

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年1月21日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>

（以下「ファンド」または「当ファンド」という場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

<基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2022年1月22日から2022年7月21日まで

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

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社を買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、ラップ口座にかかる契約¹に基づいて、ラップ口座の資金を運用するためのファンドです。

当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設した者等に限るものとします。

1 当該契約については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約を使用することがあります。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入(積立)をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

受益権の取得申込者は委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

<ファンドの特色>

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

- 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資を通じて、主として海外の金融商品取引所に上場している株式に実質的に投資します。
 - 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
- ※MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)への連動性を高めるため、有価証券先物取引等を活用する場合があります。
- ※マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

2 ご購入時およびご換金時に手数料がかからないファンドです。

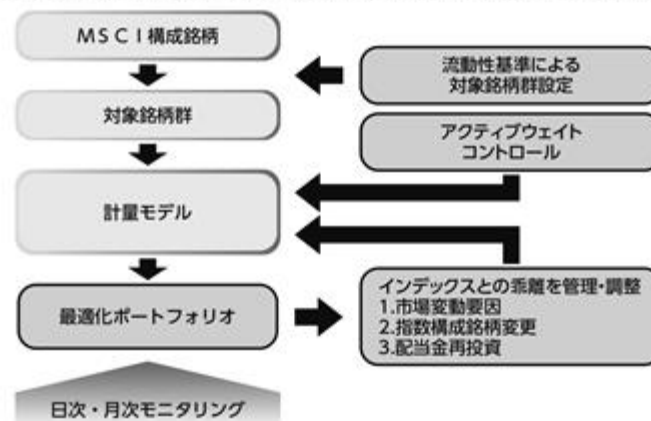
- ご購入時に購入時手数料がかからないノーロードタイプです。
- ご換金時に換金手数料がかからず、信託財産留保額もありません。

3 年1回決算を行います。

- 毎年4月21日(休業日の場合は翌営業日。)に決算を行い、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。
- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

運用プロセス

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



※上記はマザーファンドの運用プロセスです。

指数の著作権等

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

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

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

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信	特殊型
	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信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
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います。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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

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

(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。

属性区分定義

その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注) 商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル (日本を除く)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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います。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

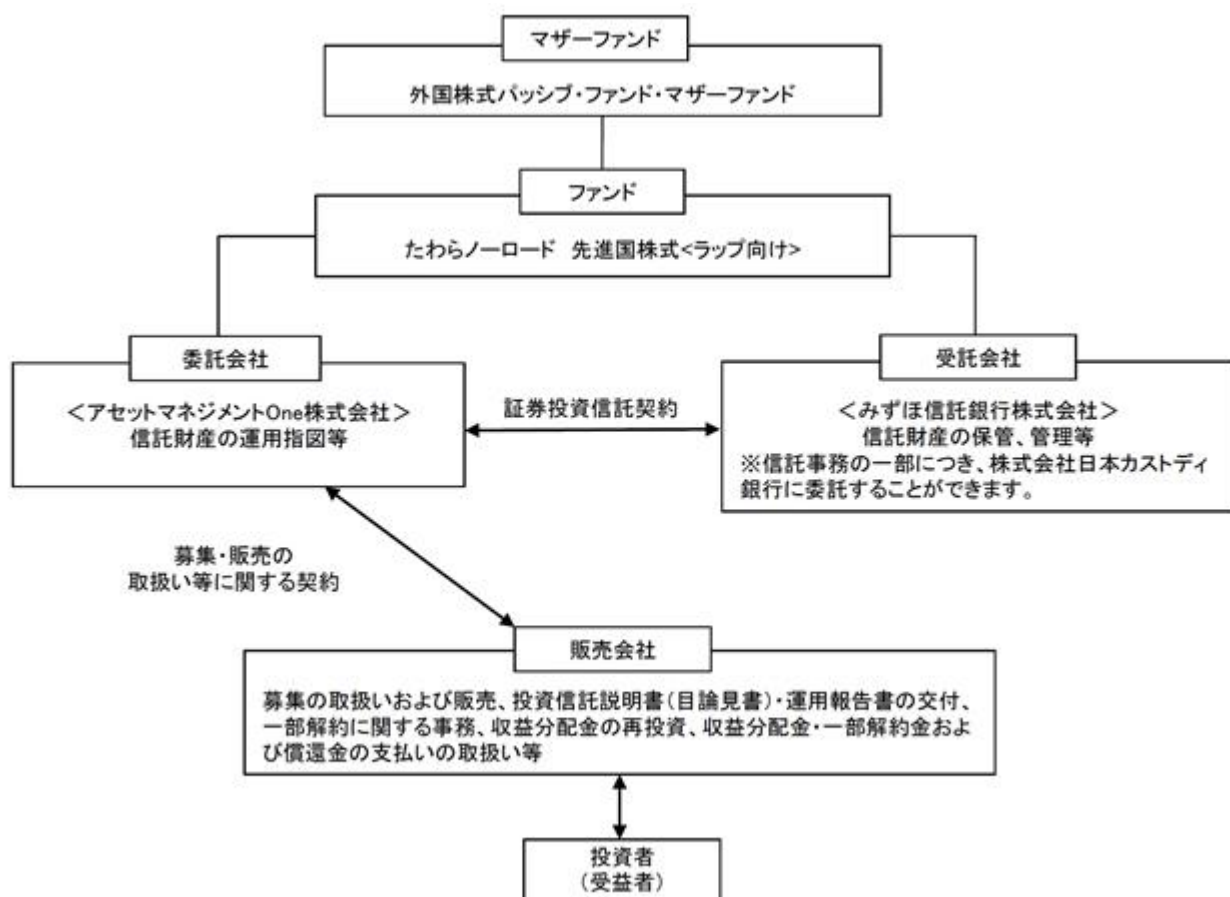
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

2016年6月24日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2019年4月16日 信託報酬率(税抜)を「年率0.205%」から「年率0.20%」に引き下げ

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2021年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「D I A M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	D I A M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 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として海外の株式に実質的に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざします。

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

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

ハ．金銭債権

二．約束手形

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。）
8. 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。）
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 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、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるもの
いい、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発
行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受
益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託
の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を
有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書
のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の
証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

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。

定期的に関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。

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】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年4月21日(休業日の場合は翌営業日))に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

(3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、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額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、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、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2)上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込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。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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。

(5)【投資制限】

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

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

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

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

スワップ取引、金利先渡し取引、為替先渡し取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。))を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。))とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。))の合計額の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2)委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を加えた額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 6) 上記5)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 8) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1) 1.~2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第28条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ(約款第34条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式の議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含

む。)の総数が、当該株式の議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合において、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

信用リスク

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

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

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

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

当ファンドは、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生じた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。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じてMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

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

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

・注意事項

イ．当ファンドは、実質的に株式などの値動きのある有価証券（外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

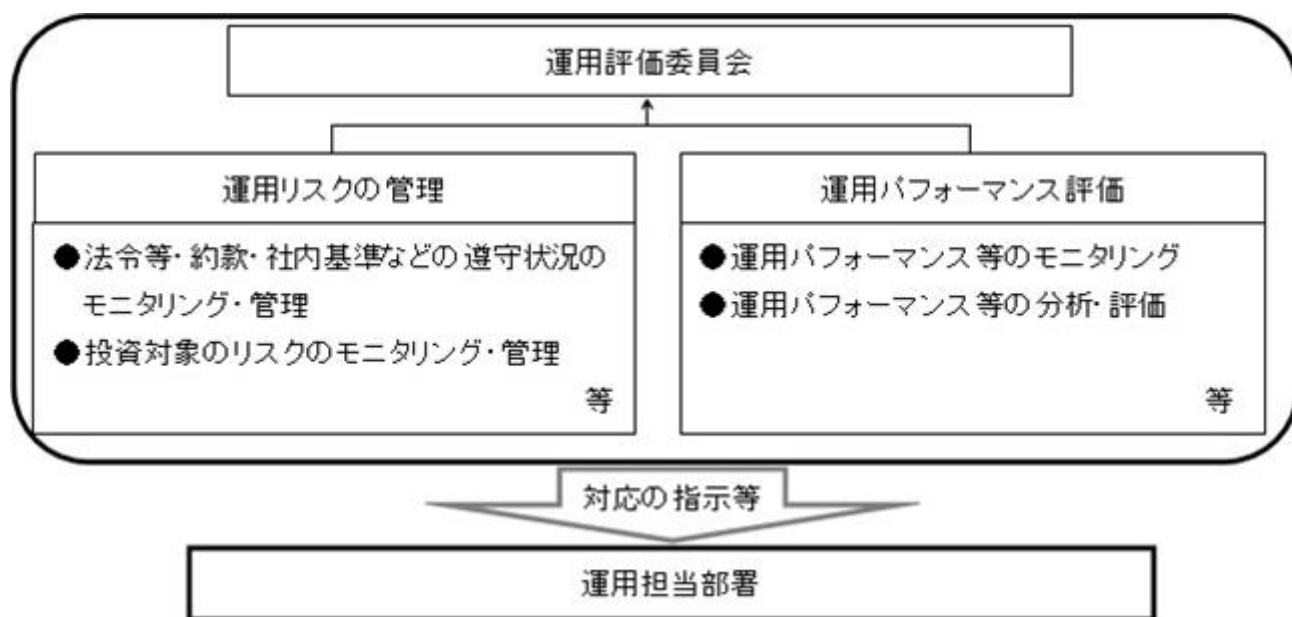
ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・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。

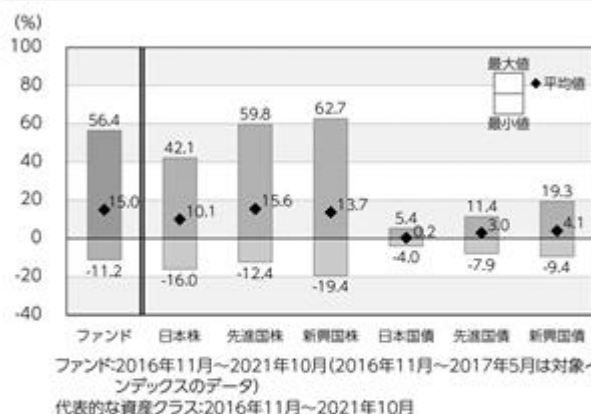
流動性リスク管理体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜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



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.22%（税抜0.20%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.165%	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0.010%	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0.025%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産留保額

ありません。

その他の費用

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

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

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

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。

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

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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「分配金自動けいぞく投資コース」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】

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	2,083,196,170	99.98
内 日本	2,083,196,170	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	334,263	0.02
純資産総額	2,083,530,433	100.00

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

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

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	650,121,126,088	95.67
内 アメリカ	455,346,008,732	67.01
内 イギリス	27,466,953,318	4.04
内 カナダ	24,049,127,086	3.54
内 スイス	21,868,891,719	3.22
内 フランス	21,122,010,222	3.11
内 ドイツ	17,939,352,410	2.64
内 オランダ	13,743,547,272	2.02
内 オーストラリア	13,053,453,495	1.92
内 アイルランド	12,308,372,088	1.81
内 スウェーデン	7,214,355,152	1.06
内 デンマーク	5,537,175,974	0.81
内 スペイン	4,950,006,712	0.73
内 香港	4,486,017,012	0.66
内 イタリア	3,781,664,990	0.56
内 ジャージー	2,634,227,400	0.39
内 フィンランド	2,546,896,688	0.37
内 シンガポール	1,794,565,434	0.26
内 ベルギー	1,671,885,310	0.25
内 バミューダ	1,583,540,969	0.23
内 ノルウェー	1,315,094,171	0.19
内 イスラエル	1,210,566,418	0.18
内 ケイマン諸島	1,208,692,659	0.18
内 ルクセンブルグ	663,445,018	0.10
内 ニュージーランド	610,512,468	0.09
内 オランダ領キュラソー	558,882,618	0.08
内 オーストリア	434,989,898	0.06
内 ポルトガル	313,950,552	0.05
内 パナマ	220,516,727	0.03
内 リベリア	219,133,992	0.03
内 マン島	187,660,488	0.03
内 パプアニューギニア	79,629,096	0.01
投資信託受益証券	1,218,538,794	0.18
内 オーストラリア	927,418,910	0.14
内 シンガポール	291,119,884	0.04

投資証券		14,092,048,664	2.07
	内 アメリカ	13,102,487,975	1.93
	内 イギリス	406,195,817	0.06
	内 フランス	278,726,675	0.04
	内 香港	231,262,084	0.03
	内 カナダ	73,376,113	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		14,119,371,682	2.08
純資産総額		679,551,085,228	100.00

その他資産の投資状況

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	15,129,890,207	2.23
	内 アメリカ	11,289,633,356
	内 ドイツ	2,324,099,019
	内 イギリス	679,116,480
	内 カナダ	536,029,881
	内 オーストラリア	301,011,471

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

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	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	354,020,150	5.1730 1,831,355,186	5.8844 2,083,196,170	- -	99.98

(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	99.98
合計	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

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

1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,705,503	15,585.14 26,580,504,069	17,342.63 29,577,910,733	- -	4.35
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	731,048	29,268.10 21,396,386,650	36,868.86 26,952,909,654	- -	3.97
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	46,395	375,127.97 17,404,062,227	391,771.61 18,176,243,934	- -	2.67
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	83,707	88,359.91 7,396,343,510	122,427.13 10,248,008,340	- -	1.51
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	30,705	259,113.84 7,956,090,640	331,573.11 10,180,952,545	- -	1.50
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	29,781	260,346.31 7,753,373,510	332,209.66 9,893,536,140	- -	1.46
7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	244,886	33,422.67 8,184,746,158	36,024.29 8,821,845,848	- -	1.30
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	254,793	18,819.77 4,795,146,943	28,350.43 7,223,492,308	- -	1.06
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	308,951	16,807.74 5,192,768,891	19,364.82 5,982,780,874	- -	0.88
10	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイ ダー/ヘル スケ ア・サー ビス	96,311	40,513.95 3,901,939,934	51,769.86 4,986,007,448	- -	0.73
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	269,091	18,977.33 5,106,630,750	18,511.15 4,981,186,421	- -	0.73

