0.5925	0.5995
第11特定期間末 (2018年10月12日)	3,354	3,410	0.4202	0.4272
第12特定期間末 (2019年 4月12日)	4,154	4,216	0.4725	0.4795
第13特定期間末 (2019年10月15日)	4,043	4,102	0.4794	0.4864
第14特定期間末 (2020年4月13日)	3,066	3,120	0.3966	0.4036
第15特定期間末 (2020年10月12日)	2,041	2,061	0.3645	0.3680
第16特定期間末 (2021年4月12日)	1,533	1,547	0.3760	0.3795
第17特定期間末 (2021年10月12日)	1,184	1,195	0.3660	0.3695
2020年10月末日	1,817	-	0.3420	-
11月末日	1,894	-	0.3696	-
12月末日	1,955	-	0.3939	-
2021年1月末日	1,825	-	0.3974	-
2月末日	1,756	-	0.4077	-
3月末日	1,512	-	0.3683	-
4月末日	1,507	-	0.3763	-
5月末日	1,381	-	0.3687	-
6月末日	1,337	-	0.3670	-
7月末日	1,323	-	0.3798	-
8月末日	1,288	-	0.3877	-
9月末日	1,206	-	0.3721	-
10月末日	1,110	-	0.3519	-

## ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

直近日(2021年10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5計算期間末 (2012年 4月12日)	139	139	1.0008	1.0008
第6計算期間末 (2012年10月12日)	134	134	1.0009	1.0009
第7計算期間末 (2013年 4月12日)	101	101	1.0011	1.0011
第8計算期間末 (2013年10月15日)	95	95	1.0011	1.0011

第9計算期間末 (2014年 4月14日)	70	70	1.0011	1.0011
第10計算期間末 (2014年10月14日)	70	70	1.0009	1.0009
第11計算期間末 (2015年 4月13日)	70	70	1.0007	1.0007
第12計算期間末 (2015年10月13日)	72	72	1.0004	1.0004
第13計算期間末 (2016年 4月12日)	74	74	0.9999	0.9999
第14計算期間末 (2016年10月12日)	73	73	0.9997	0.9997
第15計算期間末 (2017年 4月12日)	73	73	0.9992	0.9992
第16計算期間末 (2017年10月12日)	70	70	0.9985	0.9985
第17計算期間末 (2018年 4月12日)	95	95	0.9979	0.9979
第18計算期間末 (2018年10月12日)	97	97	0.9971	0.9971
第19計算期間末 (2019年 4月12日)	72	72	0.9963	0.9963
第20計算期間末 (2019年10月15日)	72	72	0.9957	0.9957
第21計算期間末 (2020年4月13日)	2	2	0.9941	0.9941
第22計算期間末 (2020年10月12日)	0.993755	0.993755	0.9938	0.9938
第23計算期間末 (2021年4月12日)	0.993573	0.993573	0.9936	0.9936
第24計算期間末 (2021年10月12日)	0.993294	0.993294	0.9933	0.9933
2020年10月末日	0.993737	-	0.9937	-
11月末日	0.993706	-	0.9937	-
12月末日	0.993676	-	0.9937	-
2021年1月末日	0.993646	-	0.9936	-
2月末日	0.993618	-	0.9936	-
3月末日	0.993585	-	0.9936	-
4月末日	0.993555	-	0.9936	-
5月末日	0.993524	-	0.9935	-
6月末日	0.993398	-	0.9934	-
7月末日	0.993368	-	0.9934	-
8月末日	0.993336	-	0.9933	-
9月末日	0.993306	-	0.9933	-
10月末日	0.993277	-	0.9933	-

## 【分配の推移】

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

	1口当たりの分配金(円)
第5特定期間	0.0270
第6特定期間	0.0270
第7特定期間	0.0270
第8特定期間	0.0270
第9特定期間	0.0395
第10特定期間	0.0420
第11特定期間	0.0420
第12特定期間	0.0420
第13特定期間	0.0420
第14特定期間	0.0420
第15特定期間	0.0420
第16特定期間	0.0420
第17特定期間	0.0420
第18特定期間	0.0420
第19特定期間	0.0300
第20特定期間	0.0300
第21特定期間	0.0300
第22特定期間	0.0300
第23特定期間	0.0300
第24特定期間	0.0300

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

	1口当たりの分配金(円)
第5特定期間	0.0420
第6特定期間	0.0420
第7特定期間	0.0420
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0470
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0480
第13特定期間	0.0480
第14特定期間	0.0480
第15特定期間	0.0480
第16特定期間	0.0480
第17特定期間	0.0480
第18特定期間	0.0480
第19特定期間	0.0420
第20特定期間	0.0420
第21特定期間	0.0420
第22特定期間	0.0210
第23特定期間	0.0210
第24特定期間	0.0210

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

	1口当たりの分配金(円)
第5特定期間	0.0660
第6特定期間	0.0660
第7特定期間	0.0660

第8特定期間	0.0660
第9特定期間	0.0660
第10特定期間	0.0660
第11特定期間	0.0660
第12特定期間	0.0660
第13特定期間	0.0480
第14特定期間	0.0380
第15特定期間	0.0360
第16特定期間	0.0360
第17特定期間	0.0360
第18特定期間	0.0360
第19特定期間	0.0210
第20特定期間	0.0210
第21特定期間	0.0210
第22特定期間	0.0090
第23特定期間	0.0090
第24特定期間	0.0090

## ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

	1口当たりの分配金（円）
第5特定期間	0.0360
第6特定期間	0.0360
第7特定期間	0.0360
第8特定期間	0.0360
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0360
第11特定期間	0.0360
第12特定期間	0.0360
第13特定期間	0.0360
第14特定期間	0.0360
第15特定期間	0.0360
第16特定期間	0.0360
第17特定期間	0.0360
第18特定期間	0.0360
第19特定期間	0.0360
第20特定期間	0.0360
第21特定期間	0.0360
第22特定期間	0.0210
第23特定期間	0.0210
第24特定期間	0.0210

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

	1口当たりの分配金（円）
第5特定期間	0.0420
第6特定期間	0.0420
第7特定期間	0.0420
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0420
第10特定期間	0.0420
第11特定期間	0.0420



第12特定期間	0.0420
第13特定期間	0.0420
第14特定期間	0.0420
第15特定期間	0.0420
第16特定期間	0.0420
第17特定期間	0.0420
第18特定期間	0.0420
第19特定期間	0.0420
第20特定期間	0.0420
第21特定期間	0.0420
第22特定期間	0.0420
第23特定期間	0.0420
第24特定期間	0.0420

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

	1口当たりの分配金（円）
第5特定期間	0.0330
第6特定期間	0.0330
第7特定期間	0.0330
第8特定期間	0.0330
第9特定期間	0.0455
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0480
第13特定期間	0.0480
第14特定期間	0.0480
第15特定期間	0.0480
第16特定期間	0.0480
第17特定期間	0.0480
第18特定期間	0.0480
第19特定期間	0.0480
第20特定期間	0.0480
第21特定期間	0.0480
第22特定期間	0.0480
第23特定期間	0.0480
第24特定期間	0.0480

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

	1口当たりの分配金（円）
第5特定期間	0.0570
第6特定期間	0.0570
第7特定期間	0.0570
第8特定期間	0.0570
第9特定期間	0.0495
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0480
第13特定期間	0.0480
第14特定期間	0.0330
第15特定期間	0.0300

第16特定期間	0.0300
第17特定期間	0.0300
第18特定期間	0.0300
第19特定期間	0.0300
第20特定期間	0.0300
第21特定期間	0.0300
第22特定期間	0.0180
第23特定期間	0.0180
第24特定期間	0.0180

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0120
第2特定期間	0.0360
第3特定期間	0.0360
第4特定期間	0.0360
第5特定期間	0.0360
第6特定期間	0.0360
第7特定期間	0.0360
第8特定期間	0.0360
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0360
第11特定期間	0.0360
第12特定期間	0.0360
第13特定期間	0.0360
第14特定期間	0.0360
第15特定期間	0.0360
第16特定期間	0.0360
第17特定期間	0.0360

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0140
第2特定期間	0.0420
第3特定期間	0.0420
第4特定期間	0.0420
第5特定期間	0.0420
第6特定期間	0.0420
第7特定期間	0.0420
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0420
第10特定期間	0.0420
第11特定期間	0.0420
第12特定期間	0.0420
第13特定期間	0.0420
第14特定期間	0.0420
第15特定期間	0.0210
第16特定期間	0.0210
第17特定期間	0.0210

## ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

	1口当たりの分配金（円）
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

	収益率（％）
第5特定期間	13.8
第6特定期間	5.2
第7特定期間	32.7
第8特定期間	0.5
第9特定期間	6.9
第10特定期間	7.0
第11特定期間	13.3
第12特定期間	0.8
第13特定期間	8.9
第14特定期間	0.3
第15特定期間	6.7
第16特定期間	6.1
第17特定期間	5.5
第18特定期間	3.1
第19特定期間	5.2
第20特定期間	2.6
第21特定期間	2.0
第22特定期間	4.8
第23特定期間	5.1
第24特定期間	2.5

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

	収益率(%)
第5特定期間	20.0
第6特定期間	6.7
第7特定期間	37.9
第8特定期間	9.6
第9特定期間	7.3
第10特定期間	0.9
第11特定期間	1.6
第12特定期間	4.4
第13特定期間	5.1
第14特定期間	0.7
第15特定期間	6.3
第16特定期間	10.4
第17特定期間	5.5
第18特定期間	5.2
第19特定期間	5.2
第20特定期間	2.5
第21特定期間	9.5
第22特定期間	19.3
第23特定期間	10.6
第24特定期間	1.4

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

	収益率(%)
第5特定期間	13.6
第6特定期間	2.6
第7特定期間	38.6
第8特定期間	7.4
第9特定期間	9.4
第10特定期間	3.0
第11特定期間	5.5
第12特定期間	11.8
第13特定期間	0.8
第14特定期間	14.0
第15特定期間	13.9
第16特定期間	9.3
第17特定期間	9.5
第18特定期間	5.1
第19特定期間	4.2
第20特定期間	2.6
第21特定期間	18.3
第22特定期間	3.0
第23特定期間	3.7
第24特定期間	7.1

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

	収益率(%)
第5特定期間	24.2
第6特定期間	3.1
第7特定期間	37.2
第8特定期間	2.3
第9特定期間	0.4
第10特定期間	0.9
第11特定期間	5.1
第12特定期間	10.3
第13特定期間	11.3
第14特定期間	10.1
第15特定期間	19.6
第16特定期間	8.6
第17特定期間	11.4
第18特定期間	1.6
第19特定期間	9.8
第20特定期間	5.4
第21特定期間	12.0
第22特定期間	2.4
第23特定期間	5.8
第24特定期間	13.1

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

	収益率(%)
第5特定期間	12.1
第6特定期間	6.7
第7特定期間	32.5
第8特定期間	7.9
第9特定期間	13.0
第10特定期間	8.6
第11特定期間	14.3
第12特定期間	1.6
第13特定期間	8.6
第14特定期間	1.6
第15特定期間	11.9
第16特定期間	7.1
第17特定期間	3.5
第18特定期間	6.2
第19特定期間	14.7
第20特定期間	2.5
第21特定期間	7.1
第22特定期間	11.8
第23特定期間	4.8
第24特定期間	4.4

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンド中国元コース

	収益率（％）
第5特定期間	14.4
第6特定期間	5.8
第7特定期間	34.4
第8特定期間	1.5
第9特定期間	6.6
第10特定期間	8.6
第11特定期間	14.7
第12特定期間	3.1
第13特定期間	7.4
第14特定期間	2.9
第15特定期間	6.3
第16特定期間	12.5
第17特定期間	0.3
第18特定期間	5.1
第19特定期間	8.2
第20特定期間	1.2
第21特定期間	1.1
第22特定期間	11.0
第23特定期間	8.3
第24特定期間	5.4

