

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長殿
【提出日】 2022年5月13日提出
【計算期間】 第20期(自 2021年2月16日 至 2022年2月15日)
【ファンド名】 D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>
【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】 酒井 隆
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】 03-6774-5100
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

当ファンドの信託金の限度額は、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>

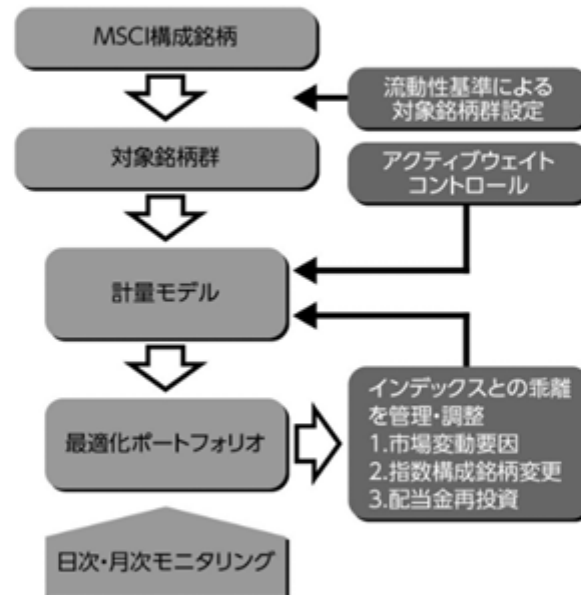
- 1 主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドに投資を行い、「MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
-

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

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

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

2 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、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。



3 株式への実質投資割合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。

4 実質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。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日。))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

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 年4回	グローバル (日本を除く) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	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 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	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					

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。

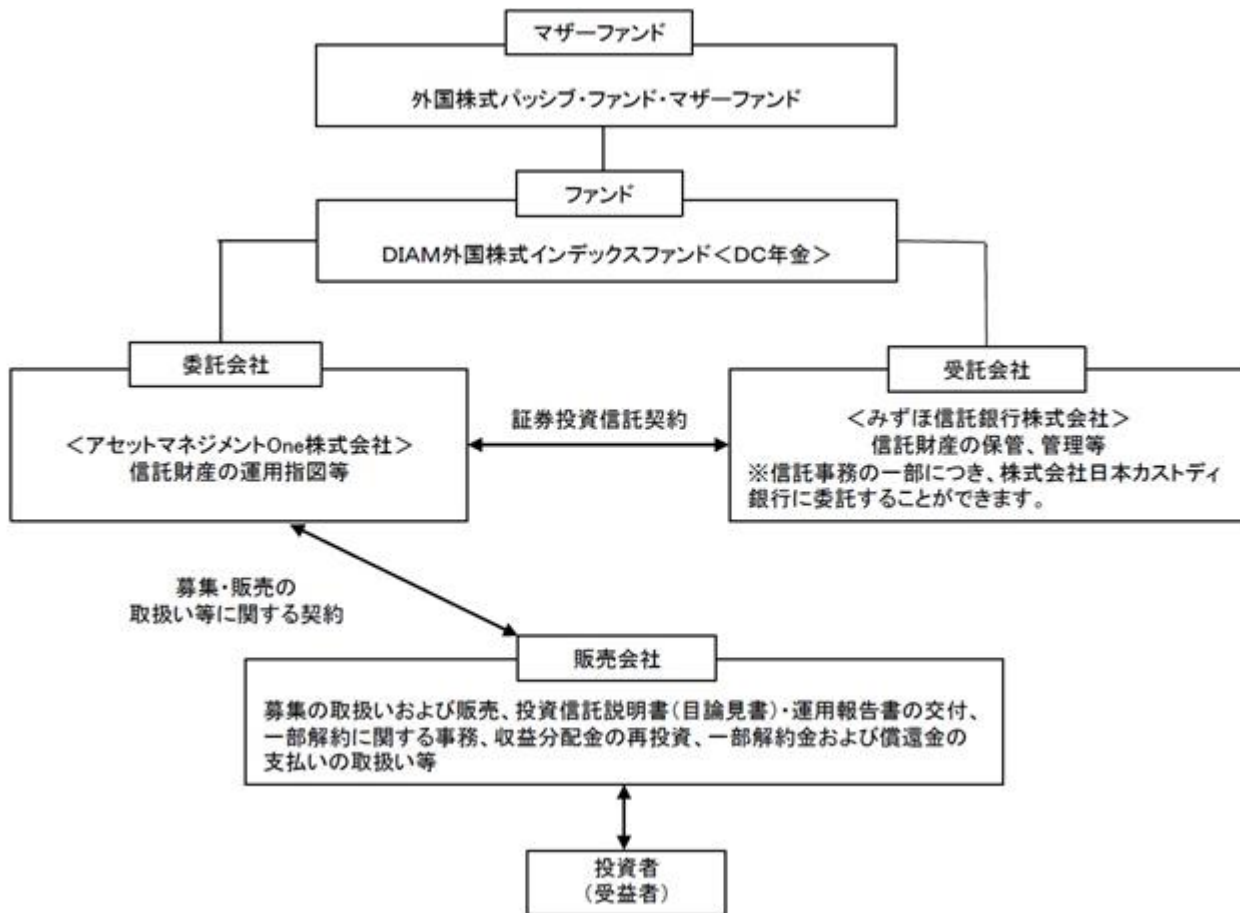
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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】

2002年9月5日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(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、当ファンドの設定時に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、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

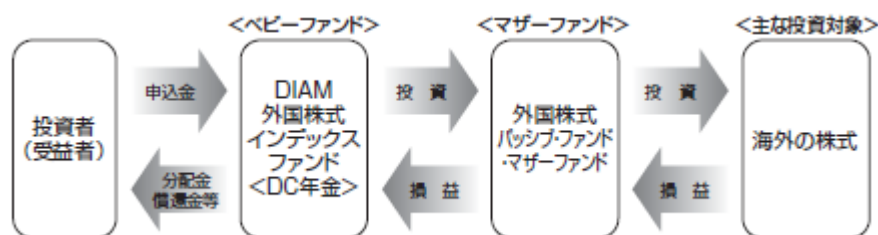
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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（2022年2月28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ルリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（2022年2月28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、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

<投資対象>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

- 1)主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2)株式への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3)実質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。

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

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類(約款第15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。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(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21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲(約款第16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外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの受益証券のほか、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

2) 国債証券

3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)~11)の証券または証書の性質を有するもの
- 13) 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。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 19) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1)、12)ならびに15)の証券または証書のうち1)の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および12)ならびに15)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

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

4. 金融商品の指図範囲(約款第16条第3項)

上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2022年2月28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2月15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分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益(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ことがあります。

3) 留保益の運用方針

留保金の運用については、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

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

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

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補

填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 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。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、別に定める契約に基づき、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販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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】

1) 株式への実質投資割合(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。

2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。

3) 同一銘柄の転換社債等への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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。)への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。

4) 外貨建資産への実質投資割合(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。

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

6) 投資する株式等の範囲(約款第18条)

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

- b. 上記a.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。

7) 信用取引の指図範囲(約款第20条)

- a. 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。
- b. 上記a.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. 売り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(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

8) 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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・オプションの売付けの指図は、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・オプションの売付けの指図は、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。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券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3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している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上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している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、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。
- b. 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、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに別に定める外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲内で行な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、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)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・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、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。
- c. 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、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行な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・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、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・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。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け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・オプションの買付けの指図は、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、かつ本項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。

9) スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- b. 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。
- c. 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(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)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、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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。
- d. 上記c.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。
- e. 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基に算出した価額で評価するものとします。
- f. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

- b. 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、原則として当該ファンドの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。
 - c. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価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、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。
 - d. 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が、信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価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、上記ヘッジ対象外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総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。
 - e. 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。
 - f. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)
- 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。
- 12) 有価証券の貸付けの指図および範囲(約款第24条)
- a. 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)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付は、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。
 - b. 上記a. 1)~2)で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。
 - c. 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、担保の受入の指図を行うものとします。
- 13) 特別の場合の外貨建資産への投資制限(約款第25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。
- 14) 外貨為替予約の指図(約款第26条)
- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
 - b. 上記a.の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、原則として信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- c. 上記b.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。

15) 資金の借入れ(約款第33条)

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

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

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

当ファンドでは実質的に株式に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

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。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に大きく影響します。

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ある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてMSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流出入から組入株式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)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及ぼす場合があります。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、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。

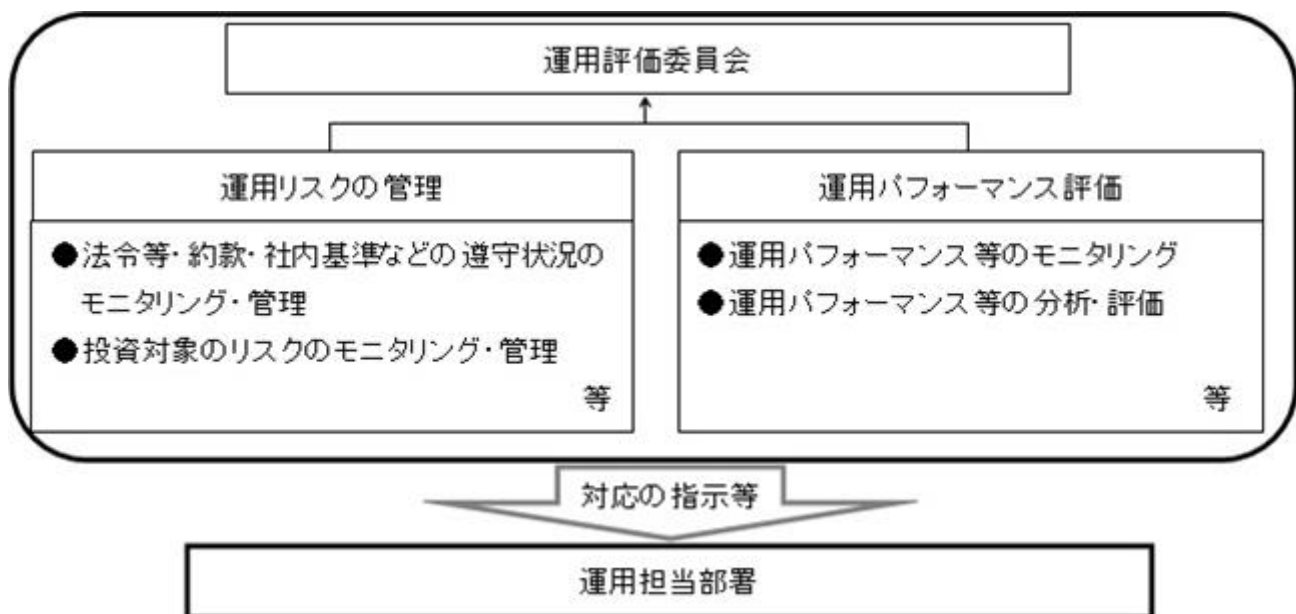
注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券（外貨建資産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ますが、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。