12	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	108,641	33,447.17 3,633,734,013	42,236.36 4,588,600,593	- -	0.68
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	134,892	29,039.42 3,917,185,903	32,932.47 4,442,327,066	- -	0.65
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	293,570	13,044.84 3,829,574,116	14,957.62 4,391,108,973	- -	0.65
15	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	787,107	4,123.55 3,245,678,676	5,431.15 4,274,898,229	- -	0.63
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	172,598	24,692.85 4,261,937,132	23,852.51 4,116,896,004	- -	0.61
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	249,556	14,982.29 3,738,922,287	16,218.43 4,047,407,914	- -	0.60
18	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	42,901	71,579.47 3,070,831,134	92,726.56 3,978,062,493	- -	0.59
19	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	185,703	20,943.73 3,889,313,664	19,287.52 3,581,751,366	- -	0.53
20	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	48,790	59,968.78 2,925,876,955	72,666.95 3,545,420,861	- -	0.52
21	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	45,351	62,920.76 2,853,519,803	76,619.26 3,474,760,218	- -	0.51
22	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	90,347	39,666.30 3,583,731,233	37,855.52 3,420,132,674	- -	0.50
23	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	99,310	27,715.22 2,752,399,012	33,916.85 3,368,282,830	- -	0.50
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	71,500	40,334.65 2,883,927,626	44,503.66 3,182,011,976	- -	0.47
25	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	432,803	6,101.98 2,640,955,893	7,310.11 3,163,840,870	- -	0.47
26	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	113,989	32,703.61 3,727,852,670	26,920.46 3,068,637,010	- -	0.45
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサ イエ ス・ツ ール/ サー ビス	40,184	58,587.48 2,354,279,512	70,483.35 2,832,303,213	- -	0.42

28	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	572,642	4,261.14 2,440,108,589	4,908.27 2,810,681,892	- -	0.41
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	468,764	6,197.66 2,905,244,293	5,899.47 2,765,460,561	- -	0.41
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	430,080	5,682.84 2,444,078,810	6,392.80 2,749,415,768	- -	0.40

(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(%)
株式	95.67
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.07
合計	97.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年10月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	8.11
銀行		6.15
半導体・半導体製造装置		4.70
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.64
コンピュータ・周辺機器		4.62
医薬品		4.47
情報技術サービス		4.27
資本市場		3.37
インターネット販売・通信販売		3.26
石油・ガス・消耗燃料		3.25
保険		2.98
ヘルスケア機器・用品		2.94
自動車		2.20
化学		2.05
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.93
ホテル・レストラン・レジャー		1.79
専門小売り		1.71
電力		1.66
バイオテクノロジー		1.63
機械		1.62
飲料		1.53
繊維・アパレル・贅沢品		1.50
娯楽		1.49
食品		1.49
食品・生活必需品小売り		1.37
金属・鉱業		1.33
航空宇宙・防衛		1.32
各種電気通信サービス		1.21
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.16
陸運・鉄道		1.08

コングロマリット	1.04
家庭用品	1.02
メディア	0.99
電気設備	0.89
各種金融サービス	0.88
専門サービス	0.80
総合公益事業	0.77
通信機器	0.66
航空貨物・物流サービス	0.62
建設関連製品	0.61
パーソナル用品	0.59
タバコ	0.59
電子装置・機器・部品	0.58
複合小売り	0.50
消費者金融	0.46
商業サービス・用品	0.45
不動産管理・開発	0.36
家庭用耐久財	0.33
商社・流通業	0.33
自動車部品	0.26
容器・包装	0.26
建設資材	0.24
無線通信サービス	0.24
建設・土木	0.21
エネルギー設備・サービス	0.16
ヘルスケア・テクノロジー	0.15
ガス	0.13
運送インフラ	0.13
水道	0.11
紙製品・林産品	0.10
販売	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
海運業	0.08
レジャー用品	0.06
旅客航空輸送業	0.05
合計	95.67

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Dec21	買建	433	10,979,757,569	11,289,633,356	1.66
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec21	買建	415	2,288,290,618	2,324,099,019	0.34
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec21	買建	60	669,188,688	679,116,480	0.10
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec21	買建	23	521,829,123	536,029,881	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Dec21	買建	19	299,237,618	301,011,471	0.04

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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計算期間末 (2017年4月21日)	1	1	1.2515	1.2515
第2計算期間末 (2018年4月23日)	1	1	1.4257	1.4257
第3計算期間末 (2019年4月22日)	1	1	1.5739	1.5739
第4計算期間末 (2020年4月21日)	583	583	1.4231	1.4231
第5計算期間末 (2021年4月21日)	1,146	1,146	2.1328	2.1328
2020年10月末日	741	-	1.6218	-
11月末日	815	-	1.8085	-
12月末日	837	-	1.8604	-
2021年1月末日	874	-	1.8985	-
2月末日	1,036	-	1.9630	-
3月末日	1,111	-	2.0942	-
4月末日	1,289	-	2.1920	-
5月末日	1,352	-	2.2237	-
6月末日	1,427	-	2.2787	-
7月末日	1,509	-	2.3105	-
8月末日	1,919	-	2.3670	-
9月末日	1,921	-	2.3114	-
10月末日	2,083	-	2.4802	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2021年4月22日～2021年10月21日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	25.2
第2計算期間	13.9
第3計算期間	10.4
第4計算期間	9.6
第5計算期間	49.9
2021年4月22日～2021年10月21日	15.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	1,000,000	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	0	0
第4計算期間	566,184,245	157,184,942
第5計算期間	509,401,934	381,893,057
2021年4月22日～ 2021年10月21日	395,673,259	92,701,996

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2021年10月29日

基準価額・純資産の推移 (2016年6月24日～2021年10月29日)



※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、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:2016年6月24日)

分配の推移(税引前)

2017年 4月	0円
2018年 4月	0円
2019年 4月	0円
2020年 4月	0円
2021年 4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	99.98

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	95.67
内 アメリカ	67.01
内 イギリス	4.04
内 カナダ	3.54
内 スイス	3.22
内 フランス	3.11
内 その他	14.75
投資信託受益証券	0.18
内 オーストラリア	0.14
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.07
内 アメリカ	1.93
内 イギリス	0.06
内 フランス	0.04
内 香港	0.03
内 カナダ	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.08
合計(純資産総額)	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.35
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.97
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.67
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.51
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.50
6	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.46
7	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.30
8	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.06
9	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.88
10	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	アメリカ	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケアサービス	0.73

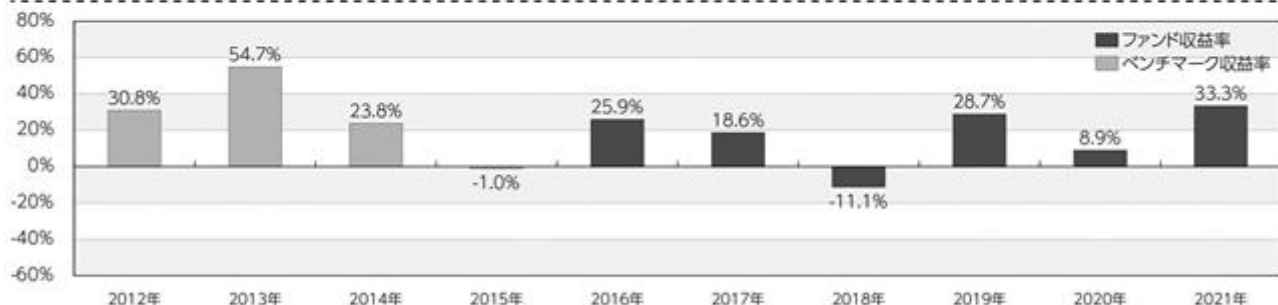
その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.23

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	ソフトウェア	8.11
2	銀行	6.15
3	半導体・半導体製造装置	4.70
4	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.64
5	コンピュータ・周辺機器	4.62

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。

※2016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。

※2015年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」です。

○掲載データ等は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。

○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、ラップ口座にかかる契約¹に基づいて、ラップ口座の資金を運用するためのファンドです。

当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設した者等に限るものとします。

1 当該契約については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約を使用することがあります。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入(積立)をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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

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

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

受益権の取得申込者は委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金(解約)手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

- ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

- ・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

- ・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2016年6月24日から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年4月22日から翌年4月21日までとします。

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

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがい約款を変更します。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八．関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年4月21日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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、委託会社が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します。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」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。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が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します。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2020年4月22日から2021年4月21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】

【たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年4月21日現在	第5期 2021年4月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,323,408	2,129,936
親投資信託受益証券	583,369,694	1,146,191,394
流動資産合計	584,693,102	1,148,321,330
資産合計	584,693,102	1,148,321,330
負債の部		
流動負債		
未払解約金	536,302	870,856
未払受託者報酬	82,096	126,431
未払委託者報酬	574,947	885,290
その他未払費用	10,801	16,105
流動負債合計	1,204,146	1,898,682
負債合計	1,204,146	1,898,682
純資産の部		
元本等		
元本	409,999,303	537,508,180
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	173,489,653	608,914,468
(分配準備積立金)	8,410,691	216,320,926
元本等合計	583,488,956	1,146,422,648
純資産合計	583,488,956	1,146,422,648
負債純資産合計	584,693,102	1,148,321,330

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期 自 2019年4月23日 至 2020年4月21日	第5期 自 2020年4月22日 至 2021年4月21日
営業収益		
受取利息	-	3
有価証券売買等損益	65,528,172	287,025,700
営業収益合計	65,528,172	287,025,703
営業費用		
支払利息	849	954
受託者報酬	122,817	185,541
委託者報酬	860,276	1,299,410
その他費用	16,300	23,693
営業費用合計	1,000,242	1,509,598
営業利益又は営業損失()	66,528,414	285,516,105
経常利益又は経常損失()	66,528,414	285,516,105
当期純利益又は当期純損失()	66,528,414	285,516,105
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()	12,774,759	53,355,874
期首剰余金又は期首欠損金()	573,857	173,489,653
剰余金増加額又は欠損金減少額	315,963,215	389,512,276
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	315,963,215	389,512,276
剰余金減少額又は欠損金増加額	89,293,764	186,247,692
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	89,293,764	186,247,692
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	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	173,489,653	608,914,468

(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5期	
	自 2020年4月22日	至 2021年4月21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4期	第5期
	2020年4月21日現在	2021年4月21日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	409,999,303円
期中追加設定元本額	566,184,245円	509,401,934円
期中一部解約元本額	157,184,942円	381,893,057円
2. 受益権の総数	409,999,303口	537,508,180口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2019年4月23日 至 2020年4月21日	自 2020年4月22日 至 2021年4月21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(8,045,636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(235,672,989円)及び分配準備積立金(365,055円)より分配対象収益は244,083,680円(1万口当たり5,953.27円)であります。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(11,454,291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(202,371,352円)、信託約款に規定される収益調整金(392,593,542円)及び分配準備積立金(2,495,283円)より分配対象収益は608,914,468円(1万口当たり11,328.46円)であります。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4期	第5期
	自 2019年4月23日 至 2020年4月21日	自 2020年4月22日 至 2021年4月21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4期 2020年4月21日現在	第5期 2021年4月21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	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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4期 2020年4月21日現在	第5期 2021年4月21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	54,713,639	257,043,323
合計	54,713,639	257,043,323

（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4期 2020年4月21日現在	第5期 2021年4月21日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4231円 (14,231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4月21日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	226,775,497	1,146,191,394	
親投資信託受益証券	合計	226,775,497	1,146,191,394	
合計			1,146,191,394	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年4月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,221,544,248
コール・ローン	1,241,958,821
株式	476,209,775,082
投資信託受益証券	911,379,680
投資証券	10,062,307,679
派生商品評価勘定	97,775,921
未収入金	60,989,544
未収配当金	544,281,885
差入委託証拠金	5,962,546,469
流動資産合計	500,312,559,329
資産合計	
500,312,559,329	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,162,950
未払解約金	264,189,000
流動負債合計	300,351,950
負債合計	
300,351,950	
純資産の部	
元本等	
元本	98,928,018,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	401,084,189,116
元本等合計	500,012,207,379
純資産合計	500,012,207,379
負債純資産合計	500,312,559,329

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年4月22日 至 2021年4月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 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>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年4月21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	96,307,194,542円
同期中追加設定元本額	45,823,429,751円
同期中一部解約元本額	43,202,606,030円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,589,046,965円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,664,453円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,094,397円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,332,488円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,505,175円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,046,918円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,339,064円
たわらノーロード 先進国株式	21,117,655,285円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	226,775,497円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,352,162,253円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	425,111,573円
たわらノーロード バランス(堅実型)	47,197,346円
たわらノーロード バランス(標準型)	381,829,757円
たわらノーロード バランス(積極型)	449,547,277円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	1,107,077円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	130,404,574円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	350,816,111円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	236,499,203円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	364,929,352円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	611,921円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,295,793円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,951,336円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,860,250円
たわらノーロード 全世界株式	98,264,259円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	47,560,148,095円
One DC 先進国株式インデックスファンド	807,224,837円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	166,217,134円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	910,089,804円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,082,572,948円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	108,524,875円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	329,543,961円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	283,469,531円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	21,408,640円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	668,457,892円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	160,050,732円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	190,503,406円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	172,195,008円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	287,624,223円
投資のソムリエ	4,048,297,699円
クルーズコントロール	167,922,014円
投資のソムリエ<DC年金>	224,539,288円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	188,897,847円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	113,492,231円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,184,519円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,938,714円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	82,609,825円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	907,717,249円
ワールドアセットバランス(基本コース)	283,293,240円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	929,334,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	17,735,882円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,379,297円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	809,655円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	25,172,241円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	34,280,545円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	545,912,824円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	161,287,908円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,583,609円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,103,435円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,158,668円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,988,713円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	527,338円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	557,257円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	8,768,590円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	245,460円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	438,020,156円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	62,946,480円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,345,873,641円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,220,287,636円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	901,153,571円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	94,198,774円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	10,741,307円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	819,550円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	40,785,956円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	68,085,411円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,818,194円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	31,831,537円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,409,559円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	840,877円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,821,403円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	36,301,985円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	266,978,819円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	379,999,884円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,237,137,381円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	334,529,205円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	64,530,989円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	434,056,166円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	19,279,892円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,396,697円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	182,885,535円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,696,125円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	59,360,789円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	94,120,695円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	186,290,852円
計	98,928,018,263円
2. 受益権の総数	98,928,018,263口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年4月22日 至 2021年4月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年4月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年4月21日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）