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

	収益率（％）
第5特定期間	15.2
第6特定期間	0.3
第7特定期間	32.6
第8特定期間	8.4
第9特定期間	4.2
第10特定期間	3.8
第11特定期間	8.5
第12特定期間	7.5
第13特定期間	14.4
第14特定期間	5.7
第15特定期間	14.2
第16特定期間	11.2
第17特定期間	8.6
第18特定期間	12.4
第19特定期間	12.0
第20特定期間	1.0
第21特定期間	15.6
第22特定期間	15.6
第23特定期間	20.1
第24特定期間	3.1

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

	収益率(%)
第1特定期間	2.2
第2特定期間	8.3
第3特定期間	5.4
第4特定期間	2.2
第5特定期間	6.9
第6特定期間	14.1
第7特定期間	5.4
第8特定期間	8.7
第9特定期間	9.4
第10特定期間	0.1
第11特定期間	1.6
第12特定期間	8.7
第13特定期間	2.9
第14特定期間	16.2
第15特定期間	18.1
第16特定期間	12.2
第17特定期間	2.1

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

	収益率(%)
第1特定期間	1.6
第2特定期間	4.4
第3特定期間	3.5
第4特定期間	4.9
第5特定期間	5.6
第6特定期間	1.8
第7特定期間	4.3
第8特定期間	7.5
第9特定期間	12.7
第10特定期間	10.9
第11特定期間	22.0
第12特定期間	22.4
第13特定期間	10.3
第14特定期間	8.5
第15特定期間	2.8
第16特定期間	8.9
第17特定期間	2.9

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

	収益率(%)
第5計算期間	0.01
第6計算期間	0.01
第7計算期間	0.02
第8計算期間	0.00
第9計算期間	0.00

第10計算期間	0.02
第11計算期間	0.02
第12計算期間	0.03
第13計算期間	0.05
第14計算期間	0.02
第15計算期間	0.05
第16計算期間	0.07
第17計算期間	0.06
第18計算期間	0.08
第19計算期間	0.08
第20計算期間	0.06
第21計算期間	0.16
第22計算期間	0.03
第23計算期間	0.02
第24計算期間	0.03

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

##### ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

	設定口数	解約口数
第5特定期間	200,657,473	282,899,267
第6特定期間	6,930,067	97,027,202
第7特定期間	592,494,028	294,482,016
第8特定期間	941,593,189	158,218,490
第9特定期間	549,086,314	429,635,416
第10特定期間	1,589,637,442	818,900,694
第11特定期間	530,282,202	456,350,083
第12特定期間	625,774,290	974,203,105
第13特定期間	145,921,708	782,282,084
第14特定期間	106,596,997	366,272,051
第15特定期間	250,038,112	598,953,665
第16特定期間	398,690,501	202,881,263
第17特定期間	154,448,885	199,373,858
第18特定期間	68,642,438	240,732,335
第19特定期間	14,554,792	451,230,663
第20特定期間	131,129,868	253,322,120
第21特定期間	64,122,495	74,338,346
第22特定期間	8,505,698	91,794,735
第23特定期間	597,999,270	162,262,829
第24特定期間	248,220,795	76,315,422

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

##### ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

	設定口数	解約口数
第5特定期間	1,148,442,010	2,749,650,841
第6特定期間	1,494,965,406	1,973,998,890
第7特定期間	917,339,792	1,781,457,479
第8特定期間	202,242,188	1,094,484,806
第9特定期間	462,742,702	701,423,851
第10特定期間	954,263,528	656,937,490



第11特定期間	343,972,081	230,162,160
第12特定期間	208,308,547	555,946,274
第13特定期間	68,379,077	964,159,260
第14特定期間	63,303,545	244,997,153
第15特定期間	128,635,312	284,723,915
第16特定期間	244,089,464	404,584,214
第17特定期間	130,893,401	224,180,000
第18特定期間	19,490,266	335,308,658
第19特定期間	32,528,706	249,467,335
第20特定期間	10,451,305	223,563,237
第21特定期間	13,752,452	216,869,172
第22特定期間	7,130,820	239,883,662
第23特定期間	9,466,414	110,705,416
第24特定期間	34,916,705	130,916,168

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

	設定口数	解約口数
第5特定期間	5,898,874,664	14,864,361,212
第6特定期間	5,184,135,231	11,006,814,351
第7特定期間	9,292,913,236	7,327,324,395
第8特定期間	2,185,065,819	8,152,259,953
第9特定期間	1,723,140,971	8,508,820,705
第10特定期間	1,902,725,366	8,512,107,773
第11特定期間	1,618,667,591	4,486,117,179
第12特定期間	2,206,669,418	5,264,456,264
第13特定期間	1,589,379,845	3,993,056,719
第14特定期間	1,119,212,162	3,404,238,062
第15特定期間	784,231,764	3,003,363,255
第16特定期間	1,185,690,318	2,336,777,201
第17特定期間	507,360,362	1,877,547,045
第18特定期間	552,121,852	2,484,114,108
第19特定期間	169,890,629	1,633,583,250
第20特定期間	161,862,408	1,310,432,816
第21特定期間	170,847,983	1,652,277,900
第22特定期間	108,300,612	1,362,631,633
第23特定期間	109,167,159	1,304,143,774
第24特定期間	98,923,039	1,757,838,056

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

	設定口数	解約口数
第5特定期間	2,406,843	326,058,216
第6特定期間	22,637,932	44,440,784
第7特定期間	42,385,692	182,225,618
第8特定期間	2,772,513	35,757,321
第9特定期間	1,148,199	58,720,159
第10特定期間	35,525,450	13,347,195
第11特定期間	1,033,271,345	135,793,768
第12特定期間	302,495,712	460,778,160

第13特定期間	147,462,481	170,572,464
第14特定期間	39,773,313	147,515,538
第15特定期間	2,566,923,827	144,217,112
第16特定期間	1,033,199,427	343,595,772
第17特定期間	138,029,632	1,069,191,386
第18特定期間	64,267,179	1,041,649,128
第19特定期間	50,133,737	318,424,431
第20特定期間	44,233,255	303,994,004
第21特定期間	83,477,066	299,865,413
第22特定期間	33,072,497	198,065,739
第23特定期間	15,250,453	228,807,938
第24特定期間	11,299,155	58,627,774

(注)本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

	設定口数	解約口数
第5特定期間	425,776,801	175,499,779
第6特定期間	28,196,165	131,529,775
第7特定期間	248,005,913	515,864,470
第8特定期間	40,914,420	61,555,468
第9特定期間	45,655,539	237,833,096
第10特定期間	81,881,126	102,707,986
第11特定期間	122,884,893	24,936,434
第12特定期間	79,628,268	39,958,969
第13特定期間	32,692,095	141,028,085
第14特定期間	78,375,389	193,504,468
第15特定期間	232,636,933	36,667,630
第16特定期間	804,479,267	170,010,328
第17特定期間	239,578,963	112,886,176
第18特定期間	51,609,817	170,638,154
第19特定期間	60,911,326	166,154,780
第20特定期間	39,522,305	573,979,186
第21特定期間	44,862,742	170,432,220
第22特定期間	37,958,257	78,640,235
第23特定期間	44,101,104	96,750,683
第24特定期間	55,436,008	11,403,113

(注)本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンド中国元コース

	設定口数	解約口数
第5特定期間	9,179,274	769,001,854
第6特定期間	3,966,809	247,001,872
第7特定期間	22,515,991	315,238,232
第8特定期間	4,470,861	299,174,197
第9特定期間	51,287,855	280,647,612
第10特定期間	4,825,008	170,589,896
第11特定期間	15,587,776	43,737,308
第12特定期間	1,893,117	51,685,933
第13特定期間	23,634,440	43,060,132
第14特定期間	1,288,534	208,007,869

第15特定期間	1,327,288	57,382,884
第16特定期間	7,558,491	30,014,115
第17特定期間	3,691,064	11,989,939
第18特定期間	5,876,473	11,300,175
第19特定期間	1,890,445	16,116,575
第20特定期間	2,227,269	26,606,266
第21特定期間	2,885,771	71,904,841
第22特定期間	24,662,775	11,350,524
第23特定期間	32,140,471	12,320,221
第24特定期間	27,136,039	21,753,910

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

	設定口数	解約口数
第5特定期間	253,585,084	210,535,149
第6特定期間	141,746,767	198,280,244
第7特定期間	262,570,721	229,247,328
第8特定期間	192,289,462	128,492,342
第9特定期間	22,448,990	245,360,488
第10特定期間	21,915,540	90,560,936
第11特定期間	13,892,785	11,318,441
第12特定期間	1,524,709	32,595,799
第13特定期間	17,972,257	27,090,103
第14特定期間	7,138,880	37,488,486
第15特定期間	8,615,254	27,529,613
第16特定期間	2,881,885	9,085,696
第17特定期間	12,505,301	28,566,662
第18特定期間	4,014,345	16,741,556
第19特定期間	21,710,240	49,365,743
第20特定期間	10,399,371	5,696,517
第21特定期間	8,501,798	8,186,832
第22特定期間	5,772,856	11,818,657
第23特定期間	6,077,731	11,023,724
第24特定期間	166,484,039	4,291,953

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	610,300,742	0
第2特定期間	19,556,911	7,154,702
第3特定期間	40,891,068	2,166,466
第4特定期間	15,069,563	100,171,157
第5特定期間	249,822	44,003,339
第6特定期間	115,115	6,237,145
第7特定期間	275,176	0
第8特定期間	3,169,087,312	104,257,171
第9特定期間	6,877,718,744	798,671,437
第10特定期間	415,328,724	932,556,728
第11特定期間	174,904,911	4,184,297,130
第12特定期間	195,475,771	1,534,446,897

第13特定期間	166,643,197	1,059,427,086
第14特定期間	75,089,897	519,832,520
第15特定期間	34,400,816	555,656,650
第16特定期間	14,940,827	415,215,276
第17特定期間	59,256,016	160,471,966

(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特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

#### ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	12,000,000	0
第2特定期間	70,929	50,000
第3特定期間	316,613,323	36,817
第4特定期間	30,485,960	295,639,210
第5特定期間	68,009,516	7,902,516
第6特定期間	8,971,477	43,073,094
第7特定期間	8,864,396	40,879,664
第8特定期間	55,568,897	1,090,868
第9特定期間	4,487,010,344	57,933,276
第10特定期間	3,869,083,775	291,965,681
第11特定期間	1,002,289,783	1,136,887,180
第12特定期間	1,873,585,871	1,063,947,316
第13特定期間	1,477,090,825	1,836,184,689
第14特定期間	1,343,986,375	2,047,789,865
第15特定期間	287,558,512	2,415,939,930
第16特定期間	68,654,471	1,592,746,133
第17特定期間	33,391,466	874,256,242

(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特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

#### ハイブリッド証券ファンドマネーブルファンド

	設定口数	解約口数
第5計算期間	136,483,189	75,954,198
第6計算期間	19,746,229	24,436,213
第7計算期間	10,606,236	43,752,291
第8計算期間	32,347,448	38,698,273
第9計算期間	31,973,730	56,084,642
第10計算期間	0	0
第11計算期間	0	0
第12計算期間	113,564,929	112,470,708
第13計算期間	3,124,176	1,094,221
第14計算期間	0	0
第15計算期間	0	0
第16計算期間	0	3,124,176
第17計算期間	25,153,162	0
第18計算期間	1,924,057	0
第19計算期間	0	25,153,162
第20計算期間	0	0
第21計算期間	0	69,892,679
第22計算期間	0	1,924,057

第23計算期間	0	0
第24計算期間	0	0

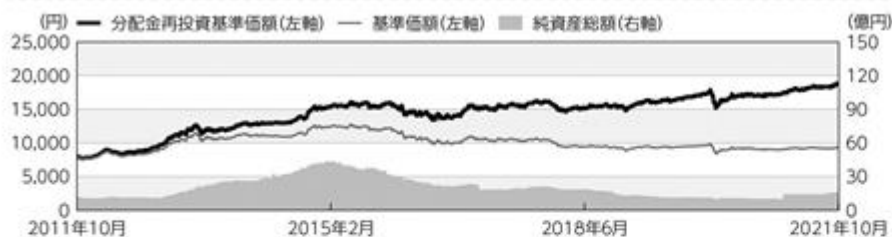
(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 参考情報