- ・流動性リスク管理：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。

リスク管理体制は2022年2月28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>

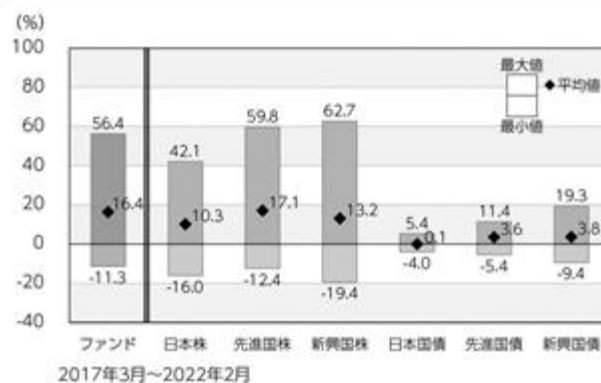
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)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・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPX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。

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0.275%(税抜0.25%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.11%	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0.11%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

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、毎年8月15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】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. 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、毎年8月15日(休業日の場合は翌営業日とします。)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。

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

上記は、2022年2月末現在のものであります。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】

2022年2月28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	287,443,519,840	100.00
内 日本	287,443,519,840	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,300,139	0.00
純資産総額	287,449,819,979	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

2022年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	592,552,662,644	95.45
内 アメリカ	416,438,059,651	67.08
内 イギリス	26,209,536,059	4.22
内 カナダ	22,824,416,003	3.68
内 スイス	20,315,774,721	3.27
内 フランス	19,070,019,535	3.07
内 ドイツ	15,333,303,512	2.47
内 オーストラリア	12,182,685,390	1.96
内 オランダ	11,260,201,019	1.81
内 アイルランド	10,855,903,101	1.75
内 スウェーデン	5,895,817,786	0.95
内 デンマーク	4,579,080,595	0.74
内 スペイン	4,321,687,789	0.70
内 香港	3,976,716,246	0.64
内 イタリア	3,386,812,412	0.55
内 ジャージー	2,420,457,282	0.39
内 フィンランド	2,142,851,519	0.35
内 シンガポール	1,867,175,232	0.30
内 ベルギー	1,510,263,148	0.24
内 バミューダ	1,321,108,573	0.21
内 ノルウェー	1,302,764,636	0.21
内 イスラエル	1,300,165,465	0.21
内 ケイマン諸島	1,127,656,340	0.18
内 オランダ領キュラソー	622,474,239	0.10
内 ルクセンブルグ	552,963,103	0.09
内 ニュージーランド	498,693,686	0.08
内 オーストリア	417,334,880	0.07
内 ボルトガル	277,706,180	0.04
内 リベリア	206,073,940	0.03
内 パナマ	186,032,287	0.03
内 マン島	148,928,315	0.02
投資信託受益証券	1,071,208,054	0.17
内 オーストラリア	811,612,708	0.13
内 シンガポール	259,595,346	0.04
投資証券	12,944,248,713	2.09

内 アメリカ	12,006,840,783	1.93
内 イギリス	391,392,871	0.06
内 フランス	288,034,517	0.05
内 香港	187,551,250	0.03
内 カナダ	70,429,292	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,208,110,420	2.29
純資産総額	620,776,229,831	100.00

その他資産の投資状況

2022年2月28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)	12,708,486,958	2.05
内 アメリカ	9,514,849,200	1.53
内 ドイツ	1,829,198,063	0.29
内 イギリス	576,003,725	0.09
内 カナダ	485,685,060	0.08
内 オーストラリア	302,750,910	0.05

(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】

2022年2月28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	51,009,479,839	5.6820 289,836,664,995	5.6351 287,443,519,840	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年2月28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	1,610,699	19,514.08 31,431,315,584	19,048.41 30,681,267,018	- -	4.94
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	695,786	34,087.24 23,717,431,328	34,354.17 23,903,150,875	- -	3.85
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	44,406	358,590.93 15,923,589,148	355,405.22 15,782,124,354	- -	2.54
4	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	29,314	313,200.58 9,181,161,978	310,735.90 9,108,912,304	- -	1.47
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	28,094	312,678.29 8,784,384,160	310,874.56 8,733,710,015	- -	1.41
6	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	81,966	101,194.06 8,294,472,977	93,580.47 7,670,417,500	- -	1.24
7	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	243,372	28,040.51 6,824,277,068	27,913.41 6,793,343,270	- -	1.09
8	META PLATFORMS 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	232,143	25,155.23 5,839,611,718	24,320.96 5,645,941,545	- -	0.91
9	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	92,002	54,816.91 5,043,266,273	54,972.91 5,057,617,895	- -	0.81
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	291,379	17,620.21 5,134,161,937	17,097.93 4,981,978,765	- -	0.80
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	256,927	19,135.07 4,916,318,699	19,181.29 4,928,193,865	- -	0.79

12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	129,271	36,315.05 4,694,483,345	36,888.18 4,768,572,175	- -	0.77
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	236,930	18,111.30 4,291,111,967	18,284.63 4,332,177,859	- -	0.70
14	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	164,441	26,038.03 4,281,720,842	25,336.64 4,166,383,815	- -	0.67
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	274,536	14,646.07 4,020,875,669	14,795.90 4,062,009,947	- -	0.65
16	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	738,433	5,479.38 4,046,155,749	5,202.06 3,841,373,510	- -	0.62
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	102,830	40,622.75 4,177,238,205	36,588.90 3,762,437,358	- -	0.61
18	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	412,707	9,126.13 3,766,421,448	8,994.41 3,712,056,793	- -	0.60
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	85,846	43,234.18 3,711,482,103	42,648.34 3,661,190,211	- -	0.59
20	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	40,314	72,391.59 2,918,394,881	76,194.19 3,071,692,736	- -	0.49
21	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	188,645	15,792.21 2,979,123,058	16,220.90 3,059,993,378	- -	0.49
22	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	176,779	17,430.71 3,081,384,808	17,278.19 3,054,421,415	- -	0.49
23	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	546,072	5,754.38 3,142,311,256	5,514.04 3,011,066,127	- -	0.49
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	172,156	16,523.64 2,844,645,489	17,279.34 2,974,743,262	- -	0.48
25	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	68,016	42,727.09 2,906,125,889	43,626.08 2,967,271,729	- -	0.48
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	400,562	7,011.57 2,808,570,104	7,262.31 2,909,008,422	- -	0.47
27	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	39,894	66,854.91 2,667,110,138	67,944.55 2,710,580,097	- -	0.44
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	410,704	6,144.94 2,523,755,134	6,475.42 2,659,481,717	- -	0.43

29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	134,924	19,262.18 2,598,931,048	19,456.30 2,625,123,035	- -	0.42
30	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生 活必需品 小売り	42,990	58,533.00 2,516,334,013	59,795.96 2,570,628,728	- -	0.41

(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

2022年2月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.45
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.09
合計	97.71

(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

2022年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.26
銀行		6.31
コンピュータ・周辺機器		5.21
半導体・半導体製造装置		4.90
医薬品		4.74
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.09
石油・ガス・消耗燃料		3.94
情報技術サービス		3.79
資本市場		3.19
保険		3.05
インターネット販売・通信販売		2.93
ヘルスケア機器・用品		2.47
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.13
化学		2.01
自動車		1.96
ホテル・レストラン・レジャー		1.79
電力		1.68
飲料		1.67
バイオテクノロジー		1.66
専門小売り		1.59
機械		1.59
金属・鉱業		1.59
食品		1.58
航空宇宙・防衛		1.48
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.44
食品・生活必需品小売り		1.44
繊維・アパレル・贅沢品		1.40
各種電気通信サービス		1.26
娯楽		1.21
家庭用品		1.15

陸運・鉄道	1.07
各種金融サービス	1.02
コングロマリット	1.01
メディア	0.95
総合公益事業	0.85
電気設備	0.80
専門サービス	0.75
タバコ	0.71
通信機器	0.69
航空貨物・物流サービス	0.59
パーソナル用品	0.56
電子装置・機器・部品	0.56
建設関連製品	0.55
消費者金融	0.53
複合小売り	0.45
商業サービス・用品	0.41
不動産管理・開発	0.40
商社・流通業	0.33
家庭用耐久財	0.31
無線通信サービス	0.28
容器・包装	0.28
建設資材	0.24
自動車部品	0.22
建設・土木	0.21
エネルギー設備・サービス	0.21
ガス	0.14
運送インフラ	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
紙製品・林産品	0.11
水道	0.11
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	0.09
旅客航空輸送業	0.06
レジャー用品	0.04
各種消費者サービス	0.01
合計	95.45

(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

2022年2月28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 Mar22	買建	376	9,550,505,041	9,514,849,200	1.53
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar22	買建	357	1,875,805,086	1,829,198,063	0.29
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar22	買建	50	578,180,984	576,003,725	0.09
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar22	買建	21	490,401,152	485,685,060	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Mar22	買建	21	311,356,972	302,750,910	0.05