株式	17,958,352,898
投資信託受益証券	41,780,487
投資証券	837,679,538
合計	18,837,812,923

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年2月16日から2021年4月21日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年4月21日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建					
アメリカ・ドル	70,598,826	-	70,600,890	2,064	
イギリス・ポンド	31,772,580	-	31,774,932	2,352	
カナダ・ドル	2,711,502	-	2,711,496	6	
ユーロ	1,114,347	-	1,114,334	13	
買建					
アメリカ・ドル	35,000,397	-	35,000,128	269	
イギリス・ポンド	865,505,186	-	864,073,780	1,431,406	
オーストラリア・ドル	620,036,890	-	619,400,749	636,141	
カナダ・ドル	44,950,059	-	44,739,872	210,187	
ユーロ	23,951,970	-	23,803,114	148,856	
合計	143,820,288	-	143,642,544	177,744	
合計	936,104,012	-	934,674,670	1,433,470	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2021年4月21日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引					
先物取引					
買建					
先物取引	12,624,552,297	-	12,687,598,738	63,046,441	
合計	12,624,552,297	-	12,687,598,738	63,046,441	

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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4月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.0543円 (50,543円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年4月21日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	37,204	3,334.690	124,063,806.760	
	ABBOTT LABORATORIES	154,600	120.000	18,552,000.000	
	AES CORP	58,916	28.250	1,664,377.000	
	ABIOMED INC	3,987	330.100	1,316,108.700	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,780	138.160	10,746,084.800	
	ADVANCED MICRO DEVICES	105,090	79.270	8,330,484.300	
	ADOBE INC	41,923	514.210	21,557,225.830	
	CHUBB LTD	39,379	161.710	6,367,978.090	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,256	284.540	5,479,102.240	
	ALLEGHANY CORP	1,278	680.660	869,883.480	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	71.300	431,507.600	
	ALLSTATE CORP	26,594	122.870	3,267,604.780	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	61,069	227.330	13,882,815.770	
	AMGEN INC	50,861	259.140	13,180,119.540	
	HESS CORP	24,776	67.730	1,678,078.480	
	AMERICAN EXPRESS CO	59,733	145.100	8,667,258.300	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	43,862	90.140	3,953,720.680	
	AFLAC INC	57,954	52.590	3,047,800.860	
	AMERICAN INTL GROUP	75,656	45.530	3,444,617.680	
	AMERCO	929	598.080	555,616.320	
ANALOG DEVICES	32,544	154.470	5,027,071.680		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,326	166.540	3,218,552.040		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	63,332	61.200	3,875,918.400		

VALERO ENERGY CORP	37,400	68.680	2,568,632.000	
ANSYS INC	7,643	364.940	2,789,236.420	
APPLE INC	1,482,992	133.110	197,401,065.120	
APPLIED MATERIALS INC	79,849	128.590	10,267,782.910	
ALBEMARLE CORP	9,546	148.520	1,417,771.920	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,789	58.710	2,864,402.190	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	85.970	797,629.660	
AMEREN CORP	22,273	85.890	1,913,027.970	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	115.960	771,249.960	
AUTOLIV INC	7,570	94.640	716,424.800	
AUTODESK INC	19,237	286.360	5,508,707.320	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,447	192.810	7,220,156.070	
AUTOZONE INC	2,054	1,514.110	3,109,981.940	
AVERY DENNISON CORP	7,627	198.040	1,510,451.080	
BALL CORP	28,607	92.290	2,640,140.030	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	119,534	267.890	32,021,963.260	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	70,629	46.580	3,289,898.820	
BAXTER INTERNATIONAL INC	44,605	87.070	3,883,757.350	
BECTON DICKINSON & CO	25,351	256.440	6,501,010.440	
AMETEK INC	19,940	130.890	2,609,946.600	
VERIZON COMM INC	360,099	58.390	21,026,180.610	
WR BERKLEY CORP	12,511	80.670	1,009,262.370	
BEST BUY CO INC	19,478	118.450	2,307,169.100	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,002	628.300	1,257,856.600	
YUM! BRANDS INC	25,239	117.960	2,977,192.440	
FIRSTENERGY CORP	47,800	36.280	1,734,184.000	
BOEING CO	46,813	234.060	10,957,050.780	
ROBERT HALF INTL INC	8,955	81.250	727,593.750	
BORGWARNER INC	21,938	47.930	1,051,488.340	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,951	41.130	5,139,234.630	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	99.480	1,165,806.120	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,579	177.900	1,704,104.100	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,130	1,276.910	2,719,818.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	197,722	66.080	13,065,469.760	
ONEOK INC	39,284	50.630	1,988,948.920	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,186	119.340	738,237.240	
UNITED RENTALS INC	6,451	310.740	2,004,583.740	
SEMPRA ENERGY	25,257	139.860	3,532,444.020	
FEDEX CORP	21,801	280.340	6,111,692.340	

VERISIGN INC	9,090	209.500	1,904,355.000	
AMPHENOL CORP	52,503	66.790	3,506,675.370	
BROWN-FORMAN CORP	25,320	75.950	1,923,054.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.310	612,928.160	
CSX CORP	66,677	98.450	6,564,350.650	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	16.380	514,594.080	
CAMPBELL SOUP CO	16,623	50.140	833,477.220	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	82.410	1,618,614.810	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,843	238.310	3,537,235.330	
CARDINAL HEALTH INC	25,949	61.050	1,584,186.450	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	64,967	25.720	1,670,951.240	
CATERPILLAR INC	47,359	227.630	10,780,329.170	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	119.040	1,174,329.600	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	138.120	1,371,945.960	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	80,424	12.680	1,019,776.320	
CERNER CORP	27,258	75.320	2,053,072.560	
JPMORGAN CHASE & CO	265,580	149.270	39,643,126.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,977	89.170	1,959,689.090	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	106.970	1,376,917.840	
CINTAS CORP	7,790	341.700	2,661,843.000	
CISCO SYSTEMS INC	368,365	51.790	19,077,623.350	
CLOROX COMPANY	11,142	194.470	2,166,784.740	
COCA-COLA CO/THE	355,908	54.170	19,279,536.360	
COPART INC	18,628	121.290	2,259,390.120	
COGNEX CORP	14,100	84.390	1,189,899.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,780	81.330	5,756,537.400	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	24,297	141.970	3,449,445.090	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	252.490	1,313,705.470	
NRG ENERGY, INC.	21,039	37.850	796,326.150	
COMCAST CORP-CL A	398,143	54.160	21,563,424.880	
CONAGRA BRANDS INC	43,383	38.270	1,660,267.410	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,844	79.350	2,368,121.400	
CMS ENERGY CORP	25,936	65.270	1,692,842.720	
COOPER COS INC	4,682	400.480	1,875,047.360	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	52.430	865,776.590	
CORNING INC	64,261	45.560	2,927,731.160	
SEALED AIR CORP	13,870	48.500	672,695.000	
HEICO CORP-CL A	6,236	121.390	756,988.040	
CUMMINS INC	13,193	259.980	3,429,916.140	
DR HORTON INC	30,677	91.930	2,820,136.610	
DANAHER CORP	55,754	241.850	13,484,104.900	
MOODY'S CORP	14,751	323.760	4,775,783.760	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,276	79.610	3,604,422.360	
TARGET CORP	43,728	207.270	9,063,502.560	

DEERE & CO	25,963	370.270	9,613,320.010	
MORGAN STANLEY	122,733	77.290	9,486,033.570	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	105.010	2,009,471.360	
COSTAR GROUP INC	3,463	912.930	3,161,476.590	
THE WALT DISNEY CO	158,055	182.790	28,890,873.450	
DOLLAR TREE INC	19,806	116.340	2,304,230.040	
DOVER CORP	12,652	144.860	1,832,768.720	
OMNICOM GROUP	19,138	78.860	1,509,222.680	
DTE ENERGY CO	17,152	141.670	2,429,923.840	
DUKE ENERGY CORP	64,242	101.410	6,514,781.220	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,636	142.940	1,663,249.840	
EBAY INC	58,336	61.790	3,604,581.440	
BANK OF AMERICA CORP	678,468	38.080	25,836,061.440	
CITIGROUP INC	181,369	69.790	12,657,742.510	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,705	112.070	1,199,709.350	
EATON CORP PLC	33,574	138.460	4,648,656.040	
CADENCE DESIGN SYS INC	24,634	140.940	3,471,915.960	
DISH NETWORK CORP	21,420	36.890	790,183.800	
ECOLAB INC	22,306	220.840	4,926,057.040	
PERKINELMER INC	9,755	134.360	1,310,681.800	
ELECTRONIC ARTS INC	25,600	140.860	3,606,016.000	
SALESFORCE.COM INC	79,504	227.960	18,123,731.840	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	223.150	500,525.450	
EMERSON ELECTRIC CO	51,889	90.830	4,713,077.870	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	104.590	1,203,098.770	
ENTERGY CORP	17,338	107.990	1,872,330.620	
EOG RESOURCES INC	51,692	68.570	3,544,520.440	
EQUIFAX INC	10,182	192.200	1,956,980.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,758	309.430	6,113,717.940	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,073	110.450	1,554,362.850	
EXXON MOBIL CORP	369,665	55.290	20,438,777.850	
FMC CORP	11,416	113.000	1,290,008.000	
NEXTERA ENERGY INC	170,795	80.530	13,754,121.350	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	318.850	1,034,987.100	
FAIR ISAAC CORP	2,482	523.600	1,299,575.200	
ASSURANT INC	5,523	154.030	850,707.690	
FASTENAL CO	50,482	51.130	2,581,144.660	
FIFTH THIRD BANCORP	62,822	36.440	2,289,233.680	
M&T BANK CORP	11,357	149.670	1,699,802.190	
FISERV INC	49,995	124.560	6,227,377.200	
FORD MOTOR CO	342,821	11.450	3,925,300.450	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	29.090	777,110.260	
FREEMPORT-MCMORAN INC	126,846	35.880	4,551,234.480	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	136.260	2,442,051.720	
DENTSPLY SIRONA INC	19,366	65.480	1,268,085.680	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,623	184.070	3,796,075.610	
GENERAL MILLS INC	53,955	62.300	3,361,396.500	
GENUINE PARTS CO	12,867	119.250	1,534,389.750	

GILEAD SCIENCES INC	109,962	66.380	7,299,277.560	
GARTNER INC	7,895	191.430	1,511,339.850	
MCKESSON CORP	14,289	194.530	2,779,639.170	
NVIDIA CORP	54,034	606.850	32,790,532.900	
GENERAL ELECTRIC CO	764,551	13.060	9,985,036.060	
VW GRAINGER INC	3,622	413.700	1,498,421.400	
HALLIBURTON CO	77,483	19.810	1,534,938.230	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,607	97.400	3,370,721.800	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,529	331.880	9,468,204.520	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,486	210.200	3,885,757.200	
HASBRO INC	11,383	96.730	1,101,077.590	
HENRY SCHEIN INC	12,161	70.520	857,593.720	
HEICO CORP	3,623	132.680	480,699.640	
HERSHEY FOODS CORP	13,002	162.190	2,108,794.380	
HP INC	120,197	33.370	4,010,973.890	
F5 NETWORKS INC	5,529	207.010	1,144,558.290	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,874	107.880	1,280,967.120	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	25.330	707,694.870	
HOLOGIC INC	21,443	73.820	1,582,922.260	
HOME DEPOT INC	93,882	323.960	30,414,012.720	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	79.450	1,294,081.600	
HORMEL FOODS CORP	26,254	47.270	1,241,026.580	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	24.230	1,188,844.950	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	334.550	974,544.150	
HUMANA INC	11,517	443.000	5,102,031.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	168.370	1,270,183.280	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,857	15.170	1,423,810.690	
BIOGEN INC	13,531	273.200	3,696,669.200	
IDEX CORP	6,612	222.470	1,470,971.640	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,428	222.860	6,112,604.080	
INTUIT INC	22,980	405.370	9,315,402.600	
IDEXX LABORATORIES INC	7,466	532.270	3,973,927.820	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	41.160	451,113.600	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	21,013	168.200	3,534,386.600	
INTEL CORP	357,563	62.700	22,419,200.100	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,906	141.820	2,823,068.920	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,598	56.410	1,838,853.180	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	30.010	1,059,863.170	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,541	133.190	1,537,145.790	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	163.850	1,126,304.900	