データの基準日:2021年10月29日

## 米ドルコース

## 基準価額・純資産の推移(2011年10月31日~2021年10月29日)



## 分配の推移(税引前)

2021年 6月	50円
2021年 7月	50円
2021年 8月	50円
2021年 9月	50円
2021年10月	50円
直近1年間累計	600円
設定来累計	8,045円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト・USDクラス	96.89
2	国内短期公社債マザーファンド	0.21

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年11月16日)

※分配金は1万円当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

※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。

※2021年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

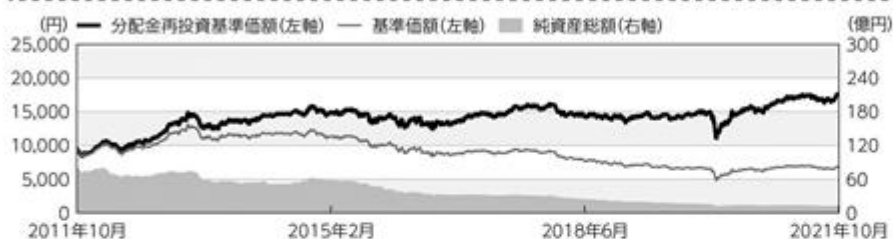
○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年10月29日

## 豪ドルコース

基準価額・純資産の推移(2011年10月31日~2021年10月29日)



分配の推移(税引前)

2021年6月	35円
2021年7月	35円
2021年8月	35円
2021年9月	35円
2021年10月	35円
直近1年間累計	420円
設定来累計	9,900円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

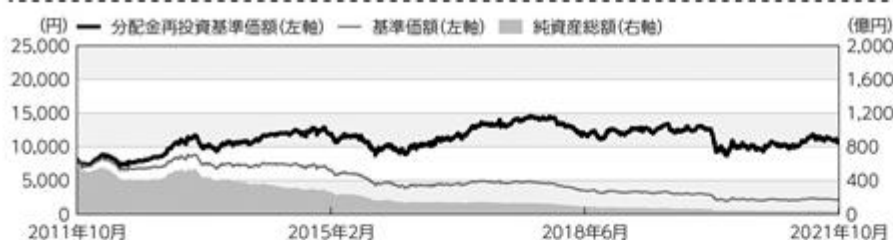
順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-AUDクラス	96.84
2	国内短期公社債マザーファンド	0.34

年間収益率の推移(暦年ベース)



## ブラジルリアルコース

基準価額・純資産の推移(2011年10月31日~2021年10月29日)



分配の推移(税引前)

2021年6月	15円
2021年7月	15円
2021年8月	15円
2021年9月	15円
2021年10月	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	10,900円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-BRLクラス	96.67
2	国内短期公社債マザーファンド	0.47

年間収益率の推移(暦年ベース)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年11月16日)

※分配金は1万口当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

※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。

※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。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

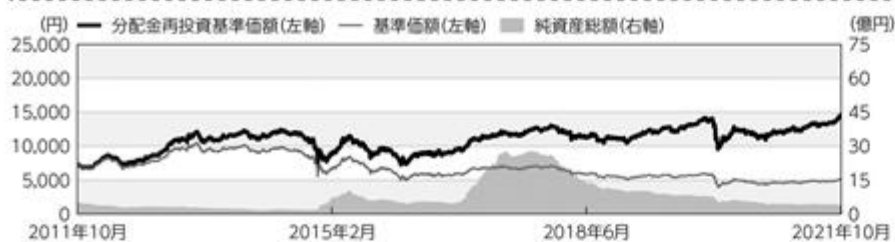
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年10月29日

## ロシアルーブルコース

## 基準価額・純資産の推移(2011年10月31日～2021年10月29日)



## 分配の推移(税引前)

2021年 6月	35円
2021年 7月	35円
2021年 8月	35円
2021年 9月	35円
2021年10月	35円
直近1年間累計	420円
設定来累計	8,805円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

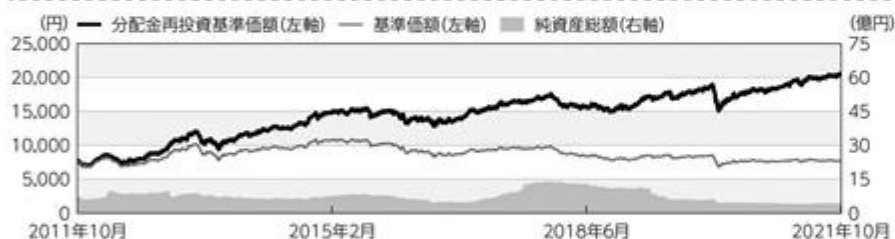
順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-RUBクラス	97.31
2	国内短期公社債マザーファンド	0.55

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



## インドルピーコース

## 基準価額・純資産の推移(2011年10月31日～2021年10月29日)



## 分配の推移(税引前)

2021年 6月	70円
2021年 7月	70円
2021年 8月	70円
2021年 9月	70円
2021年10月	70円
直近1年間累計	840円
設定来累計	9,940円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-INRクラス	97.17
2	国内短期公社債マザーファンド	0.51

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年11月16日)  
 ※分配金は1万円当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。  
 ※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。  
 ※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。  
 ※各ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

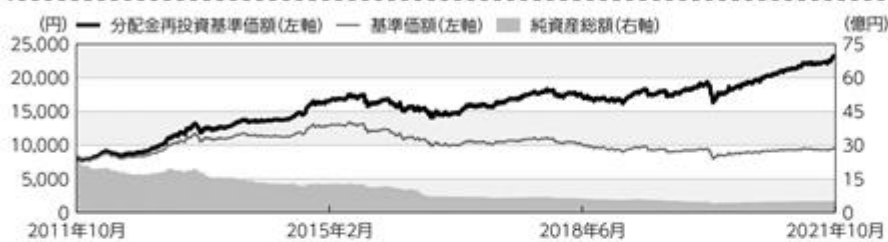
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



データの基準日:2021年10月29日

## 中国元コース

## 基準価額・純資産の推移(2011年10月31日～2021年10月29日)



## 分配の推移(税引前)

2021年 6月	80円
2021年 7月	80円
2021年 8月	80円
2021年 9月	80円
2021年10月	80円
直近1年間累計	960円
設定来累計	10,185円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

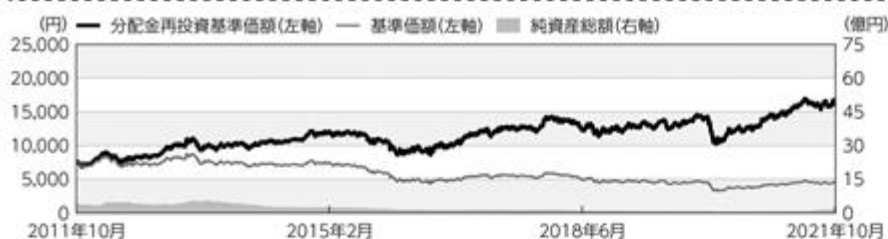
順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-CNYクラス	97.51
2	国内短期公社債マザーファンド	0.22

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



## 南アフリカランドコース

## 基準価額・純資産の推移(2011年10月31日～2021年10月29日)



## 分配の推移(税引前)

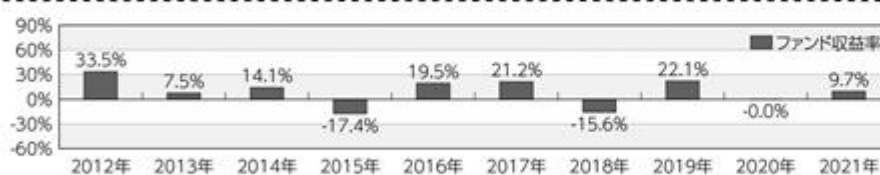
2021年 6月	30円
2021年 7月	30円
2021年 8月	30円
2021年 9月	30円
2021年10月	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	9,755円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-ZARクラス	96.21
2	国内短期公社債マザーファンド	0.14

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年11月16日)

※分配金は1万口当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

※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。

※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。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

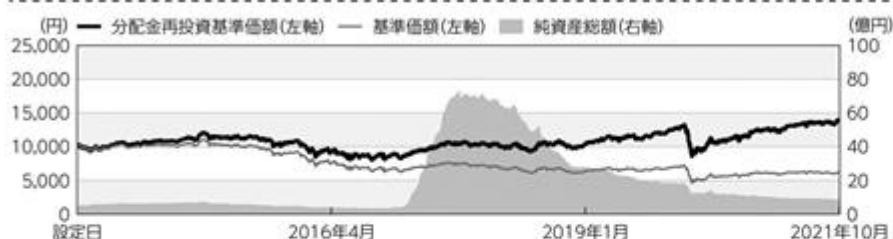
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年10月29日

## メキシコペソコース

基準価額・純資産の推移(2013年7月11日~2021年10月29日)



分配の推移(税引前)

2021年 6月	60円
2021年 7月	60円
2021年 8月	60円
2021年 9月	60円
2021年10月	60円
直近1年間累計	720円
設定来累計	5,880円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

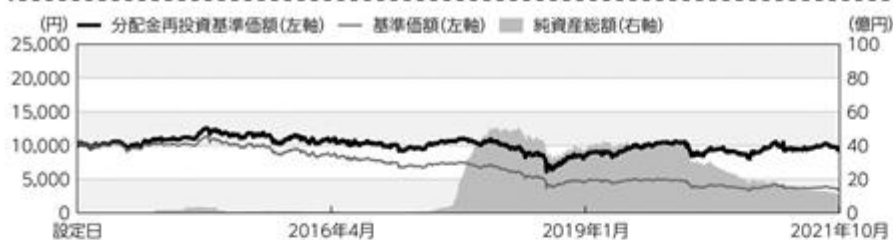
順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト・MXNクラス	95.97
2	国内短期公社債マザーファンド	0.94

年間収益率の推移(暦年ベース)



## トルコリラコース

基準価額・純資産の推移(2013年7月11日~2021年10月29日)



分配の推移(税引前)

2021年 6月	35円
2021年 7月	35円
2021年 8月	35円
2021年 9月	35円
2021年10月	35円
直近1年間累計	420円
設定来累計	6,230円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト・TRYクラス	96.87
2	国内短期公社債マザーファンド	0.10

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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:2013年7月11日)

※分配金は1万口当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

※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。

※2013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。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

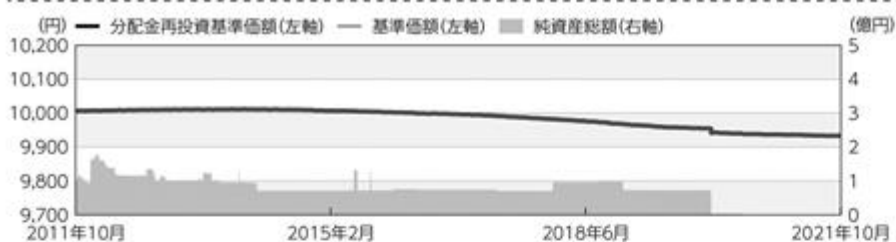
○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年10月29日

## マネーブルファンド

## 基準価額・純資産の推移(2011年10月31日~2021年10月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年11月16日)

## 分配の推移(税引前)

年月	分配額(円)
2019年10月	0円
2020年4月	0円
2020年10月	0円
2021年4月	0円
2021年10月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内短期公社債マザーファンド	96.82

## ■国内短期公社債マザーファンド

※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。

## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	100.00
合計(純資産総額)	100.00

## 組入銘柄

該当事項はありません。

## 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。

※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。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

## ■グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト(2021年10月8日現在)

※ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントからの情報を基に作成しています。

※比率(%)は、グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラストの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	業種	通貨	国/地域	クーポン(%)	比率(%)
1	ABN AMRO BANK NV	銀行	米ドル	オランダ	4.40000	2.9
2	CREDIT AGRICOLE SA	銀行	米ドル	フランス	4.37500	2.8
3	BARCLAYS PLC	銀行	米ドル	イギリス	5.20000	2.3
4	BNP PARIBAS	銀行	米ドル	フランス	4.37500	2.1
5	BANK OF AMERICA CORP	銀行	米ドル	アメリカ	4.18300	2.1
6	COOPERATIEVE RABOBANK UA	銀行	米ドル	オランダ	3.75000	1.9
7	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	米ドル	アメリカ	4.25000	1.9
8	CLOVERIE PLC ZURICH INS	保険	米ドル	アイルランド	5.62500	1.7
9	ASSICURAZIONI GENERALI	保険	ユーロ	イタリア	5.50000	1.7
10	MORGAN STANLEY	銀行	米ドル	アメリカ	3.95000	1.6