(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（2022年2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11計算期間末 (2013年2月15日)	60,080	60,080	1.7592	1.7592
第12計算期間末 (2014年2月17日)	75,426	75,426	2.3012	2.3012
第13計算期間末 (2015年2月16日)	98,769	98,769	2.9168	2.9168
第14計算期間末 (2016年2月15日)	82,214	82,214	2.4126	2.4126
第15計算期間末 (2017年2月15日)	107,765	107,765	3.0461	3.0461
第16計算期間末 (2018年2月15日)	123,694	123,694	3.3421	3.3421
第17計算期間末 (2019年2月15日)	139,504	139,504	3.4447	3.4447
第18計算期間末 (2020年2月17日)	177,764	177,764	4.1731	4.1731
第19計算期間末 (2021年2月15日)	219,795	219,795	4.6863	4.6863
第20計算期間末 (2022年2月15日)	290,585	290,585	5.6398	5.6398
2021年2月末日	217,486	-	4.6280	-
3月末日	235,376	-	4.9372	-
4月末日	248,396	-	5.1677	-
5月末日	253,766	-	5.2420	-

6月末日	263,645	-	5.3716	-
7月末日	267,555	-	5.4463	-
8月末日	275,759	-	5.5791	-
9月末日	269,373	-	5.4479	-
10月末日	290,316	-	5.8455	-
11月末日	293,795	-	5.8218	-
12月末日	308,147	-	6.0578	-
2022年1月末日	289,159	-	5.6321	-
2月末日	287,449	-	5.5927	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第11計算期間	35.2
第12計算期間	30.8
第13計算期間	26.8
第14計算期間	17.3
第15計算期間	26.3
第16計算期間	9.7
第17計算期間	3.1
第18計算期間	21.1
第19計算期間	12.3
第20計算期間	20.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第11計算期間	8,170,299,501	6,081,641,525
第12計算期間	8,496,275,034	9,870,472,114
第13計算期間	8,954,460,215	7,869,839,615
第14計算期間	7,855,082,565	7,640,340,280
第15計算期間	7,253,514,984	5,952,570,108
第16計算期間	8,373,163,615	6,739,828,907
第17計算期間	9,162,101,369	5,674,741,976
第18計算期間	10,301,449,476	8,202,787,502
第19計算期間	17,622,141,763	13,317,487,000
第20計算期間	16,069,850,899	11,447,537,038

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2022年2月28日

基準価額・純資産の推移 (2012年2月29日～2022年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

(設定日:2002年9月5日)

分配の推移(税引前)

年月	分配金 (円)
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	95.45
内 アメリカ	67.08
内 イギリス	4.22
内 カナダ	3.68
内 スイス	3.27
内 フランス	3.07
内 その他	14.13
投資信託受益証券	0.17
内 オーストラリア	0.13
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.09
内 アメリカ	1.93
内 イギリス	0.06
内 フランス	0.05
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)	2.29
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	4.94
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.85
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.54
4	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	1.47
5	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	1.41
6	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.24
7	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.09
8	META PLATFORMS 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	0.91
9	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	0.81
10	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.80

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)	2.05

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	ソフトウェア	7.26
2	銀行	6.31
3	コンピュータ・周辺機器	5.21
4	半導体・半導体製造装置	4.90
5	医薬品	4.74

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。

※2022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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度による取得のみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
なお、ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所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。）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販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込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、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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。委託会社は、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（発行価格）

- ・お申込日の翌営業日の基準価額 とします。
収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。
「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たり換算した基準価額で表示することがあります。）

- ・基準価額は、当ファンドの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）

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

お申込手数料

ありません。

払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この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。

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、解約の請求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。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の実行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6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、委託会社にて計算されます。

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2002年9月5日から無期限です。ただし、下記(5)イ.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2月16日から翌年2月15日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、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。

(5)【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、受益権の口数が10億口を下回る事となった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.～f.の規定は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d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 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。
- i. 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、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、

下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- j. 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、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」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記 d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

- 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、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は上記a.のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定にしたがいます。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

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2月15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】

収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

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

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、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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。

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20期計算期間(2021年2月16日から2022年2月15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】

【DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 2021年2月15日現在	第20期 2022年2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,093,845,713	857,055,381
親投資信託受益証券	219,790,752,741	290,580,216,195
流動資産合計	220,884,598,454	291,437,271,576
資産合計	220,884,598,454	291,437,271,576
負債の部		
流動負債		
未払解約金	821,116,193	453,454,392
未払受託者報酬	31,913,403	47,552,925
未払委託者報酬	234,031,917	348,721,701
その他未払費用	1,858,796	1,941,264
流動負債合計	1,088,920,309	851,670,282
負債合計	1,088,920,309	851,670,282
純資産の部		
元本等		
元本	46,902,032,882	51,524,346,743
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	172,893,645,263	239,061,254,551
(分配準備積立金)	71,361,879,246	94,827,598,703
元本等合計	219,795,678,145	290,585,601,294
純資産合計	219,795,678,145	290,585,601,294
負債純資産合計	220,884,598,454	291,437,271,576

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期 自 2020年2月18日 至 2021年2月15日	第20期 自 2021年2月16日 至 2022年2月15日
営業収益		
受取利息	835	3,501
有価証券売買等損益	26,815,722,541	46,264,863,454
営業収益合計	26,815,723,376	46,264,866,955
営業費用		
支払利息	289,177	203,447
受託者報酬	57,839,885	88,258,800
委託者報酬	424,159,673	647,231,773
その他費用	3,444,607	3,871,920
営業費用合計	485,733,342	739,565,940
営業利益又は営業損失()	26,329,990,034	45,525,301,015
経常利益又は経常損失()	26,329,990,034	45,525,301,015
当期純利益又は当期純損失()	26,329,990,034	45,525,301,015
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()	3,117,826,149	7,199,536,931
期首剰余金又は期首欠損金()	135,166,929,475	172,893,645,263
剰余金増加額又は欠損金減少額	49,163,599,713	70,914,499,235
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	49,163,599,713	70,914,499,235
剰余金減少額又は欠損金増加額	40,884,700,108	43,072,654,031
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	40,884,700,108	43,072,654,031
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()	172,893,645,263	239,061,254,551

(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20期	
	自 2021年2月16日	至 2022年2月15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19期	第20期
	2021年2月15日現在	2022年2月15日現在
1. 期首元本額	42,597,378,119円	46,902,032,882円
期中追加設定元本額	17,622,141,763円	16,069,850,899円
期中一部解約元本額	13,317,487,000円	11,447,537,038円
2. 受益権の総数	46,902,032,882口	51,524,346,743口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第19期	第20期
	自 2020年2月18日 至 2021年2月15日	自 2021年2月16日 至 2022年2月15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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(29,447,871,559円)、信託約款に規定される収益調整金(113,915,957,566円)及び分配準備積立金(41,914,007,687円)より分配対象収益は185,277,836,812円(1万口当たり39,503.15円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(38,325,748,650円)、信託約款に規定される収益調整金(147,035,593,886円)及び分配準備積立金(56,501,850,053円)より分配対象収益は241,863,192,589円(1万口当たり46,941.53円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第19期	第20期
	自 2020年2月18日 至 2021年2月15日	自 2021年2月16日 至 2022年2月15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。	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。運用評価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	第19期 2021年2月15日現在	第20期 2022年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第19期 2021年2月15日現在	第20期 2022年2月15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	27,401,193,296	45,006,494,388
合計	27,401,193,296	45,006,494,388

（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19期 2021年2月15日現在	第20期 2022年2月15日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.6863円 (46,863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

2022年2月15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	51,140,481,555	290,580,216,195	
親投資信託受益証券	合計	51,140,481,555	290,580,216,195	
合計			290,580,216,195	

（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）

2022年2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,614,328,623
コール・ローン	478,060,605
株式	598,417,771,479
投資信託受益証券	1,057,641,470
投資証券	12,750,525,590
派生商品評価勘定	39,136,046
未収入金	18,728,684,370
未収配当金	461,392,808
差入委託証拠金	4,376,486,408
流動資産合計	643,924,027,399
資産合計	
643,924,027,399	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	304,819,541
未払金	891,336,692
未払解約金	85,375,000
流動負債合計	1,281,531,233
負債合計	
1,281,531,233	
純資産の部	
元本等	
元本	113,101,593,550
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	529,540,902,616
元本等合計	642,642,496,166
純資産合計	
642,642,496,166	
負債純資産合計	
643,924,027,399	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月16日 至 2022年2月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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	2022年2月15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	101,430,005,374円
同期中追加設定元本額	93,876,718,442円
同期中一部解約元本額	82,205,130,266円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,311,871,905円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,512,255円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	13,337,563円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	57,023,138円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,046,091円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	11,721,611円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,183,927円
たわらノーロード 先進国株式	29,209,837,872円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	379,011,003円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,783,685,914円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	582,139,859円
たわらノーロード バランス(堅実型)	67,491,775円
たわらノーロード バランス(標準型)	540,044,742円
たわらノーロード バランス(積極型)	666,401,105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)	881,601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)	148,165,312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)	439,640,001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)	332,155,340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)	491,044,760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)	1,241,327円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	18,750,438円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,393,492円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,200,746円
たわらノーロード 全世界株式	228,421,540円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,140,481,555円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,232,942,901円
Oneグローバルバランス	2,978,639円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	152,382,039円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	773,961,717円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,005,264,576円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	95,122,258円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	265,971,133円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	248,725,315円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,541,627円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	686,570,224円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	133,496,490円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,284,428円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	172,035,194円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	304,995,876円
投資のソムリエ	4,886,217,076円
クルーズコントロール	36,245,544円
投資のソムリエ<DC年金>	294,714,139円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	187,167,284円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	142,899,507円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	315,762円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	1,000,259円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	162,957,398円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,118,793,304円
ワールドアセットバランス(基本コース)	203,026,933円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	434,831,464円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	26,209,400円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,968,412円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,345,477円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	39,369,147円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	95,606,011円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	361,901,590円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,502,748円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	25,023,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,301,608円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,568,065円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	29,534,589円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	622,063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)	126,295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)	83,555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)	1,732,862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)	13,744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)	111,606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)	557,287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)	57,490,733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)	75,883円
M S C I 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)	958,242,351円
D I A M 外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	63,352,968円
D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,191,786,446円
D I A M 先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,189,774,417円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,052,411,163円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	73,837,834円
D I A M ワールドバランス25V A (適格機関投資家限定)	8,226,089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)	206,917円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s 用)(適格機関投資家専用)	2,898,910円
D I A M グローバル・バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	31,546,987円
D I A M グローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	56,354,600円
D I A M 国際分散バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	2,722,727円
D I A M 国際分散バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	22,177,017円
D I A M 国内重視バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,568,925円
D I A M 国内重視バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	489,870円
D I A M 世界バランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	3,953,136円
D I A M 世界バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	28,909,778円
D I A M バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	204,390,999円
D I A M バランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	306,392,875円
D I A M バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	998,858,127円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	86,555,947円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A 2(適格機関投資家限定)	51,952,941円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	332,991,420円
D I A M 世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	13,689,728円
D I A M 世界バランスファンド55V A (適格機関投資家限定)	3,498,399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)	128,366,149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)	11,208,160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)	40,455,375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)	63,324,997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)	130,176,054円
計	113,101,593,550円
2. 受益権の総数	113,101,593,550口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年2月16日 至 2022年2月15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。運用評価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	2022年2月15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	2022年2月15日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	20,970,829,208	
投資信託受益証券	30,663,632	
投資証券	781,119,059	
合計	21,782,611,899	