INCYTE CORP	15,341	84.570	1,297,388.370	
JOHNSON & JOHNSON	229,593	166.480	38,222,642.640	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,886	65.730	2,095,866.780	
KLA CORPORATION	13,653	318.920	4,354,214.760	
DEVON ENERGY CORP	49,345	20.970	1,034,764.650	
KELLOGG CO	22,333	64.220	1,434,225.260	
KEYCORP	79,472	19.840	1,576,724.480	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,692	142.390	4,227,843.880	
BLACKROCK INC/NEW YORK	13,282	804.960	10,691,478.720	
KROGER CO	71,262	37.760	2,690,853.120	
LAM RESEARCH CORP	12,603	613.030	7,726,017.090	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	425.640	1,405,463.280	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	140.810	1,188,154.780	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	105.380	1,491,443.140	
PLUG POWER INC	42,511	25.250	1,073,402.750	
LENNAR CORP	24,511	100.100	2,453,551.100	
ELI LILLY & CO	75,159	190.610	14,326,056.990	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	62.400	1,128,816.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	62,427	179.690	11,217,507.630	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	27,140	132.460	3,594,964.400	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,903	387.330	8,483,688.990	
LOEWS CORP	22,394	53.930	1,207,708.420	
LOWE'S COS INC	63,943	202.770	12,965,722.110	
DOMINION ENERGY INC	71,472	80.110	5,725,621.920	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,870	39.550	1,616,408.500	
MCCORMICK & CO INC	22,130	90.620	2,005,420.600	
MCDONALD'S CORPORATION	64,955	233.010	15,135,164.550	
S&P GLOBAL INC	20,982	379.060	7,953,436.920	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	262.430	896,460.880	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,197.490	1,438,185.490	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	54,307	89.630	4,867,536.410	
MARSH & MCLENNAN COS	44,421	127.350	5,657,014.350	
MASCO CORP	23,151	63.500	1,470,088.500	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,123	344.610	1,765,437.030	
METLIFE INC	67,434	61.160	4,124,263.440	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,591	92.580	2,184,054.780	
MEDTRONIC PLC	117,053	128.280	15,015,558.840	
ACTIVISION BLIZZARD INC	67,840	94.470	6,408,844.800	
CVS HEALTH CORP	114,217	75.910	8,670,212.470	
MERCK & CO. INC.	220,745	78.570	17,343,934.650	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	36,651	39.700	1,455,044.700	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,588	260.000	2,232,880.000	
MICROSOFT CORP	626,536	258.260	161,809,187.360	
MICRON TECH INC	97,476	87.480	8,527,200.480	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,990	149.730	3,442,292.700	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	56,605	45.840	2,594,773.200	
3M CO	50,244	198.300	9,963,385.200	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	196.050	975,544.800	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,876	185.270	2,756,076.520	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	295.500	2,466,243.000	
ILLUMINA INC	12,779	398.390	5,091,025.810	
XCEL ENERGY INC	46,591	71.550	3,333,586.050	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	96.160	774,857.280	
NETAPP INC	19,804	75.190	1,489,062.760	
NEWELL BRANDS INC	33,317	26.500	882,900.500	
NEWMONT CORP	67,812	65.840	4,464,742.080	
NVR INC	308	4,906.220	1,511,115.760	
NIKE INC-CL B	109,499	127.110	13,918,417.890	
NORDSON CORP	4,644	206.200	957,592.800	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,176	273.310	6,060,922.560	
EVERSOURCE ENERGY	30,121	90.580	2,728,360.180	
NISOURCE INC	33,097	26.180	866,479.460	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	107.370	1,864,480.050	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,126	345.140	4,875,447.640	
WELLS FARGO & CO	342,476	42.540	14,568,929.040	
NUCOR CORP	26,612	78.490	2,088,775.880	
CHENIERE ENERGY INC	19,976	73.220	1,462,642.720	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,074	131.500	5,269,731.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	78,449	23.200	1,820,016.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,821	247.640	1,936,792.440	
OGE ENERGY CORP	16,028	33.640	539,181.920	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,576	536.270	3,526,511.520	
ORACLE CORP	170,734	79.240	13,528,962.160	
PACCAR INC	30,769	92.100	2,833,824.900	
PTC INC	9,801	142.190	1,393,604.190	
EXELON CORP	85,259	45.800	3,904,862.200	
PARKER HANNIFIN CORP	11,236	312.160	3,507,429.760	
PAYCHEX INC	27,217	97.510	2,653,929.670	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,553	596.200	3,906,898.600	
PPL CORPORATION	67,795	29.000	1,966,055.000	
PEPSICO INC	120,414	145.710	17,545,523.940	
PENTAIR PLC	12,644	63.440	802,135.360	

PFIZER INC	485,055	39.030	18,931,696.650	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,211	47.840	966,894.240	
CONOCOPHILLIPS	119,209	48.650	5,799,517.850	
PG&E CORP	123,999	11.200	1,388,788.800	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,337	145.920	2,675,735.040	
ALTRIA GROUP INC	162,340	47.190	7,660,824.600	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,940	171.730	6,343,706.200	
BROWN & BROWN INC	20,308	49.370	1,002,605.960	
GARMIN LTD	12,365	138.200	1,708,843.000	
PPG INDUSTRIES INC	21,001	169.000	3,549,169.000	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	219.280	735,245.840	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,463	371.730	14,297,850.990	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,806	176.550	3,496,749.300	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	129.370	1,542,866.620	
PROCTER & GAMBLE CO	216,037	137.750	29,759,096.750	
PROGRESSIVE CORP	49,860	99.790	4,975,529.400	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	44,503	63.650	2,832,615.950	
PULTE GROUP INC	21,939	52.510	1,152,016.890	
GLOBAL PAYMENTS INC	26,272	213.030	5,596,724.160	
QUALCOMM INC	98,725	133.400	13,169,915.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	126.710	1,361,372.240	
EXACT SCIENCES CORP	13,911	125.620	1,747,499.820	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	169.740	787,254.120	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,234	504.420	4,657,814.280	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	127.580	777,855.260	
RESMED INC	12,108	205.700	2,490,615.600	
US BANCORP	118,479	56.220	6,660,889.380	
SEAGEN INC	10,602	144.760	1,534,745.520	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,383	39.240	1,349,188.920	
ROSS STORES INC	31,230	124.960	3,902,500.800	
ROLLINS INC	18,567	35.180	653,187.060	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,166	426.550	3,909,757.300	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,692	263.220	2,551,128.240	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,567	81.070	1,667,366.690	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	93.390	1,027,663.560	
ACCENTURE PLC-CL A	55,275	288.600	15,952,365.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	124,700	59.210	7,383,487.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,818	237.230	2,566,354.140	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	22,302	155.730	3,473,090.460	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	54,372	151.780	8,252,582.160	
BOOKING HOLDINGS INC	3,576	2,345.000	8,385,720.000	
SCHLUMBERGER LTD	123,810	25.250	3,126,202.500	
SCHWAB (CHARLES) CORP	133,711	63.690	8,516,053.590	
POOL CORP	3,532	386.060	1,363,563.920	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,291	173.810	3,179,158.710	
BUNGE LTD	10,954	81.310	890,669.740	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	62.640	667,303.920	
ANTHEM INC	21,677	381.880	8,278,012.760	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,836	120.500	1,667,238.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,038	61.500	1,539,837.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,388	267.240	5,715,729.120	
CENTENE CORP	48,785	65.430	3,192,002.550	
SVB FINANCIAL GROUP	4,631	507.710	2,351,205.010	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	67.110	761,765.610	
SNAP-ON INC	4,591	234.570	1,076,910.870	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,967	96.020	3,357,531.340	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	193.910	1,207,283.660	
EDISON INTERNATIONAL	31,223	61.520	1,920,838.960	
SOUTHERN CO	92,031	66.090	6,082,328.790	
TRUIST FINANCIAL CORP	117,919	55.750	6,573,984.250	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	59.850	791,217.000	
AT&T INC	621,475	29.890	18,575,887.750	
CHEVRON CORP	168,033	101.330	17,026,783.890	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,274	202.940	2,896,765.560	
STATE STREET CORP	29,438	78.600	2,313,826.800	
STARBUCKS CORP	102,433	116.270	11,909,884.910	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	50.120	879,455.640	
STRYKER CORP	29,442	258.430	7,608,696.060	
NETFLIX INC	38,560	549.570	21,191,419.200	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	21.820	1,068,198.100	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	49.270	482,501.110	
SYNOPSIS INC	13,449	250.170	3,364,536.330	
SYSCO CORP	42,310	80.310	3,397,916.100	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,252	811.110	8,315,499.720	
TELEFLEX INC	4,122	431.860	1,780,126.920	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	10.110	892,935.420	
TERADYNE INC	14,284	124.270	1,775,072.680	
TEXAS INSTRUMENTS INC	80,128	185.270	14,845,314.560	
TEXTRON INC	19,486	58.220	1,134,474.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,613	482.360	16,695,926.680	

GLOBE LIFE INC	8,329	103.320	860,552.280	
DAVITA INC	6,497	112.200	728,963.400	
TRACTOR SUPPLY CO	10,462	181.050	1,894,145.100	
TRIMBLE INC	22,159	79.420	1,759,867.780	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,534	446.140	1,576,658.760	
TYSON FOODS INC	25,913	78.530	2,034,947.890	
UGI CORP	19,377	44.510	862,470.270	
UNION PACIFIC CORP	58,712	220.670	12,955,977.040	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	132,685	77.090	10,228,686.650	
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,659	396.530	32,776,773.270	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	144.880	1,120,936.560	
VF CORP	29,520	84.550	2,495,916.000	
VIACOMCBS INC	50,493	37.920	1,914,694.560	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,989	220.160	5,061,258.240	
VULCAN MATERIALS CO	10,992	174.510	1,918,213.920	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,288	53.340	3,322,441.920	
WALMART INC	123,488	140.790	17,385,875.520	
WASTE MANAGEMENT INC	36,937	134.870	4,981,693.190	
WATERS CORP	5,084	296.270	1,506,236.680	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,458	319.190	2,061,329.020	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,306	132.510	1,365,648.060	
VAIL RESORTS INC	3,590	310.290	1,113,941.100	
WESTERN DIGITAL CORP	27,103	67.980	1,842,461.940	
WABTEC CORP	16,043	80.610	1,293,226.230	
WHIRLPOOL CORP	5,587	236.450	1,321,046.150	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,987	182.720	2,555,704.640	
WYNN RESORTS LTD	8,309	121.640	1,010,706.760	
NASDAQ INC	10,097	159.680	1,612,288.960	
CME GROUP INC	31,381	206.120	6,468,251.720	
WILLIAMS COS INC	101,276	23.450	2,374,922.200	
LKQ CORP	25,055	43.870	1,099,162.850	
ALLIANT ENERGY CORP	22,453	57.420	1,289,251.260	
WEC ENERGY GROUP INC	26,247	99.150	2,602,390.050	
CARMAX INC	14,684	127.800	1,876,615.200	
XILINX INC	20,603	123.620	2,546,942.860	
TJX COMPANIES INC	104,812	67.750	7,101,013.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,459	499.560	2,227,538.040	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	5.020	545,674.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	64.610	1,330,966.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,239	136.030	1,392,811.170	
CBRE GROUP INC	29,528	81.410	2,403,874.480	

LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	26.190	333,451.080	
REGIONS FINANCIAL CORP	85,582	20.000	1,711,640.000	
DOMINO'S PIZZA INC	3,317	398.050	1,320,331.850	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,737	364.280	1,361,314.360	
T-MOBILE US INC	48,758	130.550	6,365,356.900	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,277	59.040	1,787,554.080	
MOSAIC CO/THE	32,592	32.210	1,049,788.320	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,402	529.120	1,800,066.240	
CELANESE CORP	10,141	155.540	1,577,331.140	
DEXCOM INC	8,096	388.910	3,148,615.360	
DISCOVERY INC-A	14,886	35.470	528,006.420	
EXPEDIA GROUP INC	11,410	170.460	1,944,948.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	46.230	854,099.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,347	242.380	2,507,905.860	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	26.125	888,850.870	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,028	119.760	5,871,593.280	
LIVE NATION	13,804	78.450	1,082,923.800	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,338	1,532.090	3,582,026.420	
TRANSDIGM GROUP INC	4,537	595.750	2,702,917.750	
MASTERCARD INC	77,603	376.630	29,227,617.890	
WESTERN UNION CO	35,367	25.970	918,480.990	
OWENS CORNING	9,740	94.530	920,722.200	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	101.530	1,306,284.980	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	18.780	325,833.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,959	158.850	1,581,987.150	
DELTA AIR LINES INC	14,723	44.450	654,437.350	
INSULET CORP	6,122	283.480	1,735,464.560	
DISCOVER FINANCIAL	27,544	96.800	2,666,259.200	
TE CONNECTIVITY LTD	28,976	128.390	3,720,228.640	
MASIMO CORP	4,505	243.510	1,097,012.550	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,863	316.290	3,435,858.270	
VMWARE INC	7,464	165.880	1,238,128.320	
MERCADOLIBRE INC	3,928	1,533.410	6,023,234.480	
ULTA BEAUTY INC	4,737	316.940	1,501,344.780	
INVESCO LTD	33,443	25.790	862,494.970	
MSCI INC	7,461	468.030	3,491,971.830	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,731	94.000	12,758,714.000	
VISA INC	147,591	223.280	32,954,118.480	
KEURIG DR PEPPER INC	48,480	36.170	1,753,521.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,083	161.310	2,594,348.730	