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

(イ) 取得申込者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」について、販売会社ごとに定める申込単位で、取得申込受付日の翌営業日の基準価額で購入することができます。ただし、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。

また、スイッチングにより各ファンドを買い付ける場合は、販売会社ごとに定める申込単位となります。スイッチングについて、「分配金受取コース」の場合はスイッチング対象ファンドの同コースへ、「分配金再投資コース」の場合はスイッチング対象ファンドの同コースへのスイッチングとなります。ただし、マネープールファンドは、ご投資された資金を一時待機させておくためのものです。したがって、そのお買い付けは、各通貨コースからのスイッチングの場合に限定します。なお、販売会社によっては、スイッチングの取り扱いを行わない場合があります。

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

<http://www.am-one.co.jp/>

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込金額に手数料および当該手数料にかかる消費税等を加算した金額を販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

(ロ) 「分配金再投資コース」での取得申込者は販売会社との間で「ハイブリッド証券ファンド\*自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

・上記\*には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	
ロシアルーブルコース	インドルピーコース	中国元コース	南アフリカランドコース
メキシコペソコース	トルコリラコース	マネープールファンド	

(ハ) 取得およびスイッチングの申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

なお、各通貨コースについては申込日が以下のいずれかに該当する日には、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

ただし、次の4つのコースでは、以下に該当する日についても、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

ブラジルリアルコース：サンパウロの銀行の休業日

ロシアルーブルコース：ロシアの銀行の休業日

インドルピーコース：インドの銀行の休業日

中国元コース：中国の銀行の休業日

また、各通貨コースにおいて、取引所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、マネープールファンドにおいては、取引所における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、取得およびスイッチングの申し込みの受付を中止することおよび既に受け付けた取得およびスイッチングの申し込みの受付を取り消すことができます。ただし、別に定める契約に基づく収益分配金の再投資にかかる追加信託金の申し込みに限ってこれを受け付けるものとします。

## 2【換金（解約）手続等】

一部解約（解約請求によるご解約）

（イ）受益者は、「分配金受取コース」、「分配金再投資コース」の両コースとも販売会社が定める単位で、一部解約の実行を請求することができます。

なお、受付は原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

また、投資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。

（ロ）受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

（ハ）委託者は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。また、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。

（ニ）一部解約の価額は、各通貨コースの場合は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とし、マネープールファンドの場合は一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約に関して課税対象者にかかる所得税および地方税（法人の受益者の場合は所得税のみ）に相当する金額が控除されます。

なお、一部解約の価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

基準価額につきましては、アセットマネジメントOne株式会社のインターネットホームページ（<http://www.am-one.co.jp/>）または、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額および一部解約の価額は、前日以前のものとなります。（ただし、マネープールファンドにつきましては、インターネットホームページおよび日本経済新聞朝刊には掲載されません。）

- (ホ)一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において受益者に支払われます。ただし、各通貨コースにおいて、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所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、委託者の判断により、一部解約金の支払いを延期する場合があります。
- (ヘ)委託者は、各通貨コースについて以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
  - ・ニューヨークの銀行の休業日
  - ・ロンドンの銀行の休業日
- ただし、次の4つのコースでは、以下に該当する日についても、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ブラジルリアルコース：サンパウロの銀行の休業日
  - ロシアルーブルコース：ロシアの銀行の休業日
  - インドルピーコース：インドの銀行の休業日
  - 中国元コース：中国の銀行の休業日
- (ト)委託者は、各通貨コースにおいて、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所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、マネープールファンドにおいては、取引所における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- (チ)上記(ト)により一部解約の実行の請求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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(各通貨コースにおいて、この日が一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。)に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記(二)の規定に準じて計算された価額とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、投資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投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

基準価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。）

インターネットホームページ

<http://www.am-one.co.jp/>

基準価額は、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額は、前日以前のものとなります。（ただし、マネープールファンドにつきましては、インターネットホームページおよび日本経済新聞朝刊には掲載されません。）

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

##### 各通貨コース

投資対象	評価方法
外国投資信託証券	計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

##### マネープールファンド

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
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

各ファンド共通

各ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2024年10月15日までです。

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

各通貨コース

各ファンドの計算期間は、原則として毎月13日から翌月12日までとします。

上記にかかわらず、上記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以降の営業日で該当日に最も近い日とし、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、投資信託約款に定める信託期間の終了日とします。

マネープールファンド

当ファンドの計算期間は、原則として毎年4月13日から10月12日、10月13日から翌年4月12日までとします。

上記にかかわらず、上記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以降の営業日で該当日に最も近い日とし、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、投資信託約款に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

各ファンド共通

a. 信託の終了(投資信託契約の解約)

(イ) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が、各通貨コースの場合は30億口、マネープールファンドの場合は1億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。またはこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

(ロ) 委託者は、各通貨コースにおいて信託終了前に、所定の運用の基本方針に基づき、投資を行ったサブデット・ファンドが償還、または次に掲げる事項の変更により商品の同一性が失われた場合は、委託者は受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、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。

1. サブデット・ファンドの主要投資対象が変更となる場合

2. サブデット・ファンドの取得の条件または換金の条件について、投資者に著しく不利となる変更がある場合

(ハ) 委託者は、上記(イ)の事項について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしたがいま

す。

(ニ) 委託者は、監督官庁よりこの投資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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。



(ホ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「c. 書面決議の手続き」の規定における書面決議が否決となる場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(ヘ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「b. 投資信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### b. 投資信託約款の変更等

(イ) 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託者は、上記(イ)の事項(投資信託約款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、併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしたがいます。

(ハ) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、上記(イ)および(ロ)の規定にしたがいます。

この投資信託約款は上記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。

#### c. 書面決議の手続き

(イ) 委託者は、上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(イ)について、または「b. 投資信託約款の変更等」(イ)の事項のうち重大な約款の変更等について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由または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、各ファンドにかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ロ) 上記(イ)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の投資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者を除きます。以下本項において同じ。)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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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。

(八) 上記(イ)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。

(二) 重大な約款の変更等における書面決議の効力は、各ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

(ホ) 上記(イ)から(二)までの規定は、委託者が投資信託契約の解約または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、各ファンド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および上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(ロ)の規定に基づいてこの投資信託契約を解約する場合には適用しません。また、投資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(イ)から(八)までに規定する各ファンドの解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

(ヘ) 上記(イ)から(ホ)の規定にかかわらず、各ファンド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。

#### d. 反対受益者の受益権買取請求の不適用

各ファンドは、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託者が投資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、投資信託契約の解約(上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(ロ)の場合を除きます。)または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。

#### e. 運用報告書

委託者は、毎年4月、10月の決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知っている受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

運用報告書(全体版)は、下記「f. 公告」に記載の委託者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)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### f. 公告

委託者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、次のアドレスに掲載します。

<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ます。

#### g. 委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

h. 信託事務処理の再信託

- (イ) 受託者は、各ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。
- (ロ) 上記(イ)における株式会社日本カストディ銀行に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

i. 信託業務の委託等

- (イ) 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。
  1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
  2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
  3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
  4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- (ロ) 受託者は、上記(イ)に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が上記(イ)各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- (ハ) 上記(イ)および(ロ)にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。
  1. 投資信託財産の保存にかかる業務
  2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

j. 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

k. 関係法人との契約の更改

委託者と販売会社との間において締結している「証券投資信託に関する基本契約」の有効期間は契約の締結日から1年ですが、期間満了前に委託者、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは自動的に1年間更新されるものとし、その後も同様とします。

#### 4【受益者の権利等】

##### a．収益分配金請求権

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

受益者が収益分配金支払開始日から5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。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる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て)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から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、受益者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を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### b．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て)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。

##### c．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。

##### d．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】

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース  
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース  
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース  
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース  
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース  
ハイブリッド証券ファンド中国元コース  
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース  
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース  
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

(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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2021年4月13日から2021年10月12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。

#### ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

(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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 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24期計算期間(2021年4月13日から2021年10月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【ハイブリッド証券ファンド米ドルコース】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	52,021,761	67,267,884
投資信託受益証券	1,387,837,501	1,517,185,275
親投資信託受益証券	3,415,115	3,414,776
流動資産合計	1,443,274,377	1,587,867,935
資産合計	1,443,274,377	1,587,867,935
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	7,736,491	8,596,018
未払解約金	3,806,344	-
未払受託者報酬	39,989	40,406
未払委託者報酬	1,359,952	1,374,096
その他未払費用	3,544	3,582
流動負債合計	12,946,320	10,014,102
負債合計	12,946,320	10,014,102
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,547,298,296	1,719,203,669
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	116,970,239	141,349,836
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	1,430,328,057	1,577,853,833
純資産合計	1,430,328,057	1,577,853,833
負債純資産合計	1,443,274,377	1,587,867,935

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	32,405,237	37,366,063
有価証券売買等損益	38,047,574	8,347,435
営業収益合計	70,452,811	45,713,498
<b>営業費用</b>		
支払利息	5,424	3,505
受託者報酬	189,796	239,574
委託者報酬	6,454,878	8,147,201
その他費用	16,808	21,233
営業費用合計	6,666,906	8,411,513
営業利益又は営業損失( )	63,785,905	37,301,985
経常利益又は経常損失( )	63,785,905	37,301,985
当期純利益又は当期純損失( )	63,785,905	37,301,985
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( )	699,498	84,281
期首剰余金又は期首欠損金( )	102,514,076	116,970,239
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,800,213	5,949,898
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,800,213	5,949,898
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,151,331	20,059,411
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	53,151,331	20,059,411
分配金	40,191,452	47,656,350
期末剰余金又は期末欠損金( )	116,970,239	141,349,836

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年4月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	1,111,561,855円	1,547,298,296円
期中追加設定元本額	597,999,270円	248,220,795円
期中一部解約元本額	162,262,829円	76,315,422円
2. 受益権の総数	1,547,298,296口	1,719,203,669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116,970,239円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は141,349,836円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年10月13日 至2020年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,128,126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(378,776,061円)及び分配準備積立金(8,978,048円)より分配対象収益は391,882,235円(1万口当たり3,466.88円)であり、うち5,651,792円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月13日 至2021年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,021,279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(517,218,115円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は522,239,394円(1万口当たり3,372.76円)であり、うち7,742,017円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>



(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,868,807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(381,029,337円)及び分配準備積立金(7,432,675円)より分配対象収益は392,330,819円(1万口当たり3,450.91円)であり、うち5,684,448円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,871,607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(380,257,326円)及び分配準備積立金(5,598,996円)より分配対象収益は389,727,929円(1万口当たり3,435.03円)であり、うち5,672,833円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,919,348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(519,894,792円)及び分配準備積立金(3,450,071円)より分配対象収益は527,264,211円(1万口当たり3,410.39円)であり、うち7,730,240円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,248,624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(518,553,313円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は524,801,937円(1万口当たり3,400.89円)であり、うち7,715,648円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,920,494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(515,274,986円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は521,195,480円(1万口当たり3,360.93円)であり、うち7,753,718円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,037,349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(508,676,476円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は513,713,825円(1万口当たり3,343.81円)であり、うち7,681,550円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,969,116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(501,887,200円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は506,856,316円(1万口当たり3,326.42円)であり、うち7,618,626円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,783,516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(541,589,060円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は546,372,576円(1万口当たり3,305.57円)であり、うち8,264,421円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,058,892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(518,526,493円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は524,585,385円(1万口当たり3,390.33円)であり、うち7,736,491円(1万口当たり50円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,897,114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(559,712,974円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は565,610,088円(1万口当たり3,289.95円)であり、うち8,596,018円(1万口当たり50円)を分配金額としております。
--	--	---

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	14,121,427	8,942,639
親投資信託受益証券	-	-
合計	14,121,427	8,942,639