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年2月15日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	18,915,276,074	-	18,916,651,094	1,375,020
イギリス・ポンド	13,792,879,920	-	13,793,728,455	848,535
オーストラリア・ドル	902,627,604	-	902,721,785	94,181
カナダ・ドル	429,987,440	-	429,983,783	3,657
シンガポール・ドル	730,767,960	-	730,857,426	89,466
スイス・フラン	34,268,800	-	34,274,840	6,040
スウェーデン・クローナ	649,630,800	-	649,706,720	75,920
デンマーク・クローネ	226,228,000	-	226,320,000	92,000
ユーロ	159,604,900	-	159,620,370	15,470
香港・ドル	1,847,296,650	-	1,847,453,715	157,065
ユーロ	141,984,000	-	141,984,000	-
買建	274,805,210	-	274,422,949	382,261
アメリカ・ドル	159,279,600	-	159,277,668	1,932
イギリス・ポンド	11,582,628	-	11,561,545	21,083
オーストラリア・ドル	10,791,256	-	10,782,557	8,699
カナダ・ドル	10,154,032	-	10,156,003	1,971
ユーロ	82,997,694	-	82,645,176	352,518
合計	19,190,081,284	-	19,191,074,043	1,757,281

(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	2022年2月15日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	11,804,888,971	-	11,540,962,757	263,926,214
合計	11,804,888,971	-	11,540,962,757	263,926,214

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年2月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.6820円 (56,820円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年2月15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	44,406	3,103.340	137,806,916.040	
	ABBOTT LABORATORIES	172,720	122.780	21,206,561.600	
	AES CORP	65,452	21.460	1,404,599.920	
	ABIOMED INC	4,271	290.430	1,240,426.530	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	87,309	130.150	11,363,266.350	
	ADVANCED MICRO DEVICES	122,307	114.270	13,976,020.890	
	ADOBE INC	46,419	474.010	22,003,070.190	
	CHUBB LTD	42,930	202.070	8,674,865.100	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	21,651	243.490	5,271,801.990	

ALLEGHANY CORP	1,256	672.200	844,283.200	
ALLSTATE CORP	30,580	124.800	3,816,384.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,478	186.690	12,597,467.820	
AMGEN INC	55,291	224.270	12,400,112.570	
HESS CORP	26,932	94.730	2,551,268.360	
AMERICAN EXPRESS CO	65,569	192.350	12,612,197.150	
AMERICAN ELECTRIC POWER	48,416	86.180	4,172,490.880	
AFLAC INC	62,414	64.220	4,008,227.080	
AMERICAN INTL GROUP	83,045	58.990	4,898,824.550	
AMERCO	929	577.190	536,209.510	
ANALOG DEVICES	51,867	153.980	7,986,480.660	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,642	66.500	4,631,193.000	
VALERO ENERGY CORP	42,288	89.720	3,794,079.360	
ANSYS INC	8,394	317.120	2,661,905.280	
APPLE INC	1,610,699	168.880	272,014,847.120	
APPLIED MATERIALS INC	88,106	131.860	11,617,657.160	
ALBEMARLE CORP	11,180	227.680	2,545,462.400	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,475	76.120	4,146,637.000	
AMEREN CORP	25,436	85.130	2,165,366.680	
ARROW ELECTRONICS INC	6,295	124.570	784,168.150	
AUTODESK INC	21,423	226.900	4,860,878.700	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	41,390	201.980	8,359,952.200	
AUTOZONE INC	2,086	1,924.600	4,014,715.600	
AVERY DENNISON CORP	8,095	181.780	1,471,509.100	
BALL CORP	31,598	92.280	2,915,863.440	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	129,271	314.280	40,627,289.880	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,462	61.470	4,884,529.140	
BAXTER INTERNATIONAL INC	48,418	85.450	4,137,318.100	
BECTON DICKINSON & CO	28,024	268.900	7,535,653.600	
AMETEK INC	22,636	130.160	2,946,301.760	
VERIZON COMM INC	404,808	53.270	21,564,122.160	
WR BERKLEY CORP	12,804	89.490	1,145,829.960	
BEST BUY CO INC	21,238	100.640	2,137,392.320	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,324	620.980	1,443,157.520	
YUM! BRANDS INC	28,666	121.400	3,480,052.400	
FIRSTENERGY CORP	51,827	40.740	2,111,431.980	
BOEING CO	54,208	210.040	11,385,848.320	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	119.580	1,343,840.040	
BORGWARNER INC	20,923	42.760	894,667.480	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	138,796	42.730	5,930,753.080	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,382	89.210	1,104,598.220	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,792	167.070	1,803,019.440	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,229	1,416.120	3,156,531.480	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	215,751	66.810	14,414,324.310	
ONEOK INC	42,020	62.920	2,643,898.400	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	135.820	1,011,044.080	
UNITED RENTALS INC	6,935	313.250	2,172,388.750	
SEMPRA ENERGY	31,048	135.130	4,195,516.240	
FEDEX CORP	24,748	228.460	5,653,928.080	
VERISIGN INC	10,340	213.560	2,208,210.400	
AMPHENOL CORP	58,123	75.310	4,377,243.130	
BROWN-FORMAN CORP	29,733	66.370	1,973,379.210	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.170	599,329.120	
CSX CORP	220,361	33.920	7,474,645.120	
COTERRA ENERGY INC	78,516	23.230	1,823,926.680	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	44.030	895,306.020	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,421	233.850	3,840,050.850	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	52.290	1,516,671.450	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	76,302	21.360	1,629,810.720	
CATERPILLAR INC	53,289	199.890	10,651,938.210	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,258	129.680	1,330,257.440	
CITRIX SYSTEMS INC	11,530	101.960	1,175,598.800	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	9.910	913,583.080	
CERNER CORP	28,528	91.660	2,614,876.480	
JPMORGAN CHASE & CO	291,379	152.490	44,432,383.710	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,563	97.570	2,396,611.910	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,465	119.480	1,728,278.200	
CINTAS CORP	8,931	370.500	3,308,935.500	
CISCO SYSTEMS INC	410,704	53.180	21,841,238.720	
CLOROX COMPANY	11,455	142.950	1,637,492.250	
COCA-COLA CO/THE	400,562	60.680	24,306,102.160	
COPART INC	20,322	122.730	2,494,119.060	
COGNEX CORP	16,262	63.250	1,028,571.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	78,414	79.260	6,215,093.640	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	26,514	171.330	4,542,643.620	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,504	307.510	1,692,535.040	
NRG ENERGY, INC.	22,763	38.680	880,472.840	
COMCAST CORP-CL A	446,029	47.400	21,141,774.600	
CONAGRA BRANDS INC	45,472	35.300	1,605,161.600	
CONSOLIDATED EDISON INC	34,089	83.020	2,830,068.780	
CMS ENERGY CORP	27,238	62.390	1,699,378.820	
COOPER COS INC	4,732	391.350	1,851,868.200	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,984	49.410	839,179.440	