DISCOVERY INC-C	24,122	30.200	728,484.400	
MARATHON PETROLEUM CORP	57,257	52.050	2,980,226.850	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	100.640	1,181,916.160	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	170,023	16.550	2,813,880.650	
XYLEM INC	15,776	107.590	1,697,339.840	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	104.640	2,577,911.040	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	207.570	723,173.880	
SPLUNK INC	13,441	131.740	1,770,717.340	
EPAM SYSTEMS INC	4,954	446.920	2,214,041.680	
ZILLOW GROUP INC	4,265	131.680	561,615.200	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	51.320	760,254.480	
HCA HEALTHCARE INC	23,595	192.940	4,552,419.300	
VERISK ANALYTICS INC	13,730	184.440	2,532,361.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,257	168.090	883,649.130	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,343	284.750	2,090,919.250	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	14,394	172.620	2,484,692.280	
NXP SEMICONDUCTOR NV	24,544	193.860	4,758,099.840	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	83.390	972,911.130	
LEAR CORP	4,681	172.080	805,506.480	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,704	104.280	907,653.120	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	71.560	1,448,589.080	
DOLLAR GENERAL CORP	22,156	218.290	4,836,433.240	
FORTINET INC	12,146	202.800	2,463,208.800	
HORIZON PHARMA PLC	19,642	91.060	1,788,600.520	
TESLA INC	66,165	718.990	47,571,973.350	
GENERAC HOLDINGS INC	5,632	313.770	1,767,152.640	
ENPHASE ENERGY INC	10,163	147.000	1,493,961.000	
GENERAL MOTORS CO	112,605	55.770	6,279,980.850	
XPO LOGISTICS INC	7,614	134.830	1,026,595.620	
ALLY FINANCIAL INC	30,467	46.790	1,425,550.930	
VOYA FINANCIAL INC	10,611	66.780	708,602.580	
APTIV PLC	24,029	135.040	3,244,876.160	
PHILLIPS 66	38,464	75.420	2,900,954.880	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	103.580	742,875.760	
FACEBOOK INC	209,759	302.650	63,483,561.350	
IQVIA HOLDINGS INC	16,838	217.120	3,655,866.560	
SERVICENOW INC	17,124	540.780	9,260,316.720	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,027	360.000	2,889,720.000	
WORKDAY INC	15,874	249.920	3,967,230.080	
ABBVIE INC	154,294	109.030	16,822,674.820	

ZOETIS INC	41,554	168.740	7,011,821.960	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,862	26.490	817,534.380	
CDW CORP	12,600	180.740	2,277,324.000	
HOWMET AEROSPACE INC	34,315	31.000	1,063,765.000	
TWILIO INC	12,367	367.650	4,546,727.550	
COUPA SOFTWARE INC	5,718	258.380	1,477,416.840	
SNAP INC	81,216	58.490	4,750,323.840	
TRADE DESK INC A	3,760	686.070	2,579,623.200	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,557	45.970	853,065.290	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	45.820	381,405.680	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	45.870	651,583.350	
OKTA INC	10,690	265.800	2,841,402.000	
BLACK KNIGHT INC	13,669	74.130	1,013,282.970	
BAKER HUGHES CO	56,969	19.510	1,111,465.190	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	79.160	1,043,407.960	
ALTICE USA INC-A	21,506	34.660	745,397.960	
BROADCOM INC	35,343	457.260	16,160,940.180	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,293	325.220	2,046,609.460	
MONGODB INC	4,349	297.630	1,294,392.870	
BURLINGTON STORES INC	5,894	318.700	1,878,417.800	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	30.660	1,098,363.840	
VEEVA SYSTEMS INC	11,921	268.850	3,204,960.850	
TWITTER INC	69,812	65.700	4,586,648.400	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	56.620	748,176.680	
EVERGY INC	18,131	64.810	1,175,070.110	
ALLEGION PLC	7,353	132.450	973,904.850	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	91.050	1,042,886.700	
STERIS PLC	7,390	209.390	1,547,392.100	
DOCUSIGN INC	15,982	219.430	3,506,930.260	
WIX.COM LTD	4,918	290.580	1,429,072.440	
DROPBOX INC	28,170	25.720	724,532.400	
KKR & CO INC	42,868	52.600	2,254,856.800	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	17,075	321.780	5,494,393.500	
MODERNA INC	23,442	156.780	3,675,236.760	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	24,527	122.220	2,997,689.940	
ARAMARK	20,857	38.310	799,031.670	
CIGNA CORP	31,550	253.370	7,993,823.500	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,759	101.480	2,106,623.320	
DOW INC	64,632	62.480	4,038,207.360	
AMCOR PLC	138,490	11.860	1,642,491.400	
PINTEREST INC	44,897	71.320	3,202,054.040	
PELTON INTERACTIVE INC	20,525	106.500	2,185,912.500	
FOX CORP-A	31,751	37.800	1,200,187.800	
FOX CORP-B	13,009	36.650	476,779.850	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	14,762	206.600	3,049,829.200	

CHEWY INC	6,586	77.000	507,122.000	
AVANTOR INC	44,509	31.600	1,406,484.400	
DYNATRACE INC	15,949	49.960	796,812.040	
CLOUDFLARE INC	16,628	72.390	1,203,700.920	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	78.870	557,216.550	
CARRIER GLOBAL CORP	72,193	42.520	3,069,646.360	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,946	70.470	2,533,114.620	
UBER TECHNOLOGIES INC	84,858	55.480	4,707,921.840	
CORTEVA INC	65,002	46.960	3,052,493.920	
MATCH GROUP INC	21,285	139.720	2,973,940.200	
SLACK TECHNOLOGIES INC	38,755	42.100	1,631,585.500	
BLACKSTONE GROUP INC	58,958	79.500	4,687,161.000	
CARLYLE GROUP INC	12,509	39.280	491,353.520	
10X GENOMICS INC	5,312	180.740	960,090.880	
DATADOG INC	14,775	83.960	1,240,509.000	
INGERSOLL RAND INC	31,282	50.340	1,574,735.880	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	382.420	1,655,878.600	
PPD INC	10,828	46.290	501,228.120	
AON PLC	19,949	234.820	4,684,424.180	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	236.250	1,668,870.000	
AIRBNB INC	4,882	169.570	827,840.740	
ZENDESK INC	10,590	146.070	1,546,881.300	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	41.440	698,719.840	
VIATRIS INC	103,126	13.110	1,351,981.860	
DRAFTKINGS INC	14,671	55.710	817,321.410	
SNOWFLAKE INC	2,127	225.220	479,042.940	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	309.530	1,560,650.260	
IHS MARKIT LTD	33,179	103.900	3,447,298.100	
FNF GROUP	24,567	43.970	1,080,210.990	
CATALENT INC	14,673	109.360	1,604,639.280	
SYNCHRONY FINANCIAL	46,538	39.570	1,841,508.660	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	37,788	42.710	1,613,925.480	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	141.940	490,686.580	
WAYFAIR INC	5,840	314.000	1,833,760.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,395	143.000	2,344,485.000	
HUBSPOT INC	3,654	497.710	1,818,632.340	
QORVO INC	10,168	183.950	1,870,403.600	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	1,162	152.870	177,634.940	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,950	157.370	2,352,681.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	31.380	534,024.840	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,257	243.870	1,038,154.590	
GODADDY INC	14,540	84.790	1,232,846.600	
ETSY INC	10,580	206.860	2,188,578.800	

TRANSUNION	16,760	96.570	1,618,513.200	
SQUARE INC	33,616	245.500	8,252,728.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	47,313	75.130	3,554,625.690	
CARVANA CO	5,347	262.630	1,404,282.610	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	18,296	55.170	1,009,390.320	
TELADOC HEALTH INC	9,788	180.910	1,770,747.080	
WESTROCK CO	22,778	53.390	1,216,117.420	
KRAFT HEINZ CO	56,429	41.030	2,315,281.870	
NOVOCURE LTD	7,408	194.840	1,443,374.720	
FORTIVE CORP	26,474	72.560	1,920,953.440	
WASTE CONNECTIONS INC	23,285	116.650	2,716,195.250	
ALPHABET INC-CL A	26,351	2,279.010	60,054,192.510	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	114,285	15.750	1,799,988.750	
PAYPAL HOLDINGS INC	97,262	264.430	25,718,990.660	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	32.640	1,151,441.280	
SUNRUN INC	10,000	48.230	482,300.000	
ZILLOW GROUP INC-C	13,376	129.200	1,728,179.200	
ALPHABET INC-CL C	25,783	2,293.630	59,136,662.290	
ZSCALER INC	6,609	186.080	1,229,802.720	
CABLE ONE INC	392	1,817.480	712,452.160	
LINDE PLC	45,759	285.840	13,079,752.560	
ATHENE HOLDING LTD	8,838	55.350	489,183.300	
ROKU INC	9,562	354.850	3,393,075.700	
AVALARA INC	7,102	139.490	990,657.980	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,191	652.460	7,954,139.860	
VISTRA CORP	38,032	17.810	677,349.920	
アメリカ・ドル 小計	27,274,226		3,168,717,985.310 (342,475,039,853)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	35,261	18.410	649,155.010	
ASHTED GROUP	39,955	45.780	1,829,139.900	
SEVERN TRENT PLC	21,933	24.610	539,771.130	
BHP GROUP PLC	183,920	21.670	3,985,546.400	
BARCLAYS PLC	1,522,628	1.818	2,768,137.700	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	80,307	7.658	614,991.000	
BT GROUP PLC	795,507	1.531	1,217,921.210	
BUNZL PLC	28,834	25.040	722,003.360	
AVIVA PLC	347,472	3.967	1,378,421.420	
CRODA INTERNATIONAL	12,568	67.200	844,569.600	
DIAGEO PLC	204,014	31.985	6,525,387.790	
SCHRODERS PLC	11,354	35.670	404,997.180	
DCC PLC	7,898	63.760	503,576.480	
NATIONAL GRID PLC	310,448	9.113	2,829,112.620	
KINGFISHER PLC	168,984	3.601	608,511.380	
BAE SYSTEMS PLC	268,285	5.180	1,389,716.300	

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	200,509	26.925	5,398,704.820	
HALMA PLC	33,758	25.620	864,879.960	
NEXT PLC	11,467	77.940	893,737.980	
IMPERIAL BRANDS PLC	79,783	14.655	1,169,219.860	
JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	31.820	607,984.740	
ANGLO AMERICAN PLC	106,433	30.670	3,264,300.110	
COMPASS GROUP PLC	156,538	15.510	2,427,904.380	
HSBC HOLDINGS PLC	1,777,219	4.172	7,414,557.660	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	521,984	2.694	1,406,224.890	
UNILEVER PLC	229,033	41.280	9,454,482.240	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.813	417,374.350	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	9.738	659,398.930	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	95,487	6.824	651,603.280	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	23.140	721,181.240	
PEARSON PLC	65,009	7.890	512,921.010	
PERSIMMON PLC	28,126	31.390	882,875.140	
PRUDENTIAL PLC	227,614	14.985	3,410,795.790	
RIO TINTO PLC	97,409	59.550	5,800,705.950	
VODAFONE GROUP PLC	2,336,405	1.314	3,070,036.170	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	63,262	66.760	4,223,371.120	
RELX PLC	168,306	19.175	3,227,267.550	
RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	5.164	876,671.620	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	746,540	0.992	740,567.680	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.930	816,494.220	
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	13.055	649,995.390	
SSE PLC	90,917	14.810	1,346,480.770	
BP PLC	1,774,599	2.917	5,176,505.280	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,238	6.410	559,195.580	
SMITHS GROUP PLC	35,235	16.050	565,521.750	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	121.550	799,069.700	
STANDARD CHARTERED PLC	240,093	4.750	1,140,441.750	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,262,988	0.420	2,630,454.960	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.846	640,181.720	
TESCO PLC	679,368	2.270	1,542,165.360	
3I GROUP PLC	87,095	12.145	1,057,768.770	
SMITH & NEPHEW PLC	76,928	14.140	1,087,761.920	
GLAXOSMITHKLINE PLC	439,252	13.252	5,820,967.500	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,667	76.960	2,052,292.320	
WPP PLC	109,394	9.418	1,030,272.690	
ASTRAZENECA PLC	114,648	74.940	8,591,721.120	

WHITBREAD PLC	18,594	33.500	622,899.000		
INTERTEK GROUP PLC	13,842	60.260	834,118.920		
BURBERRY GROUP PLC	32,218	20.050	645,970.900		
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	49.520	824,607.040		
SAINSBURY (J) PLC	132,694	2.485	329,744.590		
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	31.420	499,358.060		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,434	45.690	522,419.460		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	358,793	13.502	4,844,423.080		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	322,365	12.910	4,161,732.150		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,491	23.780	297,035.980		
AVEVA GROUP PLC	10,408	37.680	392,173.440		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.761	569,630.190		
EXPERIAN PLC	76,868	26.870	2,065,443.160		
MONDI PLC	38,299	19.470	745,681.530		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	16.685	467,363.530		
FRESNILLO PLC NPR	17,385	9.230	160,463.550		
OCADO GROUP PLC	42,789	21.780	931,944.420		
INFORMA PLC	128,510	5.680	729,936.800		
GLENCORE PLC	839,927	2.907	2,441,667.780		
ENTAIN PLC	49,618	16.270	807,284.860		
EVRAZ PLC	48,765	6.080	296,491.200		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.980	335,828.120		
COCA-COLA HBC AG	15,208	24.690	375,485.520		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	53,472	7.334	392,163.640		
FERGUSON PLC	20,531	92.080	1,890,494.480		
M&G PLC	204,940	2.118	434,062.920		
JD SPORTS FASHION PLC	47,098	8.812	415,027.570		
AUTO TRADER GROUP PLC	81,805	5.718	467,760.990		
MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.622	688,822.850		
イギリス・ボンド 小計	25,735,140		148,605,051.480 (22,385,864,955)		
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	26.630	2,725,820.170	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	22.820	2,982,642.460	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	463.800	816,288.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	14.570	1,488,092.380	
	ICL GROUP LTD	68,048	21.100	1,435,812.800	
	NICE LTD	5,535	776.400	4,297,374.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	90.260	942,675.440	
	AZRIELI GROUP	4,414	228.700	1,009,481.800	
イスラエル・シュケル 小計	425,397		15,698,187.050 (521,744,945)		

オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	66.780	1,125,510.120	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	248,406	28.660	7,119,315.960	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	316,030	25.240	7,976,597.200	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	143,130	21.600	3,091,608.000	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.390	1,235,346.510	
	AMP LTD	302,414	1.200	362,896.800	
	ASX LTD	15,518	71.180	1,104,571.240	
	BHP GROUP LTD	256,650	47.450	12,178,042.500	
	AMPOL LTD	20,946	25.710	538,521.660	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	14.880	767,867.520	
	CSL LIMITED	39,828	263.950	10,512,600.600	
	REA GROUP LTD	4,278	157.800	675,068.400	
	TRANSURBAN GROUP	242,508	13.990	3,392,686.920	
	COCA-COLA AMATIL LTD	38,083	13.310	506,884.730	
	COCHLEAR LTD	5,743	218.440	1,254,500.920	
	ORIGIN ENERGY LTD	128,224	4.100	525,718.400	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	154,630	87.740	13,567,236.200	
	RIO TINTO LIMITED	33,859	120.200	4,069,851.800	
	APA GROUP	118,205	10.030	1,185,596.150	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	36.350	1,879,912.950	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	4.810	1,083,115.800	
	TPG TELECOM LTD	28,719	5.880	168,867.720	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,410	42.920	1,691,477.200	
	ORICA LTD	41,311	13.850	572,157.350	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	17.200	149,794.800	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	12.840	797,569.440	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	21.350	998,688.950	
	SYDNEY AIRPORT	116,056	6.040	700,978.240	
	MACQUARIE GROUP LTD	30,322	156.000	4,730,232.000	
	SUNCORP GROUP LTD	118,236	10.400	1,229,654.400	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	288,474	26.500	7,644,561.000	
	NEWCREST MINING LTD	73,202	27.900	2,042,335.800	
OIL SEARCH LTD	148,835	3.900	580,456.500		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	5.010	312,032.820		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,924	9.560	1,127,353.440		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93,404	11.370	1,062,003.480		
SANTOS LTD	159,618	7.020	1,120,518.360		
SONIC HEALTHCARE	40,148	36.000	1,445,328.000		

	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	32.950	276,977.700	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	4.830	1,036,503.510	
	WESFARMERS LTD	99,088	55.510	5,500,374.880	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	23.340	2,011,814.640	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	110,976	41.630	4,619,930.880	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	47.690	476,661.550	
	SEEK LTD	28,713	30.900	887,231.700	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.855	306,197.430	
	AGL ENERGY LTD	49,076	9.150	449,045.400	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.370	1,318,711.420	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.040	395,646.440	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.740	668,169.360	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.850	578,077.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	10.290	593,393.430	
	XERO LTD	10,498	143.730	1,508,877.540	
	AFTERPAY LTD	18,322	125.230	2,294,464.060	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	2.840	804,157.360	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.850	1,175,183.250	
	COLES GROUP LTD	121,032	15.580	1,885,678.560	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	31.780	432,335.120	
	オーストラリア・ドル 小計	6,393,635		127,746,891.610 (10,669,420,387)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,375	83.710	1,789,301.250	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	71,520	42.100	3,010,992.000	
	BARRICK GOLD CORP	156,423	28.240	4,417,385.520	
	ATCO LTD	7,193	42.960	309,011.280	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	24.410	519,249.520	
	BANK OF MONTREAL	56,107	112.670	6,321,575.690	
	BANK OF NOVA SCOTIA	105,569	76.760	8,103,476.440	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,716	87.750	2,432,079.000	
	BCE INC	14,959	58.500	875,101.500	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	112,393	55.750	6,265,909.750	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	35.900	1,012,092.800	
	SAPUTO INC	25,395	40.380	1,025,450.100	
	BLACKBERRY LTD	46,671	10.340	482,578.140	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	56,605	20.370	1,153,043.850	
	CGI INC	19,859	107.420	2,133,253.780	
	CCL INDUSTRIES INC	15,358	69.100	1,061,237.800	
	CAE INC	25,006	36.890	922,471.340	
	CAMECO CORP	32,627	20.160	657,760.320	
	ROGERS COMM-CL B	31,543	61.540	1,941,156.220	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,924	123.600	4,811,006.400	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,953	37.100	3,856,656.300	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	199.300	968,996.600	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	34.670	316,155.730	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	61,949	138.850	8,601,618.650	
YAMANA GOLD INC	84,317	6.050	510,117.850	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	41.430	659,192.730	
OPEN TEXT CORP	24,883	61.440	1,528,811.520	
EMPIRE CO LTD	15,093	40.580	612,473.940	
KINROSS GOLD CORP	118,575	9.570	1,134,762.750	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	78.690	783,988.470	
FORTIS INC	39,632	55.810	2,211,861.920	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	27.190	1,351,179.860	
TELUS CORP	31,890	25.800	822,762.000	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	34.950	882,487.500	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	31.360	675,557.120	
ENBRIDGE INC	177,484	46.400	8,235,257.600	
IGM FINANCIAL INC	6,069	40.180	243,852.420	
MANULIFE FINANCIAL CORP	169,194	26.480	4,480,257.120	
LOBLAW CO LTD	15,136	70.670	1,069,661.120	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,626	116.470	2,751,720.220	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,646	65.400	3,312,248.400	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	561.930	1,347,508.140	
METRO INC	21,394	59.310	1,268,878.140	
EMERA INC	22,433	57.660	1,293,486.780	
ONEX CORP	6,646	79.640	529,287.440	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	42.580	799,056.280	
POWER CORP OF CANADA	50,405	34.240	1,725,867.200	
QUEBECOR INC-B	16,042	35.730	573,180.660	
ROYAL BANK OF CANADA	123,521	116.600	14,402,548.600	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,765	447.710	5,267,308.150	
SHAW COMM INC-B	39,427	34.940	1,377,579.380	
SUNCOR ENERGY INC	134,506	25.220	3,392,241.320	
LUNDIN MINING CORP	64,310	15.390	989,730.900	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	26.950	1,105,381.200	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	115.870	1,743,727.630	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	97.540	723,454.180	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	157,623	81.960	12,918,781.080	
TC ENERGY CORP	79,381	59.640	4,734,282.840	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	103.070	742,104.000	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	114.750	709,614.000	

	INTACT FINANCIAL CORP	12,515	162.410	2,032,561.150	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,884	53.740	2,143,366.160	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,781	1,808.820	3,221,508.420	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	15,847	175.120	2,775,126.640	
	B2GOLD CORP	101,675	6.430	653,770.250	
	KEYERA CORP	16,668	25.940	432,367.920	
	PARKLAND CORP	14,497	37.780	547,696.660	
	ALTAGAS LTD	23,944	21.540	515,753.760	
	PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	37.230	1,876,764.300	
	DOLLARAMA INC	26,906	57.940	1,558,933.640	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	9.220	1,103,716.980	
	NORTHLAND POWER INC	17,568	43.710	767,897.280	
	TMX GROUP LTD	5,058	137.480	695,373.840	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	48.280	1,054,435.200	
	INTER PIPELINE LTD	41,863	17.940	751,022.220	
	NUTRIEN LTD	47,599	66.620	3,171,045.380	
	SSR MINING INC	18,000	20.660	371,880.000	
	WSP GLOBAL INC	10,194	128.100	1,305,851.400	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,771	67.970	596,164.870	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	41.630	686,270.550	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	54.020	585,846.900	
	AIR CANADA	10,722	23.260	249,393.720	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	83.310	2,097,412.560	
	SHOPIFY INC	9,634	1,416.080	13,642,514.720	
	FIRSTSERVICE CORP	3,503	204.330	715,767.990	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	32.220	600,387.480	
	HYDRO ONE LTD	27,340	30.790	841,798.600	
	カナダ・ドル 小計	3,516,046		194,892,399.030 (16,706,176,445)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.990	498,750.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	158,800	29.020	4,608,376.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	8.030	292,292.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	10.470	721,383.000	
	CAPITALAND LTD	232,915	3.740	871,102.100	
	GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.900	384,120.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.450	735,205.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	297,553	11.920	3,546,831.760	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	664,422	2.530	1,680,987.660	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	100,150	5.080	508,762.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	26.270	2,690,048.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.950	321,975.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	20.250	425,250.000	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	5.400	979,560.000	
シンガポール・ドル	小計	2,591,140		18,264,642.520 (1,485,280,730)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	215,578	9.430	2,032,900.540	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	102.650	1,481,136.850	
	NESTLE SA-REGISTERED	251,234	105.960	26,620,754.640	
	CIE FINANC RICHEMONT	45,822	92.820	4,253,198.040	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	60,929	308.050	18,769,178.450	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	285.900	991,215.300	
	SIKA INHABER	12,399	271.800	3,370,048.200	
	SGS SA-REG	540	2,730.000	1,474,200.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	193,828	80.350	15,574,079.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	159.900	681,014.100	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,164.000	573,460.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.855	396,683.040	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	481.500	1,198,453.500	
	ABB LTD	160,075	29.730	4,759,029.750	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,600	64.500	877,200.000	
	GEBERIT AG	3,214	608.000	1,954,112.000	
	LONZA GROUP AG-REG	6,593	550.400	3,628,787.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	8,680.000	824,600.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	91,400.000	822,600.000	
	GIVAUDAN-REG	809	3,888.000	3,145,392.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,752	377.800	4,817,705.600	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,336	324.800	1,083,532.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	45,832	56.600	2,594,091.200	
	TEMENOS GROUP	5,723	144.700	828,118.100	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	266.200	1,250,607.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,816	283.000	1,362,928.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1,217.500	1,118,882.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,441	278.500	679,818.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	54.100	248,427.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	277.600	461,648.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,739	467.000	1,279,113.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	95.700	239,250.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,392	133.200	451,814.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	852.500	479,957.500	
	SWISS PRIME SITE AG	6,341	91.150	577,982.150	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,658	1,290.000	2,138,820.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,118	58.060	1,168,051.080	
	SWISS RE LTD	25,212	84.000	2,117,808.000	
	ALCON INC	43,135	67.440	2,909,024.400	
	UBS GROUP AG	321,504	14.220	4,571,786.880	
スイス・フラン	小計	1,523,547		123,807,411.120 (14,608,036,438)	

スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	56,181	531.200	29,843,347.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	458.800	16,540,198.800	
	ERICSSON LM-B SHS	255,112	115.880	29,562,378.560	
	LUNDBERGS B	7,382	489.300	3,612,012.600	
	SKF AB-B SHS	34,849	242.100	8,436,942.900	
	SANDVIK AB	103,400	225.900	23,358,060.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,990	103.600	15,020,964.000	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	224.700	7,112,429.100	
	SWEDBANK AB	79,825	152.300	12,157,347.500	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	154.850	8,198,533.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	93.700	13,045,851.000	
	VOLVO AB-B SHS	122,781	204.400	25,096,436.400	
	SWEDISH MATCH AB	13,845	712.200	9,860,409.000	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	117.600	5,533,668.000	
	INDUSTRIVARDEN A	12,131	337.000	4,088,147.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	321.800	3,669,485.400	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	241.900	4,642,302.900	
	SECURITAS AB-B SHS	23,986	148.150	3,553,525.900	
	INVESTOR AB-B SHS	39,372	709.500	27,934,434.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	200.550	14,218,192.800	
	ASSA ABLOY AB-B	88,119	249.000	21,941,631.000	
	TELIA CO AB	223,567	35.750	7,992,520.250	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	262.000	3,861,618.000	
	BOLIDEN AB	23,180	327.000	7,579,860.000	
	ALFA LAVAL AB	28,392	270.500	7,680,036.000	
	KINNEVIK AB-B	21,722	463.100	10,059,458.200	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	495.200	4,440,458.400	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	412.400	3,715,311.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	124.300	4,187,915.600	
	NIBE INDUSTRIER AB	24,131	307.200	7,413,043.200	
	HEXAGON AB	24,690	833.600	20,581,584.000	
EPIROC AB-A	60,750	201.900	12,265,425.000		
EPIROC AB-B	30,899	185.450	5,730,219.550		
ESSITY AB-B	52,718	281.500	14,840,117.000		
EQT AB	20,934	281.100	5,884,547.400		
EVOLUTION GAMING GROUP AB	13,641	1,395.000	19,029,195.000		
NORDEA BANK ABP	269,020	84.850	22,826,347.000		
INVESTMENT AB LATOUR	14,945	244.500	3,654,052.500		
スウェーデン・クローナ 小計	2,265,393		449,168,006.010 (5,753,842,157)		
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	8,494	1,046.500	8,888,971.000	
	A P MOLLER A/S	568	14,895.000	8,460,360.000	
	AP MOLLER MAERSK A	255	13,880.000	3,539,400.000	