## (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)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.9244円	0.9178円
(1万口当たり純資産額)	(9,244円)	(9,178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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - U SDクラス	1,475,717,611	1,517,185,275	
投資信託受益証券 合計		1,475,717,611	1,517,185,275	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	3,391,713	3,414,776	
親投資信託受益証券 合計		3,391,713	3,414,776	
合計			1,520,600,051	

(注) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	37,603,204	35,319,262
投資信託受益証券	1,322,510,727	1,201,188,140
親投資信託受益証券	4,520,679	4,520,230
流動資産合計	1,364,634,610	1,241,027,632
<b>資産合計</b>		
1,364,634,610		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,891,757	6,555,759
未払解約金	571,732	1,359,853
未払受託者報酬	38,271	32,157
未払委託者報酬	1,301,324	1,093,596
その他未払費用	3,394	2,850
流動負債合計	8,806,478	9,044,215
<b>負債合計</b>		
8,806,478		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,969,073,502	1,873,074,039
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	613,245,370	641,090,622
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	1,355,828,132	1,231,983,417
純資産合計	1,355,828,132	1,231,983,417
負債純資産合計	1,364,634,610	1,241,027,632

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	35,573,456	32,252,068
有価証券売買等損益	108,742,305	43,323,036
営業収益合計	144,315,761	11,070,968
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,829	2,781
受託者報酬	221,189	213,140
委託者報酬	7,522,162	7,248,620
その他費用	19,588	18,891
営業費用合計	7,766,768	7,483,432
営業利益又は営業損失( )	136,548,993	18,554,400
経常利益又は経常損失( )	136,548,993	18,554,400
当期純利益又は当期純損失( )	136,548,993	18,554,400
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( )	358,971	1,239,334
期首剰余金又は期首欠損金( )	742,039,585	613,245,370
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,039,576	41,455,263
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	37,039,576	41,455,263
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,062,062	12,084,129
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	3,062,062	12,084,129
分配金	42,091,263	39,901,320
期末剰余金又は期末欠損金( )	613,245,370	641,090,622

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年4月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	2,070,312,504円	1,969,073,502円
期中追加設定元本額	9,466,414円	34,916,705円
期中一部解約元本額	110,705,416円	130,916,168円
2. 受益権の総数	1,969,073,502口	1,873,074,039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613,245,370円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は641,090,622円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年10月13日 至2020年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,440,544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(549,654,991円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は555,095,535円(1万口当たり2,720.32円)であり、うち7,141,920円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月13日 至2021年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,620,396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(518,363,441円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は523,983,837円(1万口当たり2,671.73円)であり、うち6,864,248円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>

(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,489,202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(545,203,999円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は550,693,201円(1万口当たり2,712.36円)であり、うち7,106,080円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,765,007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(539,792,352円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は545,557,359円(1万口当たり2,705.95円)であり、うち7,056,471円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,777,999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(533,046,428円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は537,824,427円(1万口当たり2,694.89円)であり、うち6,984,995円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,721,293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(525,145,561円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は530,866,854円(1万口当たり2,688.89円)であり、うち6,910,040円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,195,925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(505,965,525円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は510,161,450円(1万口当たり2,658.60円)であり、うち6,716,184円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,365,200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(500,061,309円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は504,426,509円(1万口当たり2,646.50円)であり、うち6,671,040円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,006,393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(486,502,983円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は490,509,376円(1万口当たり2,633.01円)であり、うち6,520,228円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,714,313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(487,970,202円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は491,684,515円(1万口当たり2,617.78円)であり、うち6,573,861円(1万口当たり35円)を分配金額としております。



	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,762,007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(522,570,511円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は527,332,518円(1万口当たり2,678.07円)であり、うち6,891,757円(1万口当たり35円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,836,282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(483,775,000円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は487,611,282円(1万口当たり2,603.26円)であり、うち6,555,759円(1万口当たり35円)を分配金額としております。
--	--	---

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	10,561,603	2,329,389
親投資信託受益証券	-	-
合計	10,561,603	2,329,389

## (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)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.6886円	0.6577円
(1万口当たり純資産額)	(6,886円)	(6,577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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - A UDクラス	1,552,925,844	1,201,188,140	
投資信託受益証券 合計		1,552,925,844	1,201,188,140	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	4,489,701	4,520,230	
親投資信託受益証券 合計		4,489,701	4,520,230	
合計			1,205,708,370	

(注) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	114,905,210	155,232,604
投資信託受益証券	3,651,434,603	3,362,048,367
親投資信託受益証券	16,287,291	16,285,673
流動資産合計	3,782,627,104	3,533,566,644
<b>資産合計</b>		
3,782,627,104		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	26,859,846	24,371,474
未払解約金	6,863,689	10,283,897
未払受託者報酬	106,067	94,664
未払委託者報酬	3,606,481	3,218,615
その他未払費用	9,421	8,407
流動負債合計	37,445,504	37,977,057
<b>負債合計</b>		
37,445,504		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,906,564,581	16,247,649,564
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,161,382,981	12,752,059,977
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	3,745,181,600	3,495,589,587
純資産合計	3,745,181,600	3,495,589,587
<b>負債純資産合計</b>	<b>3,782,627,104</b>	<b>3,533,566,644</b>

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	149,633,558	135,753,093
有価証券売買等損益	16,508,194	160,612,146
営業収益合計	166,141,752	296,365,239
<b>営業費用</b>		
支払利息	11,416	7,956
受託者報酬	647,836	643,782
委託者報酬	22,027,981	21,889,964
その他費用	57,572	57,211
営業費用合計	22,744,805	22,598,913
営業利益又は営業損失( )	143,396,947	273,766,326
経常利益又は経常損失( )	143,396,947	273,766,326
当期純利益又は当期純損失( )	143,396,947	273,766,326
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( )	2,556,461	1,437,206
期首剰余金又は期首欠損金( )	15,080,451,032	14,161,382,981
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,023,589,356	1,364,815,173
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,023,589,356	1,364,815,173
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,945,314	76,797,250
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	85,945,314	76,797,250
分配金	164,529,399	153,898,451
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,161,382,981	12,752,059,977

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年4月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	19,101,541,196円	17,906,564,581円
期中追加設定元本額	109,167,159円	98,923,039円
期中一部解約元本額	1,304,143,774円	1,757,838,056円
2. 受益権の総数	17,906,564,581口	16,247,649,564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14,161,382,981円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は12,752,059,977円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年10月13日 至2020年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,471,884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(162,836,112円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は188,307,996円(1万口当たり100.42円)であり、うち28,127,372円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月13日 至2021年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,362,924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(125,215,365円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は147,578,289円(1万口当たり83.48円)であり、うち26,515,261円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>

(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(24,905,767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(158,007,267円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は182,913,034円(1万口当たり98.88円)であり、うち27,745,719円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,407,485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(153,716,009円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は175,123,494円(1万口当たり95.56円)であり、うち27,486,205円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(24,385,970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(146,316,930円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は170,702,900円(1万口当たり93.99円)であり、うち27,240,383円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,945,644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(142,564,519円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は162,510,163円(1万口当たり90.05円)であり、うち27,069,874円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,832,149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(120,201,807円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は142,033,956円(1万口当たり80.92円)であり、うち26,326,569円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,431,558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(114,684,395円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は133,115,953円(1万口当たり76.52円)であり、うち26,093,811円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,198,392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(106,405,640円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は128,604,032円(1万口当たり74.35円)であり、うち25,943,492円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,357,883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(97,535,579円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は115,893,462円(1万口当たり70.52円)であり、うち24,647,844円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,279,053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(134,389,482円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は153,668,535円(1万口当たり85.81円)であり、うち26,859,846円(1万口当たり15円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,396,958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(90,222,550円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は108,619,508円(1万口当たり66.85円)であり、うち24,371,474円(1万口当たり15円)を分配金額としております。
--	---	---

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	15,355,065	154,005,145
親投資信託受益証券	-	-
合計	15,355,065	154,005,145

## （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）

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.2092円	0.2151円
（1万口当たり純資産額）	(2,092円)	(2,151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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - B RLクラス	13,600,519,288	3,362,048,367	
投資信託受益証券 合計		13,600,519,288	3,362,048,367	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	16,175,679	16,285,673	
親投資信託受益証券 合計		16,175,679	16,285,673	
合計			3,378,334,040	

(注) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	12,994,836	15,559,077
投資信託受益証券	398,348,958	407,437,477
親投資信託受益証券	2,340,613	2,340,381
流動資産合計	413,684,407	425,336,935
資産合計	413,684,407	425,336,935
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,154,527	2,988,877
未払解約金	5,557	268,390
未払受託者報酬	11,942	10,973
未払委託者報酬	406,229	373,429
その他未払費用	1,045	959
流動負債合計	3,579,300	3,642,628
負債合計	3,579,300	3,642,628
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	901,293,700	853,965,081
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	491,188,593	432,270,774
(分配準備積立金)	34,964,315	33,356,791
元本等合計	410,105,107	421,694,307
純資産合計	410,105,107	421,694,307
負債純資産合計	413,684,407	425,336,935

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自	2020年10月13日 至 2021年4月12日	自	2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		22,161,706		20,473,797
有価証券売買等損益		5,782,386		35,088,287
営業収益合計		27,944,092		55,562,084
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,779		798
受託者報酬		73,083		70,734
委託者報酬		2,486,624		2,406,375
その他費用		6,416		6,208
営業費用合計		2,567,902		2,484,115
営業利益又は営業損失( )		25,376,190		53,077,969
経常利益又は経常損失( )		25,376,190		53,077,969
当期純利益又は当期純損失( )		25,376,190		53,077,969
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( )		403,218		195,502
期首剰余金又は期首欠損金( )		613,043,912		491,188,593
剰余金増加額又は欠損金減少額		124,290,121		30,571,234
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		124,290,121		30,571,234
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,211,332		5,929,519
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		8,211,332		5,929,519
分配金		20,002,878		18,606,363
期末剰余金又は期末欠損金( )		491,188,593		432,270,774

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年4月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	1,114,851,185円	901,293,700円
期中追加設定元本額	15,250,453円	11,299,155円
期中一部解約元本額	228,807,938円	58,627,774円
2. 受益権の総数	901,293,700口	853,965,081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491,188,593円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は432,270,774円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年10月13日 至2020年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,372,160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(326,309,221円)及び分配準備積立金(37,682,327円)より分配対象収益は367,363,708円(1万口当たり3,776.86円)であり、うち3,404,342円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月13日 至2021年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,320,916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(302,850,949円)及び分配準備積立金(34,864,278円)より分配対象収益は341,036,143円(1万口当たり3,784.43円)であり、うち3,154,041円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>

(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,574,121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(325,171,877円)及び分配準備積立金(37,430,849円)より分配対象収益は366,176,847円(1万口当たり3,778.74円)であり、うち3,391,650円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,372,032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(325,255,666円)及び分配準備積立金(37,539,421円)より分配対象収益は366,167,119円(1万口当たり3,778.54円)であり、うち3,391,743円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,528,686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(322,768,456円)及び分配準備積立金(37,136,679円)より分配対象収益は363,433,821円(1万口当たり3,780.24円)であり、うち3,364,906円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,555,226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(316,227,858円)及び分配準備積立金(36,437,683円)より分配対象収益は356,220,767円(1万口当たり3,783.01円)であり、うち3,295,710円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,346,188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(302,721,417円)及び分配準備積立金(34,872,607円)より分配対象収益は340,940,212円(1万口当たり3,786.60円)であり、うち3,151,347円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,976,336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(302,275,844円)及び分配準備積立金(34,946,604円)より分配対象収益は340,198,784円(1万口当たり3,784.71円)であり、うち3,146,062円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,276,036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(300,007,250円)及び分配準備積立金(34,453,742円)より分配対象収益は337,737,028円(1万口当たり3,786.44円)であり、うち3,121,870円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,133,168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(292,588,068円)及び分配準備積立金(33,699,487円)より分配対象収益は329,420,723円(1万口当たり3,787.48円)であり、うち3,044,166円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,112,875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(302,799,501円)及び分配準備積立金(35,005,967円)より分配対象収益は340,918,343円(1万口当たり3,782.54円)であり、うち3,154,527円(1万口当たり35円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,218,244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(287,321,443円)及び分配準備積立金(33,127,424円)より分配対象収益は323,667,111円(1万口当たり3,790.16円)であり、うち2,988,877円(1万口当たり35円)を分配金額としております。
--	---	--