CORNING INC	83,866	41.290	3,462,827.140	
SEALED AIR CORP	13,382	63.310	847,214.420	
HEICO CORP-CL A	7,477	114.440	855,667.880	
CUMMINS INC	13,926	219.440	3,055,921.440	
DR HORTON INC	32,787	82.950	2,719,681.650	
DANAHER CORP	62,565	271.500	16,986,397.500	
MOODY'S CORP	16,335	323.470	5,283,882.450	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	51,262	86.240	4,420,834.880	
TARGET CORP	47,494	208.570	9,905,823.580	
DEERE & CO	28,689	387.260	11,110,102.140	
MORGAN STANLEY	133,094	102.570	13,651,451.580	
REPUBLIC SERVICES INC	21,552	118.570	2,555,420.640	
COSTAR GROUP INC	41,201	65.990	2,718,853.990	
THE WALT DISNEY CO	176,779	150.850	26,667,112.150	
DOLLAR TREE INC	23,167	136.960	3,172,952.320	
DOVER CORP	14,172	161.160	2,283,959.520	
OMNICOM GROUP	20,313	84.740	1,721,323.620	
DTE ENERGY CO	18,419	116.050	2,137,524.950	
DUKE ENERGY CORP	75,303	99.950	7,526,534.850	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,337	143.420	1,912,792.540	
EBAY INC	62,816	58.180	3,654,634.880	
BANK OF AMERICA CORP	738,433	47.420	35,016,492.860	
CITIGROUP INC	197,943	66.460	13,155,291.780	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,326	120.690	1,608,314.940	
EATON CORP PLC	39,025	152.170	5,938,434.250	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,813	142.080	3,809,591.040	
DISH NETWORK CORP	22,645	30.970	701,315.650	
ECOLAB INC	25,297	182.910	4,627,074.270	
PERKINELMER INC	11,835	181.130	2,143,673.550	
ELECTRONIC ARTS INC	27,561	133.400	3,676,637.400	
SALESFORCE.COM INC	95,348	206.400	19,679,827.200	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	183.580	411,769.940	
EMERSON ELECTRIC CO	58,388	93.970	5,486,720.360	
ATMOS ENERGY CORP	12,429	105.980	1,317,225.420	
ENTERGY CORP	18,813	104.500	1,965,958.500	
EOG RESOURCES INC	56,751	113.410	6,436,130.910	
EQUIFAX INC	11,663	220.980	2,577,289.740	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	22,664	303.850	6,886,456.400	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	16,366	107.010	1,751,325.660	
EXXON MOBIL CORP	412,707	78.980	32,595,598.860	
FMC CORP	12,183	115.750	1,410,182.250	
NEXTERA ENERGY INC	191,183	74.920	14,323,430.360	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,874	400.030	1,549,716.220	
FAIR ISAAC CORP	2,810	512.400	1,439,844.000	
ASSURANT INC	5,523	161.990	894,670.770	
FASTENAL CO	54,913	51.920	2,851,082.960	
FIFTH THIRD BANCORP	66,681	48.230	3,216,024.630	

M&T BANK CORP	12,175	180.410	2,196,491.750	
FISERV INC	57,652	97.890	5,643,554.280	
FORD MOTOR CO	380,563	17.460	6,644,629.980	
FRANKLIN RESOURCES INC	27,605	30.400	839,192.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	142,579	42.450	6,052,478.550	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,192	770.000	917,840.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,001	153.350	3,067,153.350	
DENTSPLY SIRONA INC	20,222	53.540	1,082,685.880	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,198	211.170	4,898,721.660	
GENERAL MILLS INC	58,818	67.630	3,977,861.340	
GENUINE PARTS CO	13,611	127.060	1,729,413.660	
GILEAD SCIENCES INC	121,849	61.110	7,446,192.390	
GARTNER INC	8,855	288.580	2,555,375.900	
MCKESSON CORP	15,001	270.670	4,060,320.670	
NVIDIA CORP	243,372	242.670	59,059,083.240	
GENERAL ELECTRIC CO	107,026	96.600	10,338,711.600	
WW GRAINGER INC	4,148	466.390	1,934,585.720	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,923	55.250	1,708,495.750	
HALLIBURTON CO	83,843	32.360	2,713,159.480	
MONSTER BEVERAGE CORP	38,622	82.570	3,189,018.540	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,990	360.240	11,884,317.600	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,375	219.820	4,259,012.500	
HASBRO INC	12,184	94.560	1,152,119.040	
HENRY SCHEIN INC	14,358	75.790	1,088,192.820	
HEICO CORP	3,596	139.080	500,131.680	
HERSHEY FOODS CORP	15,245	203.350	3,100,070.750	
HP INC	116,273	36.510	4,245,127.230	
F5 INC	5,557	193.800	1,076,946.600	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,336	118.360	1,460,088.960	
JUNIPER NETWORKS INC	35,290	33.790	1,192,449.100	
HOLOGIC INC	24,310	70.310	1,709,236.100	
HOME DEPOT INC	102,830	351.560	36,150,914.800	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,815	90.010	1,783,548.150	
HORMEL FOODS CORP	29,021	47.460	1,377,336.660	
CENTERPOINT ENERGY INC	61,105	26.910	1,644,335.550	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	262.750	898,867.750	
HUMANA INC	12,574	419.640	5,276,553.360	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,752	192.490	1,684,672.480	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	141,920	15.700	2,228,144.000	
BIOGEN INC	14,344	214.120	3,071,337.280	
IDEX CORP	7,332	191.680	1,405,397.760	
ILLINOIS TOOL WORKS	30,786	219.170	6,747,367.620	
INTUIT INC	26,620	529.050	14,083,311.000	

IDEXX LABORATORIES INC	8,225	505.530	4,157,984.250	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,051	151.450	3,491,073.950	
INTEL CORP	394,783	47.580	18,783,775.140	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	23,991	131.610	3,157,455.510	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,388	46.230	1,589,757.240	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36,948	35.080	1,296,135.840	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	13,148	120.670	1,586,569.160	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,748	170.180	1,318,554.640	
INCYTE CORP	17,958	66.020	1,185,587.160	
JOHNSON & JOHNSON	256,927	165.600	42,547,111.200	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	32,800	69.660	2,284,848.000	
KLA CORPORATION	14,787	365.160	5,399,620.920	
DEVON ENERGY CORP	62,462	52.260	3,264,264.120	
KELLOGG CO	26,578	64.750	1,720,925.500	
KEYCORP	91,612	25.910	2,373,666.920	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,670	132.370	4,324,527.900	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,789	760.310	11,244,224.590	
KROGER CO	68,481	45.690	3,128,896.890	
LAM RESEARCH CORP	13,876	558.250	7,746,277.000	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,417	416.940	1,841,623.980	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,555	147.020	1,551,796.100	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,264	110.650	1,688,961.600	
PLUG POWER INC	52,624	21.470	1,129,837.280	
LENNAR CORP	26,483	90.590	2,399,094.970	
ELI LILLY & CO	79,198	234.690	18,586,978.620	
BATH & BODY WORKS INC	26,967	55.030	1,483,994.010	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,002	70.940	1,206,121.880	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	70,953	213.990	15,183,232.470	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,204	135.210	3,948,672.840	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,424	386.970	9,451,355.280	
LOEWS CORP	22,394	61.130	1,368,945.220	
LOWE'S COS INC	67,434	225.950	15,236,712.300	
DOMINION ENERGY INC	78,703	78.750	6,197,861.250	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,700	44.650	1,727,955.000	
MCCORMICK & CO INC	24,905	100.400	2,500,462.000	
MCDONALD'S CORPORATION	72,778	253.390	18,441,217.420	
S&P GLOBAL INC	23,363	380.710	8,894,527.730	
EVEREST RE GROUP LTD	4,282	293.120	1,255,139.840	
MARKEL CORPORATION	1,447	1,235.500	1,787,768.500	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	60,591	107.730	6,527,468.430	
MARSH & MCLENNAN COS	49,558	151.710	7,518,444.180	
MASCO CORP	23,233	57.250	1,330,089.250	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,893	369.050	2,174,811.650	
METLIFE INC	71,443	70.130	5,010,297.590	
MEDTRONIC PLC	131,385	102.310	13,441,999.350	
ACTIVISION BLIZZARD INC	75,657	81.500	6,166,045.500	
CVS HEALTH CORP	128,735	103.000	13,259,705.000	
MERCK & CO. INC.	246,591	76.470	18,856,813.770	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	41,360	58.660	2,426,177.600	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,282	272.680	2,531,015.760	
MICROSOFT CORP	695,786	295.000	205,256,870.000	
MICRON TECH INC	109,085	89.860	9,802,378.100	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	53,322	71.190	3,795,993.180	
3M CO	56,666	158.010	8,953,794.660	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	143.820	857,598.660	
ENTEGRIS INC	13,639	126.040	1,719,059.560	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,458	327.440	1,787,167.520	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,301	213.810	3,485,316.810	
ILLUMINA INC	14,246	329.450	4,693,344.700	
XCEL ENERGY INC	51,615	66.400	3,427,236.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	86.520	840,368.760	
NETAPP INC	21,220	87.790	1,862,903.800	
NEWELL BRANDS INC	40,489	24.920	1,008,985.880	
NEWMONT CORP	77,443	64.350	4,983,457.050	
NOVAVAX INC	7,886	80.110	631,747.460	
NVR INC	338	4,977.940	1,682,543.720	
NIKE INC-CL B	124,517	141.590	17,630,362.030	
NORDSON CORP	4,787	222.110	1,063,240.570	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,235	272.270	6,598,463.450	
EVERSOURCE ENERGY	32,872	82.210	2,702,407.120	
NISOURCE INC	42,035	28.410	1,194,214.350	
NORTHERN TRUST CORP	20,011	121.510	2,431,536.610	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,860	390.600	5,804,316.000	
WELLS FARGO & CO	400,170	57.850	23,149,834.500	
NUCOR CORP	28,285	117.350	3,319,244.750	
CHENIERE ENERGY INC	23,120	116.890	2,702,496.800	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,060	155.140	6,680,328.400	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	90,266	41.230	3,721,667.180	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,578	293.950	2,815,453.100	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,672	661.040	4,410,458.880	
ORACLE CORP	163,221	78.950	12,886,297.950	
PACCAR INC	35,938	92.980	3,341,515.240	
PTC INC	11,092	111.910	1,241,305.720	
EXELON CORP	95,645	42.200	4,036,219.000	
PARKER HANNIFIN CORP	12,593	301.140	3,792,256.020	
PAYCHEX INC	31,387	118.480	3,718,731.760	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,303	505.670	3,692,908.010	
PPL CORPORATION	73,482	28.350	2,083,214.700	
PEPSICO INC	134,924	166.700	22,491,830.800	
PENTAIR PLC	16,339	58.960	963,347.440	
PFIZER INC	546,072	49.800	27,194,385.600	
ESSENTIAL UTILITIES INC	21,543	45.120	972,020.160	
CONOCOPHILLIPS	130,612	91.550	11,957,528.600	
PG&E CORP	152,496	11.280	1,720,154.880	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22,238	224.050	4,982,423.900	
ALTRIA GROUP INC	179,613	50.090	8,996,815.170	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,517	204.570	8,493,132.690	
BROWN & BROWN INC	21,793	65.980	1,437,902.140	
GARMIN LTD	14,529	120.760	1,754,522.040	
PPG INDUSTRIES INC	23,064	149.270	3,442,763.280	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	146.680	491,818.040	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,990	506.560	21,777,014.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	21,851	144.140	3,149,603.140	
QUEST DIAGNOSTICS	12,493	130.290	1,627,712.970	
PROCTER & GAMBLE CO	236,930	156.740	37,136,408.200	
PROGRESSIVE CORP	56,936	106.210	6,047,172.560	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,059	64.770	3,177,551.430	
PULTE GROUP INC	23,814	47.820	1,138,785.480	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,331	146.960	4,163,523.760	
QUALCOMM INC	109,616	165.130	18,100,890.080	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,729	109.480	2,159,930.920	
EXACT SCIENCES CORP	17,982	78.330	1,408,530.060	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,193	623.530	6,355,641.290	
RESMED INC	14,092	233.620	3,292,173.040	
US BANCORP	137,988	57.870	7,985,365.560	
SEAGEN INC	12,863	124.510	1,601,572.130	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,032	46.420	1,719,025.440	
ROSS STORES INC	34,298	94.270	3,233,272.460	
ROLLINS INC	19,156	30.840	590,771.040	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,318	442.190	4,562,516.420	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,167	268.370	2,996,887.790	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,292	82.750	1,761,913.000	