	DANSKE BANK A/S	59,305	111.450	6,609,542.250	
	GENMAB A/S	5,825	2,206.000	12,849,950.000	
	NOVOZYMES-B SHS	17,740	408.100	7,239,694.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,660.000	2,162,580.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	150,567	450.000	67,755,150.000	
	GN STORE NORD A/S	11,641	531.400	6,186,027.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,303	1,181.600	20,445,224.800	
	COLOPLAST-B	10,734	985.200	10,575,136.800	
	DSV PANALPINA A S	18,283	1,302.500	23,813,607.500	
	DEMANT A/S	10,739	302.600	3,249,621.400	
	H LUNDBECK A/S	4,840	187.750	908,710.000	
	TRYG A/S	26,079	145.700	3,799,710.300	
	PANDORA A/S	8,251	697.800	5,757,547.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	555.200	5,183,347.200	
	AMBU A/S B	14,156	342.000	4,841,352.000	
	ORSTED A/S	15,885	925.600	14,703,156.000	
デンマーク・クローネ 小計		390,814		216,969,088.450 (3,796,959,048)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.695	848,189.070	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	14.640	437,648.160	
	A2 MILK CO LTD	62,165	8.620	535,862.300	
	FISHER & PAYKEL	49,044	33.500	1,642,974.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.480	715,111.040	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.665	411,457.110	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.750	713,931.500	
ニュージーランド・ドル 小計		596,848		5,305,173.180 (411,363,128)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	33,955	208.900	7,093,199.500	
	DNB ASA	80,709	179.600	14,495,336.400	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	55.180	7,120,206.480	
	TELENOR ASA	63,038	150.950	9,515,586.100	
	SCHIBSTED ASA	7,537	409.500	3,086,401.500	
	ORKLA ASA	65,283	82.200	5,366,262.600	
	EQUINOR ASA	81,088	162.400	13,168,691.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	436.100	6,625,667.300	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	194.850	3,250,682.550	
	ADEVINTA ASA	22,265	141.800	3,157,177.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	360.000	2,680,200.000	
ノルウェー・クローネ 小計		522,232		75,559,410.630 (976,227,585)	
ユーロ	CRH PLC	68,853	39.330	2,707,988.490	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,738	170.200	2,338,207.600	
	KERRY GROUP PLC-A	14,113	110.100	1,553,841.300	

KINGSPAN GROUP PLC	13,452	76.240	1,025,580.480	
UMICORE	17,654	47.050	830,620.700	
AIR LIQUIDE	41,123	139.680	5,744,060.640	
AIRBUS SE	51,353	97.940	5,029,512.820	
AXA SA	168,895	23.170	3,913,297.150	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,468	24.770	1,076,702.360	
ADIDAS AG	16,660	269.100	4,483,206.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	16.750	1,634,280.750	
DASSAULT AVIATION SA	295	924.500	272,727.500	
DANONE	54,305	59.250	3,217,571.250	
SAFRAN SA	27,991	117.200	3,280,545.200	
INTESA SANPAOLO	1,437,145	2.245	3,226,390.520	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,325	86.180	2,441,048.500	
ACCOR SA	17,380	33.150	576,147.000	
BOUYGUES	21,417	34.340	735,459.780	
BNP PARIBAS	98,131	50.830	4,987,998.730	
THALES SA	8,486	84.460	716,727.560	
CAPGEMINI SA	14,202	150.000	2,130,300.000	
UNICREDIT SPA	188,437	8.180	1,541,414.660	
NATIXIS	70,166	4.052	284,312.630	
KONINKLIJKE DSM NV	15,326	150.650	2,308,861.900	
COMMERZBANK AG	83,118	4.854	403,454.770	
EIFFAGE	6,848	87.040	596,049.920	
FRESENIUS SE & CO KGAA	36,634	38.260	1,401,616.840	
UNITED INTERNET	9,882	34.040	336,383.280	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	43.620	241,916.520	
PUBLICIS GROUPE	19,879	53.620	1,065,911.980	
FAURECIA	10,774	47.370	510,364.380	
IBERDROLA SA	533,229	11.425	6,092,141.320	
ENI SPA	223,653	10.074	2,253,080.320	
JERONIMO MARTINS	19,517	14.270	278,507.590	
KESKO OYJ-B	24,085	25.980	625,728.300	
KBC GROUPE	21,995	61.720	1,357,531.400	
HANNOVER RUECK SE	4,868	153.250	746,021.000	
WARTSILA OYJ	34,935	8.876	310,083.060	
L'OREAL	21,878	337.600	7,386,012.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	24,215	605.300	14,657,339.500	
GEA GROUP AG	13,284	35.150	466,932.600	
BOLLORE	71,347	4.160	296,803.520	
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.200	528,466.400	
MICHELIN(CGDE)-B	14,568	122.650	1,786,765.200	
CONTINENTAL AG	10,336	111.960	1,157,218.560	
DEUTSCHE POST AG-REG	86,795	47.935	4,160,518.320	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	29.340	622,184.040	
OMV AG	12,817	41.330	529,726.610	
VERBUND AG	4,559	63.150	287,900.850	

PERNOD-RICARD	17,720	171.750	3,043,410.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	13,577	92.500	1,255,872.500	
RENAULT SA	19,019	34.500	656,155.500	
REPSOL SA	135,990	9.850	1,339,501.500	
REMY COINTREAU	1,860	169.300	314,898.000	
MERCK KGAA	10,776	145.750	1,570,602.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,634	52.360	2,337,036.240	
RWE AG	56,755	33.060	1,876,320.300	
SEB SA	2,439	143.100	349,020.900	
SOCIETE GENERALE-A	72,362	21.515	1,556,868.430	
VINCI S.A.	45,541	87.950	4,005,330.950	
SODEXO	7,429	83.000	616,607.000	
SOFINA	1,382	308.200	425,932.400	
SOLVAY SA	7,183	103.600	744,158.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,739	136.140	6,363,047.460	
VIVENDI SA	73,354	28.470	2,088,388.380	
SAP SE	91,062	115.340	10,503,091.080	
TELEFONICA S.A	455,887	3.685	1,679,943.590	
TOTAL SE	220,179	36.860	8,115,797.940	
VALEO	19,653	27.000	530,631.000	
E.ON SE	188,683	10.054	1,897,018.880	
VOEST-ALPINE AG	9,875	36.100	356,487.500	
HENKEL AG & CO KGAA	8,602	82.850	712,675.700	
SIEMENS AG-REG	66,654	140.280	9,350,223.120	
UPM-KYMMENE OYJ	46,882	31.900	1,495,535.800	
ING GROEP NV-CVA	342,398	10.144	3,473,285.310	
PUMA AG	8,844	89.000	787,116.000	
BAYER AG	86,288	54.140	4,671,632.320	
STORA ENSO OYJ-R SHS	51,891	16.280	844,785.480	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,809	94.760	1,498,060.840	
DAIMLER AG	74,820	73.690	5,513,485.800	
BASF SE	79,925	70.970	5,672,277.250	
BEIERSDORF AG	8,371	90.880	760,756.480	
HOCHTIEF AG	1,707	75.300	128,537.100	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,238	77.660	1,028,063.080	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,223	64.040	1,102,960.920	
ASM INTERNATIONAL NV	3,895	248.300	967,128.500	
ORANGE	184,093	10.486	1,930,399.190	
SAMPO OYJ-A SHS	41,326	39.950	1,650,973.700	
RANDSTAD NV	11,017	62.620	689,884.540	
ALLIANZ SE	35,868	215.550	7,731,347.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,662	4.981	1,188,775.420	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,453	22.750	2,217,055.750	
HERMES INTL	2,681	1,010.000	2,707,810.000	

ENDESA S.A.	27,736	22.170	614,907.120	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	10.088	282,363.120	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	28.430	688,119.720	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,250	254.150	3,113,337.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	23.780	1,464,705.320	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,068	190.600	2,109,560.800	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,734	27.220	591,599.480	
HEINEKEN NV	22,683	92.080	2,088,650.640	
AKZO NOBEL	16,929	100.650	1,703,903.850	
ASML HOLDING NV	37,175	512.000	19,033,600.000	
AEGON NV	150,349	3.773	567,266.770	
VOLKSWAGEN AG	2,758	285.600	787,684.800	
VOLKSWAGEN AG PFD	16,309	234.050	3,817,121.450	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	562,809	4.312	2,426,832.400	
KERING	6,618	626.100	4,143,529.800	
CNP ASSURANCES	13,987	16.255	227,358.680	
FORTUM OYJ	39,409	22.460	885,126.140	
AGEAS	14,365	50.700	728,305.500	
UCB SA	10,571	81.920	865,976.320	
NEMETSCHKE SE	5,095	58.920	300,197.400	
CARREFOUR SA	53,060	15.095	800,940.700	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	20.820	491,601.840	
ATOS SE	8,972	57.780	518,402.160	
NOKIA OYJ	472,892	3.469	1,640,462.340	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	79,616	49.500	3,940,992.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	23,736	76.880	1,824,823.680	
SANOFI	98,989	86.060	8,518,993.340	
STMICROELECTRONICS NV	53,224	30.720	1,635,041.280	
ELISA OYJ	13,642	48.500	661,637.000	
BANCO SANTANDER SA	1,518,626	2.851	4,329,602.720	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	15.115	717,252.090	
QIAGEN N.V.	20,763	43.260	898,207.380	
DEUTSCHE BANK AG-REG	171,364	9.965	1,707,642.260	
BMW VORZUG	4,116	67.950	279,682.200	
ENEL SPA	708,368	8.555	6,060,088.240	
COLRUYT NV	4,673	49.660	232,061.180	
VOPAK (KON.)	5,364	41.490	222,552.360	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	289,776	16.048	4,650,325.240	
SARTORIUS AG	3,044	468.000	1,424,592.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	64.940	499,128.840	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	114,735	33.235	3,813,217.720	
RATIONAL AG	479	668.200	320,067.800	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	145.050	546,983.550	
BECHTLE AG	2,511	168.450	422,977.950	
KONINKLIJKE KPN NV	288,984	2.705	781,701.720	

EUROFINS SCIENTIFIC	11,330	87.640	992,961.200	
TELEPERFORMANCE	5,201	332.300	1,728,292.300	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,538	147.350	2,436,874.300	
EURAZEO	3,007	68.050	204,626.350	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	90.580	897,104.320	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	79.300	793,317.200	
INDITEX	92,169	27.870	2,568,750.030	
ESSILORLUXOTTICA	25,073	139.160	3,489,158.680	
SNAM SPA	171,294	4.665	799,086.510	
CREDIT AGRICOLE SA	95,281	12.224	1,164,714.940	
ORPEA	4,932	107.800	531,669.600	
ENAGAS	23,477	18.005	422,703.380	
WENDEL	2,220	109.600	243,312.000	
TENARIS SA	36,959	8.822	326,052.290	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.430	327,950.250	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.462	229,889.350	
ATLANTIA SPA	45,299	16.190	733,390.810	
ILIAD SA	1,046	156.600	163,803.600	
PROXIMUS	13,739	18.625	255,888.870	
SES FDR	28,847	6.368	183,697.690	
TERNA SPA	126,172	6.140	774,696.080	
BIOMERIEUX	3,248	111.500	362,152.000	
GRIFOLS SA	23,518	22.940	539,502.920	
FERROVIAL SA	38,400	21.800	837,120.000	
LANXESS AG	6,856	60.460	414,513.760	
NESTE OYJ	36,796	49.960	1,838,328.160	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	17.860	319,890.460	
RECORDATI SPA	10,303	45.950	473,422.850	
GALAPAGOS NV	3,426	65.500	224,403.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	9.838	544,080.750	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,873	192.250	936,834.250	
KONE OYJ	29,890	71.960	2,150,884.400	
ELIA GROUP	2,862	92.200	263,876.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	383.700	915,891.900	
ENGIE	153,403	12.172	1,867,221.310	
ALSTOM	21,741	44.890	975,953.490	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	11.825	647,749.850	
IPSEN SA	3,646	78.080	284,679.680	
DEUTSCHE WOHNEN	29,812	45.880	1,367,774.560	
ARKEMA SA	6,393	104.200	666,150.600	
LEGRAND SA	23,806	83.020	1,976,374.120	
AMPLIFON SPA	11,372	35.530	404,047.160	
ADP	2,313	101.050	233,728.650	
ORION OYJ	8,051	35.850	288,628.350	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	9.306	373,058.920	

SYMRISE AG	11,308	109.400	1,237,095.200	
SCOR SE	15,667	28.170	441,339.390	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,870	41.000	855,670.000	
PRYSMIAN SPA	22,328	26.140	583,653.920	
DIASORIN SPA	2,223	155.900	346,565.700	
CAIXABANK	394,299	2.499	985,353.200	
BUREAU VERITAS SA	29,810	24.900	742,269.000	
GETLINK	37,646	13.055	491,468.530	
SUEZ SA	26,620	19.965	531,468.300	
AMADEUS IT GROUP SA	37,851	56.140	2,124,955.140	
BRENTAG SE	14,044	75.740	1,063,692.560	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	29.890	511,597.240	
EDENRED	21,488	46.250	993,820.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.308	227,072.580	
LEG IMMOBILIEN SE	6,537	119.600	781,825.200	
KION GROUP AG	5,903	81.980	483,927.940	
VONOVIA SE	46,966	57.240	2,688,333.840	
KNORR-BREMSE AG	6,860	102.550	703,493.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,805	46.950	1,117,644.750	
FERRARI NV	10,525	172.850	1,819,246.250	
CNH INDUSTRIAL NV	89,378	12.425	1,110,521.650	
AROUNDTOWN SA	83,054	6.332	525,897.920	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	41.710	337,517.320	
MONCLER SPA	17,567	50.220	882,214.740	
NEXI SPA	34,862	14.905	519,618.110	
TEAMVIEWER AG	13,668	37.630	514,326.840	
PROSUS NV	42,762	92.460	3,953,774.520	
JDE PEET'S BV	7,308	31.750	232,029.000	
SIEMENS ENERGY AG	35,831	27.890	999,326.590	
WORLDLINE SA	21,160	74.750	1,581,710.000	
NN GROUP NV	24,900	41.690	1,038,081.000	
FINECOBANK SPA	53,818	13.920	749,146.560	
ARGENX SE	3,705	227.900	844,369.500	
ZALANDO SE	13,525	88.320	1,194,528.000	
STELLANTIS NV	172,385	14.194	2,446,832.690	
AENA SME SA	6,256	134.700	842,683.200	
CELLNEX TELECOM SAU	38,983	45.970	1,792,048.510	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	92.080	997,778.880	
ABN AMRO BANK NV	34,251	10.376	355,388.370	
EXOR NV	9,966	69.480	692,437.680	
SCOUT24 AG	9,670	68.340	660,847.800	
COVESTRO AG	16,337	54.820	895,594.340	
HELLOFRESH SE	12,838	74.000	950,012.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	66,475	55.730	3,704,651.750	
POSTE ITALIANE SPA	38,953	10.615	413,486.090	
AMUNDI SA	5,924	73.750	436,895.000	