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	18,168,894	9,764,526
親投資信託受益証券	-	-
合計	18,168,894	9,764,526

## (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)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.4550円	0.4938円
(1万口当たり純資産額)	(4,550円)	(4,938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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - R UBクラス	1,105,364,832	407,437,477	
投資信託受益証券 合計		1,105,364,832	407,437,477	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	2,324,574	2,340,381	
親投資信託受益証券 合計		2,324,574	2,340,381	
合計			409,777,858	

(注) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,263,082	20,266,004
投資信託受益証券	390,862,450	417,175,028
親投資信託受益証券	2,243,507	2,243,284
流動資産合計	410,369,039	439,684,316
資産合計	410,369,039	439,684,316
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,702,119	4,010,349
未払解約金	161,036	-
未払受託者報酬	11,528	11,485
未払委託者報酬	392,191	390,732
その他未払費用	1,010	1,013
流動負債合計	4,267,884	4,413,579
負債合計	4,267,884	4,413,579
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	528,874,143	572,907,038
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	122,772,988	137,636,301
(分配準備積立金)	19,928,740	12,930,685
元本等合計	406,101,155	435,270,737
純資産合計	406,101,155	435,270,737
負債純資産合計	410,369,039	439,684,316

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自	2020年10月13日 至 2021年4月12日	自	2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		19,777,696		18,136,881
有価証券売買等損益		2,619,513		2,312,355
営業収益合計		22,397,209		20,449,236
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,471		992
受託者報酬		69,864		70,197
委託者報酬		2,376,986		2,388,207
その他費用		6,137		6,156
営業費用合計		2,454,458		2,465,552
営業利益又は営業損失( )		19,942,751		17,983,684
経常利益又は経常損失( )		19,942,751		17,983,684
当期純利益又は当期純損失( )		19,942,751		17,983,684
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( )		320,990		20,723
期首剰余金又は期首欠損金( )		132,223,448		122,772,988
剰余金増加額又は欠損金減少額		23,053,431		2,625,659
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		23,053,431		2,625,659
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,137,710		12,369,752
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		10,137,710		12,369,752
分配金		23,087,022		23,123,627
期末剰余金又は期末欠損金( )		122,772,988		137,636,301

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年4月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	581,523,722円	528,874,143円
期中追加設定元本額	44,101,104円	55,436,008円
期中一部解約元本額	96,750,683円	11,403,113円
2. 受益権の総数	528,874,143口	572,907,038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122,772,988円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は137,636,301円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年10月13日 至2020年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,199,261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(228,947,836円)及び分配準備積立金(29,138,762円)より分配対象収益は261,285,859円(1万口当たり4,519.08円)であり、うち4,047,285円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月13日 至2021年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,870,028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(210,476,203円)及び分配準備積立金(19,672,436円)より分配対象収益は233,018,667円(1万口当たり4,427.54円)であり、うち3,684,055円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>

(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,058,049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(225,311,029円)及び分配準備積立金(27,680,655円)より分配対象収益は256,049,733円(1万口当たり4,502.92円)であり、うち3,980,408円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,203,172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(223,682,845円)及び分配準備積立金(26,412,572円)より分配対象収益は253,298,589円(1万口当たり4,489.80円)であり、うち3,949,150円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,892,101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(214,064,229円)及び分配準備積立金(23,208,434円)より分配対象収益は240,164,764円(1万口当たり4,474.92円)であり、うち3,756,829円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,011,790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(208,103,686円)及び分配準備積立金(21,659,401円)より分配対象収益は232,774,877円(1万口当たり4,462.67円)であり、うち3,651,231円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,856,025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(210,859,426円)及び分配準備積立金(18,797,841円)より分配対象収益は232,513,292円(1万口当たり4,411.75円)であり、うち3,689,218円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,675,010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(221,886,946円)及び分配準備積立金(17,958,230円)より分配対象収益は242,520,186円(1万口当たり4,390.19円)であり、うち3,866,894円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,814,207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(225,300,430円)及び分配準備積立金(16,765,251円)より分配対象収益は244,879,888円(1万口当たり4,370.41円)であり、うち3,922,184円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,722,392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(227,097,535円)及び分配準備積立金(15,626,131円)より分配対象収益は245,446,058円(1万口当たり4,348.65円)であり、うち3,950,927円(1万口当たり70円)を分配金額としております。

	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,632,867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(211,337,738円)及び分配準備積立金(20,997,992円)より分配対象収益は234,968,597円(1万口当たり4,442.80円)であり、うち3,702,119円(1万口当たり70円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,582,698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(230,769,008円)及び分配準備積立金(14,358,336円)より分配対象収益は247,710,042円(1万口当たり4,323.73円)であり、うち4,010,349円(1万口当たり70円)を分配金額としております。
--	---	--

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	5,779,578	6,836,358
親投資信託受益証券	-	-
合計	5,779,578	6,836,358

## (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)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.7679円	0.7598円
(1万口当たり純資産額)	(7,679円)	(7,598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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - I NRクラス	785,788,337	417,175,028	
投資信託受益証券 合計		785,788,337	417,175,028	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	2,228,133	2,243,284	
親投資信託受益証券 合計		2,228,133	2,243,284	
合計			419,418,312	

(注) 投資信託受益証券及び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。



## 【ハイブリッド証券ファンド中国元コース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	27,301,542	16,613,415
投資信託受益証券	474,909,922	493,866,103
親投資信託受益証券	1,138,374	1,138,261
流動資産合計	503,349,838	511,617,779
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,298,498	4,341,556
未払解約金	5,852	1,945,552
未払受託者報酬	13,710	13,267
未払委託者報酬	466,438	451,400
その他未払費用	1,210	1,166
流動負債合計	4,785,708	6,752,941
負債合計	4,785,708	6,752,941
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	537,312,374	542,694,503
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	38,748,244	37,829,665
(分配準備積立金)	86,219,283	74,025,088
元本等合計	498,564,130	504,864,838
純資産合計	498,564,130	504,864,838
負債純資産合計	503,349,838	511,617,779

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	17,749,595	18,931,517
有価証券売買等損益	23,972,777	10,956,068
営業収益合計	41,722,372	29,887,585
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,537	1,253
受託者報酬	78,674	83,428
委託者報酬	2,676,611	2,838,330
その他費用	6,927	7,335
営業費用合計	2,763,749	2,930,346
営業利益又は営業損失( )	38,958,623	26,957,239
経常利益又は経常損失( )	38,958,623	26,957,239
当期純利益又は当期純損失( )	38,958,623	26,957,239
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( )	4,945	12,026
期首剰余金又は期首欠損金( )	51,228,556	38,748,244
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,035,428	1,494,962
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,035,428	1,494,962
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,372,136	1,692,771
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	2,372,136	1,692,771
分配金	25,136,658	25,828,825
期末剰余金又は期末欠損金( )	38,748,244	37,829,665

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年4月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	517,492,124円	537,312,374円
期中追加設定元本額	32,140,471円	27,136,039円
期中一部解約元本額	12,320,221円	21,753,910円
2. 受益権の総数	537,312,374口	542,694,503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38,748,244円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は37,829,665円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年10月13日 至2020年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,660,382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(42,899,285円)及び分配準備積立金(96,789,994円)より分配対象収益は142,349,661円(1万口当たり2,747.57円)であり、うち4,144,740円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月13日 至2021年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,886,676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(49,740,090円)及び分配準備積立金(85,092,783円)より分配対象収益は137,719,549円(1万口当たり2,585.39円)であり、うち4,261,462円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>

(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,643,709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(44,223,101円)及び分配準備積立金(95,299,388円)より分配対象収益は142,166,198円(1万口当たり2,718.19円)であり、うち4,184,140円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,765,686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(44,024,682円)及び分配準備積立金(92,732,013円)より分配対象収益は139,522,381円(1万口当たり2,691.54円)であり、うち4,146,980円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,803,925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(45,193,592円)及び分配準備積立金(91,324,304円)より分配対象収益は139,321,821円(1万口当たり2,665.27円)であり、うち4,181,843円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,899,442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(45,671,678円)及び分配準備積立金(89,426,710円)より分配対象収益は137,997,830円(1万口当たり2,640.81円)であり、うち4,180,457円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,017,773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(49,875,453円)及び分配準備積立金(83,114,150円)より分配対象収益は136,007,376円(1万口当たり2,562.34円)であり、うち4,246,348円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,742,451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(51,970,304円)及び分配準備積立金(81,669,864円)より分配対象収益は136,382,619円(1万口当たり2,533.28円)であり、うち4,306,898円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,821,842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(53,161,988円)及び分配準備積立金(79,701,338円)より分配対象収益は135,685,168円(1万口当たり2,505.42円)であり、うち4,332,517円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,605,031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(53,971,480円)及び分配準備積立金(77,612,014円)より分配対象収益は134,188,525円(1万口当たり2,473.49円)であり、うち4,340,044円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,662,540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(49,783,901円)及び分配準備積立金(87,855,241円)より分配対象収益は140,301,682円(1万口当たり2,611.17円)であり、うち4,298,498円(1万口当たり80円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,860,057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(54,388,098円)及び分配準備積立金(75,506,587円)より分配対象収益は132,754,742円(1万口当たり2,446.21円)であり、うち4,341,556円(1万口当たり80円)を分配金額としております。
--	--	---

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	432,917	2,365,364
親投資信託受益証券	-	-
合計	432,917	2,365,364

## (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)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.9279円	0.9303円
(1万口当たり純資産額)	(9,279円)	(9,303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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - C NYクラス	550,084,767	493,866,103	
投資信託受益証券 合計		550,084,767	493,866,103	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	1,130,574	1,138,261	
親投資信託受益証券 合計		1,130,574	1,138,261	
合計			495,004,364	

(注) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,492,096	6,390,140
投資信託受益証券	79,490,633	147,703,842
親投資信託受益証券	238,333	238,309
流動資産合計	83,221,062	154,332,291
資産合計	83,221,062	154,332,291
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	560,168	1,046,744
未払解約金	388	351,525
未払受託者報酬	2,275	4,001
未払委託者報酬	77,589	136,340
その他未払費用	186	347
流動負債合計	640,606	1,538,957
負債合計	640,606	1,538,957
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	186,722,872	348,914,958
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	104,142,416	196,121,624
(分配準備積立金)	2,534,854	2,074,482
元本等合計	82,580,456	152,793,334
純資産合計	82,580,456	152,793,334
負債純資産合計	83,221,062	154,332,291



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	3,559,895	4,579,567
有価証券売買等損益	11,497,395	2,286,815
営業収益合計	15,057,290	2,292,752
<b>営業費用</b>		
支払利息	201	342
受託者報酬	12,912	18,119
委託者報酬	440,329	617,704
その他費用	1,069	1,525
営業費用合計	454,511	637,690
営業利益又は営業損失( )	14,602,779	1,655,062
経常利益又は経常損失( )	14,602,779	1,655,062
当期純利益又は当期純損失( )	14,602,779	1,655,062
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( )	52,960	21,988
期首剰余金又は期首欠損金( )	118,227,579	104,142,416
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,477,976	2,342,542
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,477,976	2,342,542
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,551,665	91,392,460
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	3,551,665	91,392,460
分配金	3,390,967	4,606,340
期末剰余金又は期末欠損金( )	104,142,416	196,121,624