RPM INTERNATIONAL INC	12,897	84.540	1,090,312.380	
ACCENTURE PLC-CL A	61,855	326.130	20,172,771.150	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	136,494	66.140	9,027,713.160	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,453	218.860	2,725,463.580	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	24,152	170.770	4,124,437.040	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	59,927	111.500	6,681,860.500	
BOOKING HOLDINGS INC	3,984	2,545.660	10,141,909.440	
SCHLUMBERGER LTD	136,554	39.300	5,366,572.200	
SCHWAB (CHARLES) CORP	140,674	87.740	12,342,736.760	
POOL CORP	4,336	450.940	1,955,275.840	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	20,070	116.990	2,347,989.300	
BUNGE LTD	13,581	100.830	1,369,372.230	
SEI INVESTMENTS CO	10,294	59.400	611,463.600	
ANTHEM INC	23,809	443.970	10,570,481.730	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,922	140.180	2,091,765.960	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,742	74.190	1,909,798.980	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,375	270.480	6,592,950.000	
CENTENE CORP	56,386	82.010	4,624,215.860	
SVB FINANCIAL GROUP	5,617	621.530	3,491,134.010	
SMITH (A.O.) CORP	14,037	71.230	999,855.510	
SNAP-ON INC	5,783	210.710	1,218,535.930	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,564	115.800	4,349,911.200	
ADVANCE AUTO PARTS	5,694	224.280	1,277,050.320	
EDISON INTERNATIONAL	36,240	60.060	2,176,574.400	
SOUTHERN CO	103,527	65.850	6,817,252.950	
TRUIST FINANCIAL CORP	129,144	63.000	8,136,072.000	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	45.380	599,923.600	
AT&T INC	696,038	24.050	16,739,713.900	
CHEVRON CORP	188,645	136.670	25,782,112.150	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,385	164.330	2,528,217.050	
STATE STREET CORP	35,158	98.680	3,469,391.440	
STARBUCKS CORP	114,457	93.650	10,718,898.050	
STEEL DYNAMICS INC	21,929	61.610	1,351,045.690	
STRYKER CORP	33,130	250.450	8,297,408.500	
NETFLIX INC	43,024	396.570	17,062,027.680	
NORTONLIFELOCK INC	55,231	29.480	1,628,209.880	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	54.970	873,308.390	
SYNOPSIS INC	14,752	294.960	4,351,249.920	
SYSCO CORP	49,662	81.990	4,071,787.380	
INTUITIVE SURGICAL INC	34,696	281.140	9,754,433.440	
TELEFLEX INC	4,466	317.340	1,417,240.440	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	8.520	901,049.640	
TERADYNE INC	15,454	112.310	1,735,638.740	
TEXAS INSTRUMENTS INC	89,592	162.470	14,556,012.240	
TEXTRON INC	20,683	68.560	1,418,026.480	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,278	561.190	21,481,230.820	
GLOBE LIFE INC	9,168	104.030	953,747.040	
DAVITA INC	6,497	113.650	738,384.050	
TRACTOR SUPPLY CO	10,961	217.930	2,388,730.730	
BIO-TECHNE CORP	4,220	413.640	1,745,560.800	
TRIMBLE INC	26,037	65.850	1,714,536.450	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,935	467.280	1,838,746.800	
TYSON FOODS INC	27,788	94.880	2,636,525.440	
UGI CORP	18,469	37.490	692,402.810	
UNION PACIFIC CORP	63,738	242.550	15,459,651.900	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	147,236	93.570	13,776,872.520	
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,002	474.400	43,645,748.800	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	132.220	1,022,986.140	
VF CORP	35,687	59.890	2,137,294.430	
VIACOMCBS INC	57,034	35.030	1,997,901.020	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,092	231.230	5,802,023.160	
VULCAN MATERIALS CO	12,676	183.890	2,330,989.640	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70,444	47.360	3,336,227.840	
WALMART INC	150,263	133.950	20,127,728.850	
WASTE MANAGEMENT INC	40,653	141.770	5,763,375.810	
WATERS CORP	5,750	318.050	1,828,787.500	
WEBSTER FINANCIAL CORP	20,418	61.160	1,248,764.880	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,103	383.680	2,725,279.040	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,944	137.430	1,366,603.920	
VAIL RESORTS INC	4,180	271.440	1,134,619.200	
WESTERN DIGITAL CORP	29,301	52.860	1,548,850.860	
WABTEC CORP	17,097	87.480	1,495,645.560	
WHIRLPOOL CORP	5,737	196.620	1,128,008.940	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,924	134.730	2,145,440.520	
WYNN RESORTS LTD	12,004	92.060	1,105,088.240	
NASDAQ INC	11,034	171.930	1,897,075.620	
CME GROUP INC	34,892	239.170	8,345,119.640	
WILLIAMS COS INC	116,301	30.080	3,498,334.080	
LKQ CORP	28,785	53.770	1,547,769.450	
ALLIANT ENERGY CORP	23,872	56.870	1,357,600.640	
WEC ENERGY GROUP INC	30,523	89.630	2,735,776.490	
CARMAX INC	15,287	110.960	1,696,245.520	
XILINX INC	25,318	194.920	4,934,984.560	

TJX COMPANIES INC	116,823	67.990	7,942,795.770	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,609	426.420	2,391,789.780	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	5.710	620,677.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,400	60.230	1,228,692.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,882	148.660	1,617,718.120	
SIGNATURE BANK	5,610	331.370	1,858,985.700	
CBRE GROUP INC	32,338	98.210	3,175,914.980	
LIBERTY GLOBAL PLC	14,597	27.680	404,044.960	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,423	24.520	2,388,811.960	
DOMINO'S PIZZA INC	3,808	430.710	1,640,143.680	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,044	433.320	1,752,346.080	
T-MOBILE US INC	60,701	125.510	7,618,582.510	
LAS VEGAS SANDS CORP	36,769	46.210	1,699,095.490	
MOSAIC CO/THE	38,515	44.620	1,718,539.300	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,959	370.330	1,466,136.470	
CELANESE CORP	10,917	154.170	1,683,073.890	
DEXCOM INC	9,350	407.000	3,805,450.000	
DISCOVERY INC-A	13,068	29.420	384,460.560	
EXPEDIA GROUP INC	13,645	197.170	2,690,384.650	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,205	71.460	1,443,849.300	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,896	300.950	3,279,151.200	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	27.740	943,798.020	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	55,166	124.840	6,886,923.440	
LIVE NATION	15,312	115.270	1,765,014.240	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,713	1,563.950	4,242,996.350	
TRANSDIGM GROUP INC	5,093	630.740	3,212,358.820	
MASTERCARD INC	85,846	374.160	32,120,139.360	
WESTERN UNION CO	44,868	19.800	888,386.400	
OWENS CORNING	9,740	90.470	881,177.800	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,303	87.360	1,074,790.080	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	10.860	188,421.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11,780	144.840	1,706,215.200	
DELTA AIR LINES INC	14,723	41.970	617,924.310	
INSULET CORP	6,481	245.560	1,591,474.360	
DISCOVER FINANCIAL	28,645	124.160	3,556,563.200	
TE CONNECTIVITY LTD	31,846	143.530	4,570,856.380	
MASIMO CORP	5,404	224.590	1,213,684.360	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,458	313.640	3,593,687.120	
VMWARE INC	21,320	123.580	2,634,725.600	

MERCADOLIBRE INC	4,313	1,119.010	4,826,290.130	
ULTA BEAUTY INC	5,274	362.650	1,912,616.100	
INVESCO LTD	36,904	22.820	842,149.280	
MSCI INC	7,974	532.970	4,249,902.780	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	152,060	109.240	16,611,034.400	
VISA INC	164,441	225.340	37,055,134.940	
KEURIG DR PEPPER INC	70,952	38.100	2,703,271.200	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,337	148.030	2,566,396.110	
DISCOVERY INC-C	30,388	29.330	891,280.040	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,896	79.160	4,899,687.360	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,787	89.240	1,141,111.880	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	196,057	17.190	3,370,219.830	
XYLEM INC	17,083	89.260	1,524,828.580	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	26,191	100.150	2,623,028.650	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,482	181.260	631,147.320	
SPLUNK INC	15,699	124.970	1,961,904.030	
EPAM SYSTEMS INC	5,399	427.950	2,310,502.050	
ZILLOW GROUP INC	7,658	57.350	439,186.300	
HCA HEALTHCARE INC	25,049	235.420	5,897,035.580	
VERISK ANALYTICS INC	14,624	191.810	2,805,029.440	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	142.310	875,491.120	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,399	244.690	1,810,461.310	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,947	171.770	2,910,986.190	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,851	185.880	4,805,183.880	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	74.330	1,017,354.710	
LEAR CORP	5,216	167.240	872,323.840	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	120.580	1,269,345.660	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	21,554	75.140	1,619,567.560	
DOLLAR GENERAL CORP	22,566	200.610	4,526,965.260	
FORTINET INC	13,408	310.350	4,161,172.800	
HORIZON PHARMA PLC	20,415	96.490	1,969,843.350	
TESLA INC	81,966	875.760	71,782,544.160	
GENERAC HOLDINGS INC	5,993	270.450	1,620,806.850	
ENPHASE ENERGY INC	12,217	143.930	1,758,392.810	
GENERAL MOTORS CO	126,727	48.400	6,133,586.800	
ALLY FINANCIAL INC	37,466	48.340	1,811,106.440	
APTIV PLC	26,018	136.600	3,554,058.800	
PHILLIPS 66	42,428	90.520	3,840,582.560	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	8,628	94.470	815,087.160	