	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.306	217,239.260	
	ADYEN NV	1,605	1,981.000	3,179,505.000	
	UNIPER SE	18,203	30.160	549,002.480	
	DELIVERY HERO SE	11,565	128.750	1,488,993.750	
ユーロ 小計		16,338,141		396,294,634.630 (51,561,894,912)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	100.500	3,306,450.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	21.350	3,501,400.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.900	1,755,234.000	
	CLP HOLDINGS LTD	135,000	76.800	10,368,000.000	
	PCCW LTD	331,000	4.580	1,515,980.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	47.900	2,371,050.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	105,940	486.800	51,571,592.000	
	MTR CORP	126,000	44.000	5,544,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	152.800	10,038,960.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	35.300	4,075,385.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	103,500	47.350	4,900,725.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	914,292	12.460	11,392,078.320	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	197,000	69.550	13,701,350.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	27.700	8,794,750.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	120,066	42.750	5,132,821.500	
	SINO LAND CO	255,400	11.480	2,931,992.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,500	119.800	14,435,900.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	61.650	3,051,675.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	121,000	139.900	16,927,900.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	25.600	4,249,600.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	10.220	1,594,320.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	15.080	1,875,952.000	
	AIA GROUP LTD	1,058,227	98.050	103,759,157.350	
	HKT TRUST / HKT LTD	262,000	11.260	2,950,120.000	
	SANDS CHINA LTD	211,200	37.750	7,972,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.800	2,479,960.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	45.200	6,768,700.000	
	ESR CAYMAN LTD	147,400	26.000	3,832,400.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.720	1,775,600.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	24.550	3,697,230.000	
	WH GROUP LTD	897,000	6.720	6,027,840.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	242,332	64.900	15,727,346.800	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	48.750	10,960,560.000	
香港・ドル	小計	7,552,049		348,988,828.970 (4,857,924,499)	
合計		95,124,608		476,209,775,082 (476,209,775,082)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年4月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	81,526.000	834,010.980		
		GOODMAN GROUP	148,357.000	2,846,970.830		
		GPT GROUP	158,232.000	724,702.560		
		MIRVAC GROUP	329,418.000	836,721.720		
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,324,732.500		
		STOCKLAND	194,018.000	875,021.180		
		VICINITY CENTRES	371,711.000	598,454.710		
		オーストラリア・ドル 小計		1,768,512.000	8,040,614.480 (671,552,122)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	901,226.480		
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	369,636.000	805,806.480		
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	407,676.000		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	534,798.000		
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	299,676.000		
		シンガポール・ドル 小計		1,316,742.000	2,949,182.960 (239,827,558)	
	投資信託受益証券	合計		3,085,254	911,379,680 (911,379,680)	
	投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	797,204.960	
			ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,124.000	1,993,865.760	
AMERICAN TOWER CORP			38,783.000	9,799,300.610		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT			127,559.000	1,117,416.840		
AVALONBAY COMMUNITIES INC			12,329.000	2,375,551.720		
BOSTON PROPERTIES INC			12,947.000	1,374,065.110		
CAMDEN PROPERTY TRUST			8,873.000	1,060,234.770		
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP			37,704.000	6,899,832.000		
DIGITAL REALTY TRUST INC			23,841.000	3,598,560.540		
DUKE REALTY TRUST			31,929.000	1,462,028.910		
EQUINIX INC			7,807.000	5,669,599.540		

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,554.000	1,064,826.840	
	EQUITY RESIDENTIAL	32,922.000	2,439,190.980	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,750.000	1,695,502.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	11,470.000	1,679,093.300	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	46,799.000	1,593,505.950	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,083,346.880	
	INVITATION HOMES INC	50,074.000	1,701,514.520	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	971,098.590	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,195,745.980	
	MID AMERICA	10,200.000	1,577,838.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	758,410.350	
	PROLOGIS INC	64,584.000	7,411,014.000	
	PUBLIC STORAGE	13,279.000	3,630,080.230	
	REALTY INCOME CORP	30,906.000	2,119,842.540	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	871,824.870	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,838.000	2,872,892.760	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,753.000	3,285,317.780	
	SUN COMMUNITIES INC	9,670.000	1,563,348.900	
	UDR INC	26,674.000	1,222,202.680	
	VENTAS INC	30,905.000	1,714,609.400	
	VEREIT INC	19,960.000	824,547.600	
	VICI PROPERTIES INC	48,258.000	1,454,978.700	
	VORNADO REALTY TRUST	13,610.000	605,372.800	
	WELLTOWER INC	36,680.000	2,792,081.600	
	WEYERHAEUSER CO	62,330.000	2,392,225.400	
	WP CAREY INC	15,529.000	1,144,642.590	
アメリカ・ドル	小計	1,119,617.000	85,812,716.500 (9,274,638,400)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	356,076.900	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	399,277.450	
	SEGRO PLC	100,188.000	1,006,388.460	
イギリス・ポンド	小計	225,850.000	1,761,742.810 (265,388,937)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	458,018.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	275,534.820	
	小計	21,687.000	733,553.220 (62,880,182)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	364,739.860	
	GECINA SA	3,670.000	455,814.000	
	KLEPIERRE	17,099.000	369,509.390	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	880,239.600	
ユーロ	小計	38,352.000	2,070,302.850	

				(269,367,104)	
	香港・ドル	LINK REIT	183,000.000	13,651,800.000	
	香港・ドル	小計	183,000.000	13,651,800.000	(190,033,056)
投資証券	合計		1,588,506	10,062,307,679	(10,062,307,679)
合計				10,973,687,359	(10,973,687,359)

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

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 591銘柄	68.49	-	-	72.20
	投資証券 37銘柄	-	-	1.85	
イギリス・ポンド	株式 85銘柄	4.48	-	-	4.65
	投資証券 3銘柄	-	-	0.05	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	2.13	-	-	2.33
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.34	-	-	3.44
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.30	-	-	0.35
	投資信託受益証券 5銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.92	-	-	3.00
スウェーデン・クローナ	株式 38銘柄	1.15	-	-	1.18
デンマーク・クローネ	株式 19銘柄	0.76	-	-	0.78
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08	-	-	0.08
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.20	-	-	0.20
ユーロ	株式 233銘柄	10.31	-	-	10.64
	投資証券 4銘柄	-	-	0.05	
香港・ドル	株式 33銘柄	0.97	-	-	1.04
	投資証券 1銘柄	-	-	0.04	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(2021年4月22日から2021年10月21日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2021年4月21日現在	第6期中間計算期間末 2021年10月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,129,936	4,199,525
親投資信託受益証券	1,146,191,394	2,072,157,107
未収入金	-	1,918,000
流動資産合計	1,148,321,330	2,078,274,632
資産合計	1,148,321,330	2,078,274,632
負債の部		
流動負債		
未払解約金	870,856	3,880,704
未払受託者報酬	126,431	221,323
未払委託者報酬	885,290	1,549,491
その他未払費用	16,105	28,248
流動負債合計	1,898,682	5,679,766
負債合計	1,898,682	5,679,766
純資産の部		
元本等		
元本	537,508,180	840,479,443
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	608,914,468	1,232,115,423
(分配準備積立金)	216,320,926	188,581,716
元本等合計	1,146,422,648	2,072,594,866
純資産合計	1,146,422,648	2,072,594,866
負債純資産合計	1,148,321,330	2,078,274,632

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間 自 2020年4月22日 至 2020年10月21日	第6期中間計算期間 自 2021年4月22日 至 2021年10月21日
営業収益		
受取利息	-	8
有価証券売買等損益	77,120,905	241,906,713
営業収益合計	77,120,905	241,906,721
営業費用		
支払利息	696	455
受託者報酬	59,110	221,323
委託者報酬	414,120	1,549,491
その他費用	7,588	28,248
営業費用合計	481,514	1,799,517
営業利益又は営業損失()	76,639,391	240,107,204
経常利益又は経常損失()	76,639,391	240,107,204
中間純利益又は中間純損失()	76,639,391	240,107,204
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	27,481,343	11,240,275
期首剰余金又は期首欠損金()	173,489,653	608,914,468
剰余金増加額又は欠損金減少額	93,059,192	501,597,431
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	93,059,192	501,597,431
剰余金減少額又は欠損金増加額	125,776,043	107,263,405
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	125,776,043	107,263,405
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	189,930,850	1,232,115,423

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自 2021年4月22日 至 2021年10月21日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2021年4月21日現在	2021年10月21日現在
1. 期首元本額	409,999,303円	537,508,180円
期中追加設定元本額	509,401,934円	395,673,259円
期中一部解約元本額	381,893,057円	92,701,996円
2. 受益権の総数	537,508,180口	840,479,443口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2021年4月21日現在	2021年10月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2021年4月21日現在	第6期中間計算期間末 2021年10月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,1328円 (21,328円)	2,4660円 (24,660円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年10月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,089,617,528
コール・ローン	437,014,826
株式	646,987,427,376
投資信託受益証券	1,198,578,959
投資証券	13,847,703,424
派生商品評価勘定	229,730,577
未収配当金	364,638,462
差入委託証拠金	4,285,836,593
流動資産合計	673,440,547,745
資産合計	
673,440,547,745	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,906,737
未払金	27,509,428
未払解約金	142,263,000
流動負債合計	172,679,165
負債合計	
172,679,165	
純資産の部	
元本等	
元本	115,081,211,269
剰余金	
剰余金又は欠損金()	558,186,657,311
元本等合計	673,267,868,580
純資産合計	
673,267,868,580	
負債純資産合計	
673,440,547,745	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年4月22日 至 2021年10月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 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>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月21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	98,928,018,263円
同期中追加設定元本額	48,603,846,541円
同期中一部解約元本額	32,450,653,535円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	2,913,500,070円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,409,456円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,653,128円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	19,444,195円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,432,232円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,638,726円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,620,599円
たわらノーロード 先進国株式	26,120,195,999円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	354,190,672円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,665,929,157円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	525,147,861円
たわらノーロード バランス(堅実型)	61,502,697円
たわらノーロード バランス(標準型)	483,980,140円
たわらノーロード バランス(積極型)	591,319,711円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	854,350円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	142,576,140円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	397,800,859円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	297,174,851円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	446,881,256円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	772,296円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	12,167,203円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,080,138円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,209,405円
たわらノーロード 全世界株式	145,506,084円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	49,002,407,146円
One DC 先進国株式インデックスファンド	1,460,847,241円
Oneグローバルバランス	630,466円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	156,714,381円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	787,980,968円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,012,139,026円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	97,901,357円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	289,700,219円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	259,254,215円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,636,202円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	680,759,907円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	131,955,592円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	179,258,650円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,757,741円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	299,843,655円
投資のソムリエ	9,203,020,806円
クルーズコントロール	168,104,278円
投資のソムリエ<DC年金>	471,170,231円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,832,227円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	132,787,421円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,412,929円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,429,742円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	335,946,091円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,136,429,447円
ワールドアセットバランス(基本コース)	238,457,825円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	724,972,053円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	24,791,796円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,845,284円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,322,217円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	61,660,753円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	91,231,999円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,524,530,008円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	157,090,725円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	19,465,444円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,401,075円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,647,277円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	19,699,601円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	98,963円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	165,689円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	103,336円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	10,539,464円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	99,264円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	151,000円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04(適格機関投資家限定)	3,690,925円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	174,612,383円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	115,277円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	994,745,611円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	58,901,005円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,193,892,891円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,191,153,970円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,072,474,270円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	248,972,761円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	8,753,329円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	313,860円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,268,106円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	35,029,763円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	58,882,175円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,483,288円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,705,815円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,201,915円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	779,203円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,998,271円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,373,178円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	227,094,737円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	335,860,444円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,094,743,924円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	104,639,860円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	57,546,213円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	361,595,071円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	15,170,684円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,132,817円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	140,551,535円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	12,755,643円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	43,049,973円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	68,259,271円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	160,280,718円
計	115,081,211,269円
2. 受益権の総数	115,081,211,269口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月21日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)	うち		
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	41,419,291	-	41,423,645	4,354
ユーロ	41,419,291	-	41,423,645	4,354
買建	513,513,214	-	512,956,580	556,634
アメリカ・ドル	441,193,520	-	440,653,391	540,129
イギリス・ポンド	26,866,600	-	26,854,139	12,461
オーストラリア・ドル	12,975,972	-	12,988,718	12,746
カナダ・ドル	21,804,482	-	21,805,028	546
ユーロ	10,672,640	-	10,655,304	17,336
合計	554,932,505	-	554,380,225	560,988

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2021年10月21日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	11,261,569,773	-		11,488,954,601	227,384,828
合計	11,261,569,773	-		11,488,954,601	227,384,828

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年10月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		5.8504円 (58,504円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年10月29日現在

資産総額	2,091,084,244円
負債総額	7,553,811円
純資産総額(-)	2,083,530,433円
発行済数量	840,073,905口
1口当たり純資産額(/)	2.4802円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	679,652,173,492円
負債総額	101,088,264円
純資産総額(-)	679,551,085,228円
発行済数量	115,483,851,488口
1口当たり純資産額(/)	5.8844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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2021年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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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的主要原因別の内訳

	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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（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
楽天証券株式会社	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。

(注)資本金の額は2020年12月31日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2)信託財産の計算
- (3)信託財産に関する報告書の作成
- (4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) 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6月4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 丘本正彦 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>の2020年4月22日から2021年4月21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、たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>の2021年4月21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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11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 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>の2021年4月22日から2021年10月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>の2021年10月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年4月22日から2021年10月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。