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2021年4月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	191,668,865円	186,722,872円
期中追加設定元本額	6,077,731円	166,484,039円
期中一部解約元本額	11,023,724円	4,291,953円
2. 受益権の総数	186,722,872口	348,914,958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104,142,416円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は196,121,624円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2020年10月13日 至2020年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(583,101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(2,084,049円)及び分配準備積立金(2,647,045円)より分配対象収益は5,314,195円(1万口当たり280.07円)であり、うち569,221円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年4月13日 至2021年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(567,655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(2,156,447円)及び分配準備積立金(2,510,887円)より分配対象収益は5,234,989円(1万口当たり279.89円)であり、うち561,111円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(568,943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(2,099,334円)及び分配準備積立金(2,658,984円)より分配対象収益は5,327,261円(1万口当たり279.97円)であり、うち570,821円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(533,615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(2,098,252円)及び分配準備積立金(2,613,756円)より分配対象収益は5,245,623円(1万口当たり278.29円)であり、うち565,479円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(611,666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(2,123,425円)及び分配準備積立金(2,581,750円)より分配対象収益は5,316,841円(1万口当たり280.57円)であり、うち568,487円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(543,725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(2,089,050円)及び分配準備積立金(2,561,775円)より分配対象収益は5,194,550円(1万口当たり279.88円)であり、うち556,791円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(569,825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(2,186,856円)及び分配準備積立金(2,515,809円)より分配対象収益は5,272,490円(1万口当たり280.17円)であり、うち564,547円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(534,829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(2,834,660円)及び分配準備積立金(2,508,810円)より分配対象収益は5,878,299円(1万口当たり278.62円)であり、うち632,927円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(693,919円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(5,049,465円)及び分配準備積立金(2,409,411円)より分配対象収益は8,152,795円(1万口当たり275.58円)であり、うち887,512円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(907,321円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(5,263,599円)及び分配準備積立金(2,215,316円)より分配対象収益は8,386,236円(1万口当たり275.41円)であり、うち913,499円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(552,611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(2,123,612円)及び分配準備積立金(2,542,411円)より分配対象収益は5,218,634円(1万口当たり279.48円)であり、うち560,168円(1万口当たり30円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(919,989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(6,363,000円)及び分配準備積立金(2,201,237円)より分配対象収益は9,484,226円(1万口当たり271.82円)であり、うち1,046,744円(1万口当たり30円)を分配金額としております。
--	--	---

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	2,439,493	6,737,382
親投資信託受益証券	-	-
合計	2,439,493	6,737,382

## （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）

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.4423円	0.4379円
（1万口当たり純資産額）	（4,423円）	（4,379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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - Z A Rクラス	287,249,791	147,703,842	
投資信託受益証券 合計		287,249,791	147,703,842	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	236,700	238,309	
親投資信託受益証券 合計		236,700	238,309	
合計			147,942,151	

(注) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	33,091,797	34,023,079
投資信託受益証券	914,853,075	828,883,285
親投資信託受益証券	8,088,280	8,087,477
未収入金	20,000,000	-
流動資産合計	976,033,152	870,993,841
資産合計	976,033,152	870,993,841
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	9,275,729	8,668,433
未払解約金	12,732,656	3,956,109
未払受託者報酬	26,868	23,443
未払委託者報酬	913,697	797,180
その他未払費用	2,376	2,072
流動負債合計	22,951,326	13,447,237
負債合計	22,951,326	13,447,237
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,545,954,892	1,444,738,942
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	592,873,066	587,192,338
(分配準備積立金)	52,689,509	32,863,956
元本等合計	953,081,826	857,546,604
純資産合計	953,081,826	857,546,604
負債純資産合計	976,033,152	870,993,841

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	52,785,936	43,088,264
有価証券売買等損益	74,029,216	17,970,593
営業収益合計	126,815,152	25,117,671
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,413	2,146
受託者報酬	169,426	152,909
委託者報酬	5,761,748	5,200,297
その他費用	14,987	13,522
営業費用合計	5,949,574	5,368,874
営業利益又は営業損失( )	120,865,578	19,748,797
経常利益又は経常損失( )	120,865,578	19,748,797
当期純利益又は当期純損失( )	120,865,578	19,748,797
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( )	185,514	802,117
期首剰余金又は期首欠損金( )	814,834,325	592,873,066
剰余金増加額又は欠損金減少額	167,432,250	61,212,771
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	167,432,250	61,212,771
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,939,869	22,495,330
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	5,939,869	22,495,330
分配金	60,211,186	53,587,627
期末剰余金又は期末欠損金( )	592,873,066	587,192,338



## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。  親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	1,946,229,341円	1,545,954,892円
期中追加設定元本額	14,940,827円	59,256,016円
期中一部解約元本額	415,215,276円	160,471,966円
2. 受益権の総数	1,545,954,892口	1,444,738,942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592,873,066円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は587,192,338円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	(自2020年10月13日 至2020年11月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,380,204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(157,356,249円)及び分配準備積立金(74,869,771円)より分配対象収益は241,606,224円(1万口当たり1,322.87円)であり、うち10,958,196円(1万口当たり60円)を分配金額としております。	(自2021年4月13日 至2021年5月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,847,129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(131,261,471円)及び分配準備積立金(51,596,395円)より分配対象収益は189,704,995円(1万口当たり1,250.35円)であり、うち9,103,263円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,369,966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(147,935,311円)及び分配準備積立金(68,741,455円)より分配対象収益は225,046,732円(1万口当たり1,311.69円)であり、うち10,294,166円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,716,185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(146,203,720円)及び分配準備積立金(65,910,629円)より分配対象収益は220,830,534円(1万口当たり1,303.12円)であり、うち10,167,699円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,847,698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(142,824,418円)及び分配準備積立金(62,816,112円)より分配対象収益は213,488,228円(1万口当たり1,290.57円)であり、うち9,925,251円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2021年2月13日 至2021年3月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,365,268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(138,073,445円)及び分配準備積立金(58,617,633円)より分配対象収益は204,056,346円(1万口当たり1,276.66円)であり、うち9,590,145円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,073,781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(130,447,304円)及び分配準備積立金(48,448,973円)より分配対象収益は185,970,058円(1万口当たり1,237.66円)であり、うち9,015,496円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,372,218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(130,666,344円)及び分配準備積立金(46,048,882円)より分配対象収益は183,087,444円(1万口当たり1,220.13円)であり、うち9,003,298円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,211,692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(130,459,589円)及び分配準備積立金(42,417,222円)より分配対象収益は179,088,503円(1万口当たり1,201.82円)であり、うち8,940,863円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

(自2021年8月13日 至2021年9月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,053,279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(129,305,402円)及び分配準備積立金(39,232,354円)より分配対象収益は174,591,035円(1万口当たり1,182.82円)であり、うち8,856,274円(1万口当たり60円)を分配金額としております。

	(自2021年3月13日 至2021年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,498,639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(133,624,490円)及び分配準備積立金(54,466,599円)より分配対象収益は195,589,728円(1万口当たり1,265.17円)であり、うち9,275,729円(1万口当たり60円)を分配金額としております。	(自2021年9月14日 至2021年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,940,217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(126,627,342円)及び分配準備積立金(35,592,172円)より分配対象収益は168,159,731円(1万口当たり1,163.94円)であり、うち8,668,433円(1万口当たり60円)を分配金額としております。
--	---	--

## (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	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	33,701,900	30,531,816
親投資信託受益証券	-	-
合計	33,701,900	30,531,816

## (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)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.6165円	0.5936円
(1万口当たり純資産額)	(6,165円)	(5,936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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - M XNクラス	1,352,616,327	828,883,285	
投資信託受益証券 合計		1,352,616,327	828,883,285	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	8,032,854	8,087,477	
親投資信託受益証券 合計		8,032,854	8,087,477	
合計			836,970,762	

(注) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	70,626,500	56,461,993
投資信託受益証券	1,486,441,570	1,140,403,818
親投資信託受益証券	1,097,998	1,097,889
流動資産合計	1,558,166,068	1,197,963,700
<b>資産合計</b>		
1,558,166,068		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	14,272,223	11,329,197
未払解約金	9,099,017	962,867
未払受託者報酬	44,875	31,848
未払委託者報酬	1,526,034	1,083,139
その他未払費用	3,974	2,823
流動負債合計	24,946,123	13,409,874
<b>負債合計</b>		
24,946,123		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,077,778,215	3,236,913,439
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,544,558,270	2,052,359,613
(分配準備積立金)	294,073,317	280,724,571
元本等合計	1,533,219,945	1,184,553,826
<b>純資産合計</b>		
1,533,219,945		
<b>負債純資産合計</b>		
1,558,166,068		
1,197,963,700		

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	140,897,919	134,649,821
有価証券売買等損益	44,401,324	87,037,861
営業収益合計	185,299,243	47,611,960
<b>営業費用</b>		
支払利息	6,439	3,470
受託者報酬	299,368	223,500
委託者報酬	10,179,920	7,600,522
その他費用	26,555	19,821
営業費用合計	10,512,282	7,847,313
営業利益又は営業損失( )	174,786,961	39,764,647
経常利益又は経常損失( )	174,786,961	39,764,647
当期純利益又は当期純損失( )	174,786,961	39,764,647
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( )	9,157,967	699,146
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,560,225,573	2,544,558,270
剰余金増加額又は欠損金減少額	990,196,645	548,217,288
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	990,196,645	548,217,288
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	43,092,965	20,879,282
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	43,092,965	20,879,282
分配金	97,065,371	74,204,850
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,544,558,270	2,052,359,613

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。  親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2021年4月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	5,601,869,877円	4,077,778,215円
期中追加設定元本額	68,654,471円	33,391,466円
期中一部解約元本額	1,592,746,133円	874,256,242円
2. 受益権の総数	4,077,778,215口	3,236,913,439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2,544,558,270円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,052,359,613円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	(自2020年10月13日 至2020年11月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,768,278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(1,431,712,721円)及び分配準備積立金(340,689,783円)より分配対象収益は1,795,170,782円(1万口当たり3,405.96円)であり、うち18,447,336円(1万口当たり35円)を分配金額としております。	(自2021年4月13日 至2021年5月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,885,973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(1,069,671,795円)及び分配準備積立金(282,754,072円)より分配対象収益は1,373,311,840円(1万口当たり3,497.92円)であり、うち13,741,274円(1万口当たり35円)を分配金額としております。



(自2020年11月13日 至2020年12月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,048,259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(1,377,347,772円)及び分配準備積立金

(330,288,129円)より分配対象収益は1,728,684,160円(1万口当たり3,412.51円)であり、うち17,730,033円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2020年12月15日 至2021年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,335,042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(1,261,506,061円)及び分配準備積立金

(305,070,730円)より分配対象収益は1,588,911,833円(1万口当たり3,425.65円)であり、うち16,233,972円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年1月13日 至2021年2月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(23,328,918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(1,212,229,263円)及び分配準備積立金

(298,535,233円)より分配対象収益は1,534,093,414円(1万口当たり3,443.00円)であり、うち15,594,879円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年5月13日 至2021年6月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,118,422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(1,009,221,385円)及び分配準備積立金

(273,032,283円)より分配対象収益は1,303,372,090円(1万口当たり3,519.95円)であり、うち12,959,819円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年6月15日 至2021年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,710,219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(985,128,059円)及び分配準備積立金

(273,982,954円)より分配対象収益は1,279,821,232円(1万口当たり3,542.28円)であり、うち12,645,441円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年7月13日 至2021年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,045,214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(942,005,977円)及び分配準備積立金

(268,957,022円)より分配対象収益は1,232,008,213円(1万口当たり3,568.22円)であり、うち12,084,519円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

	<p>(自2021年2月13日 至2021年3月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,202,085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(1,149,765,352円)及び分配準備積立金(290,062,527円)より分配対象収益は1,462,029,964円(1万口当たり3,460.55円)であり、うち14,786,928円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年3月13日 至2021年4月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,085,664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(1,110,606,602円)及び分配準備積立金(286,259,876円)より分配対象収益は1,418,952,142円(1万口当たり3,479.71円)であり、うち14,272,223円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2021年8月13日 至2021年9月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,292,461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(892,461,235円)及び分配準備積立金(262,860,288円)より分配対象収益は1,177,613,984円(1万口当たり3,601.39円)であり、うち11,444,600円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p> <p>(自2021年9月14日 至2021年10月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,535,613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(883,892,655円)及び分配準備積立金(270,518,155円)より分配対象収益は1,175,946,423円(1万口当たり3,632.92円)であり、うち11,329,197円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
--	---	--

## (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	前期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	当期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12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	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	112,761,197	67,315,437
親投資信託受益証券	-	-
合計	112,761,197	67,315,437

## (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 )

	前期 2021年4月12日現在	当期 2021年10月12日現在
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	0.3760円 (3,760円)	0.3660円 (3,660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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 ( 円 )	評価額 ( 円 )	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - T RYクラス	5,148,549,971	1,140,403,818	
投資信託受益証券 合計		5,148,549,971	1,140,403,818	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	1,090,474	1,097,889	
親投資信託受益証券 合計		1,090,474	1,097,889	
合計			1,141,501,707	

( 注 ) 投資信託受益証券及び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。

## 【ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第23期 2021年4月12日現在	第24期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	31,922	31,740
親投資信託受益証券	961,833	961,737
流動資産合計	993,755	993,477
資産合計	993,755	993,477
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払委託者報酬	182	183
流動負債合計	182	183
負債合計	182	183
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,427	6,706
(分配準備積立金)	17,241	17,241
元本等合計	993,573	993,294
純資産合計	993,573	993,294
負債純資産合計	993,755	993,477

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第23期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第24期 自 2021年4月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	-	96
<b>営業収益合計</b>	-	96
<b>営業費用</b>		
委託者報酬	182	183
<b>営業費用合計</b>	182	183
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	182	279
経常利益又は経常損失( )	182	279
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	182	279
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( )	-	-
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	6,245	6,427
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	-	-
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	-	-
分配金	-	-
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	6,427	6,706

## (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24期	
	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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23期	第24期
	2021年4月12日現在	
1. 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	1,000,000口	1,000,000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6,427円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,706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23期	第24期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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(3,682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(4,054円)及び分配準備積立金(13,559円)より分配対象収益は21,295円(1万口当たり212.95円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,054円)及び分配準備積立金(17,241円)より分配対象収益は21,295円(1万口当たり212.95円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第23期	第24期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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23期 2021年4月12日現在	第24期 2021年10月12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23期 2021年4月12日現在	第24期 2021年10月12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	-	96
合計	-	96

（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23期 2021年4月12日現在	第24期 2021年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9936円 (9,936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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	955,242	961,737	
親投資信託受益証券	合計	955,242	961,737	
合計			961,737	

（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）

「ハイブリッド証券ファンド米ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース」、「ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース」、「ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース」、「ハイブリッド証券ファンド中国元コース」、「ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース」、「ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース」、「ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース」は、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - USDクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - AUDクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - BRLクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - RUBクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - INRクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - CNYクラス」投資信託証券、「グ

グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - ZARクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - MXNクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - TRYクラス」投資信託証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべてこれらの証券であります。

「ハイブリッド証券ファンド米ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース」、「ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース」、「ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース」、「ハイブリッド証券ファンド中国元コース」、「ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース」、「ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース」、「ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース」、「ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド」は、「国内短期公社債マザーファンド」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。

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内短期公社債マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2021年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	77,883,340
流動資産合計	77,883,340
資産合計	77,883,340
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	77,357,362
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	525,978
元本等合計	77,883,340
純資産合計	77,883,340
負債純資産合計	77,883,340

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年10月12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	77,357,362円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	- 円
元本の内訳	
ファンド名	
ハイブリッド証券ファンド円コース	27,208,015円
ハイブリッド証券ファンド米ドルコース	3,391,713円
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース	4,489,701円
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース	16,175,679円
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース	2,324,574円
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース	2,228,133円
ハイブリッド証券ファンド中国元コース	1,130,574円
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース	236,700円
ハイブリッド証券ファンドマネーボールファンド	955,242円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド円コース	1,392,481円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース	99,759円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース	1,193,555円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース	6,365,626円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネーボールファンド	943,105円
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース	8,032,854円
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース	1,090,474円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド（年1回決算型）	99,177円
計	77,357,362円
2. 受益権の総数	77,357,362口

（金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月13日 至 2021年10月12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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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10月12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 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(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)

	2021年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.0068円
(1万口当たり純資産額)	(10,068円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト

「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - USDクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - AUDクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - BRLクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - RUBクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - INRクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - CNYクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - ZARクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - MXNクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - TRYクラス」は、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト」を構成する個別クラスとなっております。

「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

## 財政状態計算書

2020年3月31日現在

グローバル・サブオーディネイティド・  
デット・セキュリティーズ・  
サブ・トラスト  
(米ドル)

資産	
流動資産	
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	489,842,631
債権：	
配当	21,526
利息	6,854,578
ブローカーに対する債権：	
担保	15,260,000
受益証券発行	1,023,515
現金および現金同等物	6,571,698
資産合計	519,573,948
負債	
流動負債	
純損益を通じて公正価値で測定する金融負債	19,612,916
債務：	
ブローカーに対する債務：	
担保	360,000
投資有価証券購入	29,321
受益証券償還	354,890
運用報酬	441,881
管理事務代行会社報酬	49,871
監査報酬	85,969
受託会社報酬	9,209
保管受託銀行サービス報酬	36,780
名義書換事務代行会社報酬	12,224
株主サービス代行会社報酬	3,278
弁護士報酬	10,254
諸報酬	2,812
負債合計(償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産を除きます。)	21,009,405

償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産

498,564,543

## 要約投資明細書

2020年3月31日現在

保有高	種類	公正価値 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	債券		
	社債		
	英債券		
29,620,000	金融	38,046,141	7.63
	ユーロ		
103,150,000	金融	112,050,717	22.47
	米ドル		
312,044,000	金融	317,609,059	63.71
1,700,000	政府	1,608,233	0.32
	社債合計	469,314,150	94.13
	債券合計	469,314,150	94.13

保有高 / 口数	種類	公正価値 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	投資ファンド*		
	米ドル		
15,362,512	投資ファンド	15,362,512	3.08
	投資ファンド合計	15,362,512	3.08

想定元本	為替予約契約	未実現利益 (米ドル)	純資産 比率 (%)
65,183,727	売買目的為替予約契約	2,654,616	0.53
191,450,190	ヘッジ目的為替予約契約	2,511,353	0.50
	為替予約契約に係る未実現利益合計	5,165,969	1.03

想定元本	為替予約契約	未実現損失 (米ドル)	純資産 比率 (%)
145,391,708	売買目的為替予約契約	(1,755,571)	(0.35)
198,477,494	ヘッジ目的為替予約契約	(17,857,345)	(3.58)
	為替予約契約に係る未実現損失合計	(19,612,916)	(3.93)



投資合計	保有高	公正価値 (米ドル)	純資産 比率 (%)
社債	446,514,000	469,314,150	94.13
投資ファンド	15,362,512	15,362,512	3.08
為替予約契約に係る未実現利益	256,633,917	5,165,969	1.03
為替予約契約に係る未実現損失	343,869,202	(19,612,916)	(3.93)
その他の資産および負債		28,334,828	5.69
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産		498,564,543	100.00

\* 当該投資ファンドは、関連ファンドであるGoldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund, Class I (Dist.)です。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

2021年10月29日現在

資産総額	1,626,505,756円
負債総額	14,565,134円
純資産総額( - )	1,611,940,622円
発行済数量	1,737,799,360口
1口当たり純資産額( / )	0.9276円

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

2021年10月29日現在

資産総額	1,317,454,420円
負債総額	1,376,479円
純資産総額( - )	1,316,077,941円
発行済数量	1,920,941,107口
1口当たり純資産額( / )	0.6851円

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

2021年10月29日現在

資産総額	3,468,702,257円
負債総額	5,001,106円
純資産総額( - )	3,463,701,151円
発行済数量	16,172,090,202口
1口当たり純資産額( / )	0.2142円

## ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース

2021年10月29日現在

資産総額	426,729,056円
負債総額	492,301円
純資産総額( - )	426,236,755円
発行済数量	834,813,292口
1口当たり純資産額( / )	0.5106円

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

2021年10月29日現在

資産総額	440,500,204円
負債総額	259,101円
純資産総額( - )	440,241,103円
発行済数量	569,824,752口
1口当たり純資産額( / )	0.7726円

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

2021年10月29日現在

資産総額	518,337,813円
負債総額	279,320円
純資産総額( - )	518,058,493円
発行済数量	545,013,547口
1口当たり純資産額( / )	0.9505円

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

2021年10月29日現在

資産総額	174,112,468円
負債総額	105,451円
純資産総額( - )	174,007,017円
発行済数量	397,802,310口
1口当たり純資産額( / )	0.4374円

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

2021年10月29日現在

資産総額	879,280,053円
負債総額	20,112,837円
純資産総額( - )	859,167,216円
発行済数量	1,401,408,196口
1口当たり純資産額( / )	0.6131円

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

2021年10月29日現在

資産総額	1,111,502,968円
負債総額	708,235円
純資産総額( - )	1,110,794,733円
発行済数量	3,156,439,217口
1口当たり純資産額( / )	0.3519円

## ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

2021年10月29日現在

資産総額	993,294円
負債総額	17円
純資産総額( - )	993,277円
発行済数量	1,000,000口
1口当たり純資産額( / )	0.9933円

(参考)

## 国内短期公社債マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	77,882,770円
負債総額	0円
純資産総額( - )	77,882,770円
発行済数量	77,357,362口
1口当たり純資産額( / )	1.0068円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6)受益権の再分割

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

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【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10月29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10月29日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書

を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年10月29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	1,389,726,868,805
追加型株式投資信託	831	15,977,901,845,268
単位型公社債投資信託	28	60,426,385,134
単位型株式投資信託	220	1,327,861,039,257
合計	1,105	18,755,916,138,464

### 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。  
また、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）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、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、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。



## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

(未適用の会計基準等)

## 1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

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

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

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

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。



**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第35期(2020年3月31日現在)

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

## 第36期(2021年3月31日現在)

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

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

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

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

## 第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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



## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

## (1株当たり情報)

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

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007



(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 会計上の見積りの変更

## 第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

## (会計方針の変更)

## 1. 収益認識に関する会計基準等の適用

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

## 2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

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

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

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

## (中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30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)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。



（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、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。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

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

### 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「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。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

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

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

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

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## （収益認識関係）

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間  
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬（注）	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬に含めて表示しております。

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

## （セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 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

## （1）サービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

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

1株当たり中間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37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,741百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。 )または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 )と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

名称	三井住友信託銀行株式会社
資本金の額	342,037百万円(2021年3月末日現在)
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
エース証券株式会社(1)	8,831	「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。
株式会社SBI証券(2)	48,323	「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。
みずほ証券株式会社	125,167	「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。
大山日ノ丸証券株式会社	215	「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。
楽天証券株式会社(2)	(3)7,495	「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。
東海東京証券株式会社(4)	6,000	「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。
内藤証券株式会社(5)	3,002	「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。
UBS SUMI TRUST ウェルス・マネジメント株式会社 (2)	(6)50	「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

- (1) 「豪ドルコース」、「マネープールファンド」、「メキシコペソコース」の取扱いはありません。
- (2) 「マネープールファンド」の取扱いはありません。
- (3) 2020年12月31日現在
- (4) 「ブラジルリアルコース」、「南アフリカランドコース」、「マネープールファンド」、「メキシコペソコース」、「トルコリラコース」の取扱いはありません。
- (5) 「マネープールファンド」、「メキシコペソコース」、「トルコリラコース」の取扱いはありません。
- (6) 2021年8月7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) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理
- (2) 投資信託財産の計算
- (3) その他上記業務に付随する一切の業務

「販売会社」は以下の業務を行います。

- (1) 募集・販売の取り扱い
- (2) 受益者に対する一部解約事務
- (3) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (4) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (5) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付
- (6) 受益者に対する運用報告書の交付
- (7) 所得税および地方税の源泉徴収
- (8) その他上記業務に付随する一切の業務

## 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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2021年5月26日	臨時報告書
2021年7月12日	有価証券報告書
2021年7月12日	有価証券届出書
2021年8月26日	臨時報告書

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド米ドルコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド米ドルコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記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11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド豪ドルコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド豪ドルコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記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11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記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11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドインドルピーコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドインドルピーコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド中国元コースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド中国元コースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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



## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記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11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドメキシコペソコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記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11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドトルコリラコースの2021年4月13日から2021年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドトルコリラコースの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記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11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドマネープールファンドの2021年4月13日から2021年10月12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、ハイブリッド証券ファンドマネープールファンドの2021年10月12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25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

#### 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、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、アセットマネジメントOne株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績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、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、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。

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。

#### 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、企業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、監査等委員会に対して、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。

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。