META PLATFORMS INC	232,143	217.700	50,537,531.100	
IQVIA HOLDINGS INC	18,572	239.900	4,455,422.800	
DIAMONDBACK ENERGY INC	15,727	130.470	2,051,901.690	
SERVICENOW INC	19,263	579.580	11,164,449.540	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,441	521.020	4,918,949.820	
WORKDAY INC	18,602	232.980	4,333,893.960	
ABBVIE INC	172,156	143.000	24,618,308.000	
ZOETIS INC	46,053	196.430	9,046,190.790	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	22.280	854,928.160	
CDW CORP	12,943	176.100	2,279,262.300	
HOWMET AEROSPACE INC	40,434	34.070	1,377,586.380	
TWILIO INC	15,835	195.710	3,099,067.850	
COUPA SOFTWARE INC	7,732	130.640	1,010,108.480	
SNAP INC	102,774	39.620	4,071,905.880	
TRADE DESK INC A	41,852	76.510	3,202,096.520	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,157	62.290	1,380,159.530	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	50.660	421,693.840	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,346	50.590	725,764.140	
OKTA INC	11,692	189.410	2,214,581.720	
BLACK KNIGHT INC	16,775	65.530	1,099,265.750	
BAKER HUGHES CO	77,909	28.540	2,223,522.860	
BROADCOM INC	39,894	578.580	23,081,870.520	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,305	168.160	1,228,408.800	
MONGODB INC	6,101	429.930	2,623,002.930	
BURLINGTON STORES INC	6,861	224.590	1,540,911.990	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	25.130	1,016,483.370	
VEEVA SYSTEMS INC	13,296	227.930	3,030,557.280	
TWITTER INC	82,981	35.690	2,961,591.890	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	56.720	906,669.200	
EVERGY INC	22,398	61.910	1,386,660.180	
ALLEGION PLC	8,924	118.330	1,055,976.920	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	69.950	934,532.000	
STERIS PLC	9,649	226.550	2,185,980.950	
DOCUSIGN INC	18,520	120.780	2,236,845.600	
WIX.COM LTD	5,567	112.620	626,955.540	
DROPBOX INC	28,170	24.390	687,066.300	
KKR & CO INC	50,337	60.570	3,048,912.090	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	44.120	209,922.960	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	20,900	142.090	2,969,681.000	
MODERNA INC	33,413	142.470	4,760,350.110	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,616	151.430	4,030,460.880	
ARAMARK	21,387	35.980	769,504.260	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	57,124	17.750	1,013,951.000	
CIGNA CORP	33,111	225.240	7,457,921.640	

DELL TECHNOLOGIES INC	27,783	58.600	1,628,083.800	
DOW INC	72,256	60.830	4,395,332.480	
AMCOR PLC	161,822	11.570	1,872,280.540	
PINTEREST INC	52,177	24.710	1,289,293.670	
PELOTON INTERACTIVE INC	25,418	32.830	834,472.940	
FOX CORP-A	34,681	42.670	1,479,838.270	
FOX CORP-B	15,080	38.750	584,350.000	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	40,846	16.460	672,325.160	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	18,231	180.600	3,292,518.600	
CHEWY INC	9,068	52.630	477,248.840	
AVANTOR INC	48,639	35.360	1,719,875.040	
LYFT INC	24,589	39.990	983,314.110	
DYNATRACE INC	19,417	42.720	829,494.240	
CLOUDFLARE INC	22,554	105.560	2,380,800.240	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	82.440	815,001.840	
CARRIER GLOBAL CORP	79,871	44.790	3,577,422.090	
OTIS WORLDWIDE CORP	42,226	79.750	3,367,523.500	
INMODE LTD	5,511	45.600	251,301.600	
UBER TECHNOLOGIES INC	119,109	34.590	4,119,980.310	
CORTEVA INC	71,705	50.900	3,649,784.500	
MATCH GROUP INC	25,322	113.780	2,881,137.160	
BILL.COM HOLDINGS INC	7,830	240.000	1,879,200.000	
BLACKSTONE INC	66,578	121.200	8,069,253.600	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	3,202	82.200	263,204.400	
CARLYLE GROUP INC	17,020	46.770	796,025.400	
10X GENOMICS INC	7,667	89.420	685,583.140	
DATADOG INC	18,367	164.350	3,018,616.450	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	20,924	106.130	2,220,664.120	
UPSTART HOLDINGS INC	2,080	104.600	217,568.000	
INGERSOLL RAND INC	40,529	53.800	2,180,460.200	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,250	345.720	1,815,030.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	17,712	62.650	1,109,656.800	
ASANA INC	7,134	68.660	489,820.440	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	107.590	577,435.530	
AON PLC	22,029	279.880	6,165,476.520	
SOFI TECHNOLOGIES INC	54,734	12.000	656,808.000	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	39.030	624,558.060	
COINBASE GLOBAL INC	3,976	195.250	776,314.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,204	43.700	402,214.800	
IAC/INTERACTIVECORP	7,250	131.680	954,680.000	
AIRBNB INC	22,711	169.660	3,853,148.260	
ZENDESK INC	11,915	116.390	1,386,786.850	
CONSTELLATION ENERGY CORP	31,881	48.110	1,533,794.910	
ROYALTY PHARMA PLC	35,564	39.110	1,390,908.040	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	23,577	55.350	1,304,986.950	
VIATRIS INC	124,858	15.030	1,876,615.740	

CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,814	81.230	1,771,951.220	
DRAFTKINGS INC	33,459	22.200	742,789.800	
SNOWFLAKE INC	20,394	291.130	5,937,305.220	
DOORDASH INC	10,922	97.110	1,060,635.420	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	17.030	155,722.320	
ARISTA NETWORKS INC	21,859	122.820	2,684,722.380	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	37,177	65.630	2,439,926.510	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	153,271	13.260	2,032,373.460	
IHS MARKIT LTD	36,714	107.800	3,957,769.200	
FNF GROUP	25,451	47.800	1,216,557.800	
MARVELL TECHNOLOGY INC	79,417	67.750	5,380,501.750	
ROBINHOOD MARKETS INC	19,872	13.350	265,291.200	
LUCID GROUP INC	42,136	27.440	1,156,211.840	
CATALENT INC	17,439	98.970	1,725,937.830	
SYNCHRONY FINANCIAL	59,985	44.030	2,641,139.550	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	43,554	53.660	2,337,107.640	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	153.180	529,543.260	
WAYFAIR INC	6,959	142.210	989,639.390	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,412	165.930	2,889,173.160	
HUBSPOT INC	4,307	545.890	2,351,148.230	
QORVO INC	11,107	129.310	1,436,246.170	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	149.210	361,834.250	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,520	152.030	2,207,475.600	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	4,959	249.220	1,235,881.980	
GODADDY INC	16,574	80.370	1,332,052.380	
KORNIT DIGITAL LTD	4,978	98.310	489,387.180	
ETSY INC	11,713	142.650	1,670,859.450	
TRANSUNION	18,990	100.580	1,910,014.200	
BLOCK INC	48,939	111.640	5,463,549.960	
DUPONT DE NEMOURS INC	50,680	79.320	4,019,937.600	
CARVANA CO	7,735	140.630	1,087,773.050	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	21,537	56.980	1,227,178.260	
TELADOC HEALTH INC	14,790	70.840	1,047,723.600	
WESTROCK CO	26,297	45.790	1,204,139.630	
KRAFT HEINZ CO	64,001	34.590	2,213,794.590	
NOVOCURE LTD	9,772	78.880	770,815.360	
FORTIVE CORP	32,964	65.050	2,144,308.200	
WASTE CONNECTIONS INC	26,186	119.410	3,126,870.260	
ALPHABET INC-CL A	29,314	2,710.520	79,456,183.280	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	123,101	16.870	2,076,713.870	
	PAYPAL HOLDINGS INC	108,655	114.120	12,399,708.600	
	SEA LTD ADR	13,232	129.170	1,709,177.440	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	34,346	33.940	1,165,703.240	
	SUNRUN INC	16,213	22.600	366,413.800	
	ZILLOW GROUP INC-C	15,665	58.070	909,666.550	
	ALPHABET INC-CL C	28,094	2,706.000	76,022,364.000	
	ZSCALER INC	7,759	274.430	2,129,302.370	
	CABLE ONE INC	542	1,500.720	813,390.240	
	LINDE PLC	50,398	293.510	14,792,316.980	
	ROKU INC	11,901	159.020	1,892,497.020	
	AVALARA INC	7,824	99.260	776,610.240	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,476	607.940	7,584,659.440	
	VISTRA CORP	39,758	21.600	858,772.800	
アメリカ・ドル	小計	30,909,671		3,769,273,840.880 (435,049,586,714)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	13.895	489,951.590	
	ASHTAD GROUP	43,003	48.410	2,081,775.230	
	SEVERN TRENT PLC	29,458	28.300	833,661.400	
	BARCLAYS PLC	1,651,219	1.955	3,228,133.140	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	92,235	6.188	570,750.180	
	BT GROUP PLC	850,262	1.927	1,638,454.870	
	BHP GROUP LTD	205,988	25.170	5,184,717.960	
	BUNZL PLC	35,508	26.640	945,933.120	
	AVIVA PLC	381,543	4.310	1,644,450.330	
	CRODA INTERNATIONAL	13,693	73.240	1,002,875.320	
	DIAGEO PLC	227,784	36.320	8,273,114.880	
	SCHRODERS PLC	11,354	32.310	366,847.740	
	DCC PLC	10,684	63.580	679,288.720	
	NATIONAL GRID PLC	352,237	10.750	3,786,547.750	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.181	672,654.260	
	BAE SYSTEMS PLC	309,699	6.000	1,858,194.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	212,707	34.090	7,251,181.630	
	HALMA PLC	34,201	23.300	796,883.300	
	NEXT PLC	13,197	71.580	944,641.260	
	IMPERIAL BRANDS PLC	89,652	17.810	1,596,702.120	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	17.655	337,334.080	
	ANGLO AMERICAN PLC	125,520	36.175	4,540,686.000	
	COMPASS GROUP PLC	172,199	17.815	3,067,725.180	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,990,553	5.582	11,111,266.840	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	573,320	2.720	1,559,430.400	
	UNILEVER PLC	252,812	38.100	9,632,137.200	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	10.445	707,272.730	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	32,209	18.780	604,885.020	
PEARSON PLC	63,746	6.252	398,539.990	
PERSIMMON PLC	33,688	24.450	823,671.600	
PRUDENTIAL PLC	254,460	11.770	2,994,994.200	
RIO TINTO PLC	109,155	57.220	6,245,849.100	
VODAFONE GROUP PLC	2,706,774	1.365	3,694,746.510	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	69,296	59.050	4,091,928.800	
RELX PLC	189,262	22.390	4,237,576.180	
RENTOKIL INITIAL PLC	193,406	4.984	963,935.500	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	795,864	1.177	936,731.920	
NATWEST GROUP PLC	572,346	2.426	1,388,511.390	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,393	15.025	727,104.820	
SSE PLC	99,967	15.250	1,524,496.750	
BP PLC	1,956,809	4.006	7,838,976.850	
SAGE GROUP PLC(THE)	92,478	6.824	631,069.870	
SMITHS GROUP PLC	35,400	15.405	545,337.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,648	119.800	916,230.400	
STANDARD CHARTERED PLC	242,725	5.502	1,335,472.950	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,918,954	0.517	3,577,099.210	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.522	527,820.460	
TESCO PLC	809,805	2.954	2,392,163.970	
3I GROUP PLC	101,975	13.220	1,348,109.500	
SMITH & NEPHEW PLC	88,029	12.060	1,061,629.740	
GLAXOSMITHKLINE PLC	489,601	15.712	7,692,610.910	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	31,795	68.740	2,185,588.300	
WPP PLC	113,403	11.935	1,353,464.800	
ASTRAZENECA PLC	150,840	83.810	12,641,900.400	
WHITBREAD PLC	18,744	32.010	599,995.440	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	51.640	833,417.960	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	19.630	760,937.320	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,286	50.520	822,768.720	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.773	507,076.320	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	30.300	608,636.100	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,559	40.830	431,123.970	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	19.460	350,941.640	
AVEVA GROUP PLC	10,408	26.780	278,726.240	
ABRDN PLC	206,313	2.373	489,580.740	
EXPERIAN PLC	89,361	28.650	2,560,192.650	
MONDI PLC	45,875	18.645	855,339.370	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	13.050	460,821.600	
OCADO GROUP PLC	44,909	13.005	584,041.540	
INFORMA PLC	151,566	6.084	922,127.540	
GLENCORE PLC	968,128	4.221	4,086,468.280	

	ENTAIN PLC	58,126	16.845	979,132.470	
	COCA-COLA HBC AG	20,233	24.050	486,603.650	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	56,561	6.572	371,718.890	
	FERGUSON PLC	21,607	109.550	2,367,046.850	
	M&G PLC	259,117	2.122	549,846.270	
	JD SPORTS FASHION PLC	235,490	1.685	396,800.650	
	SHELL PLC	750,311	20.055	15,047,487.100	
	AUTO TRADER GROUP PLC	104,624	6.382	667,710.360	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	470,129	1.520	714,596.080	
イギリス・ポンド 小計		28,416,737		184,216,195.120 (28,781,938,326)	
イスラエル・シケル	BANK HAPOALIM BM	107,744	33.090	3,565,248.960	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	143,645	34.240	4,918,404.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,198	563.500	1,238,573.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	106,143	21.290	2,259,784.470	
	ICL GROUP LTD	68,048	32.430	2,206,796.640	
	NICE LTD	6,129	852.600	5,225,585.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,784	122.000	2,047,648.000	
	AZRIELI GROUP	4,414	277.900	1,226,650.600	
イスラエル・シケル 小計		455,105		22,688,691.870 (804,375,386)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	17,134	63.600	1,089,722.400	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	275,753	28.200	7,776,234.600	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	356,597	23.880	8,515,536.360	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	162,222	22.750	3,690,550.500	
	TELSTRA CORP LTD	389,681	4.060	1,582,104.860	
	ASX LTD	18,926	82.920	1,569,343.920	
	BHP GROUP LTD	306,496	48.330	14,812,951.680	
	AMPOL LTD	20,946	32.350	677,603.100	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	23.060	1,189,988.240	
	CSL LIMITED	46,424	243.560	11,307,029.440	
	REA GROUP LTD	5,828	135.440	789,344.320	
	TRANSURBAN GROUP	293,786	12.830	3,769,274.380	
	COCHLEAR LTD	5,875	190.070	1,116,661.250	
	ORIGIN ENERGY LTD	146,360	6.210	908,895.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	172,888	100.040	17,295,715.520	
	RIO TINTO LIMITED	35,915	121.580	4,366,545.700	
	APA GROUP	118,205	10.000	1,182,050.000	
ARISTOCRAT LEISU	62,013	40.230	2,494,782.990		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	269,430	4.720	1,271,709.600		

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,246	46.690	2,159,225.740		
ORICA LTD	41,311	14.720	608,097.920		
LEND LEASE CORP LTD	62,116	10.040	623,644.640		
BLUESCOPE STEEL LTD	46,946	18.790	882,115.340		
SYDNEY AIRPORT	142,258	8.720	1,240,489.760		
MACQUARIE GROUP LTD	33,736	194.220	6,552,205.920		
SUNCORP GROUP LTD	120,290	11.730	1,411,001.700		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	318,861	30.430	9,702,940.230		
NEWCREST MINING LTD	86,879	23.700	2,059,032.300		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	107,483	5.310	570,734.730		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	133,624	12.700	1,697,024.800		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	96,692	9.000	870,228.000		
REECE LTD	30,319	19.960	605,167.240		
SANTOS LTD	333,393	7.720	2,573,793.960		
SONIC HEALTHCARE	40,613	37.510	1,523,393.630		
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	24,711	26.520	655,335.720		
TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	5.200	1,115,904.400		
WESFARMERS LTD	109,481	53.870	5,897,741.470		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	90,641	27.430	2,486,282.630		
WOOLWORTHS GROUP LTD	120,440	33.910	4,084,120.400		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	18.230	283,531.190		
SEEK LTD	36,140	27.780	1,003,969.200		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	101.140	615,538.040		
AUSNET SERVICES	165,066	2.590	427,520.940		
BRAMBLES LTD	130,028	9.420	1,224,863.760		
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.640	415,363.040		
EVOLUTION MINING LTD	150,230	3.960	594,910.800		
AURIZON HOLDINGS LTD	138,166	3.620	500,160.920		
TREASURY WINE ESTATES LTD	75,903	10.630	806,848.890		
XERO LTD	14,063	109.000	1,532,867.000		
IDP EDUCATION LTD	22,852	27.460	627,515.920		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	6.270	749,728.980		
MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.180	900,429.720		
SOUTH32 LTD(AUD)	409,317	4.530	1,854,206.010		
COLES GROUP LTD	122,726	16.320	2,002,888.320		
WISETECH GLOBAL LTD	13,604	45.650	621,022.600		
オーストラリア・ドル 小計	6,692,043		146,885,890.320 (12,090,177,632)		
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	45,567	66.770	3,042,508.590	
	BARRICK GOLD CORP	173,687	26.850	4,663,495.950	

BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	11.810	251,222.320	
BANK OF MONTREAL	63,076	148.730	9,381,293.480	
BANK OF NOVA SCOTIA	119,119	92.520	11,020,889.880	
NATIONAL BANK OF CANADA	32,600	102.430	3,339,218.000	
BCE INC	7,275	66.450	483,423.750	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	137,930	72.150	9,951,649.500	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	31.530	888,893.760	
SAPUTO INC	25,395	29.740	755,247.300	
BLACKBERRY LTD	46,671	8.780	409,771.380	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	62,222	17.730	1,103,196.060	
CGI INC	22,985	106.970	2,458,705.450	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	63.920	981,683.360	
CAE INC	30,443	31.780	967,478.540	
CAMECO CORP	34,676	27.670	959,484.920	
ROGERS COMM-CL B	37,308	65.910	2,458,970.280	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	43,621	161.480	7,043,919.080	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	115,217	67.050	7,725,299.850	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	181.480	1,068,735.720	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,793	35.040	343,146.720	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69,109	156.430	10,810,720.870	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	49.270	1,025,555.050	
OPEN TEXT CORP	25,868	56.300	1,456,368.400	
EMPIRE CO LTD	15,093	39.040	589,230.720	
KINROSS GOLD CORP	118,575	7.320	867,969.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,452	73.080	690,752.160	
FORTIS INC	45,200	57.190	2,584,988.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	35.390	2,014,186.460	
TELUS CORP	31,890	31.710	1,011,231.900	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	39.760	1,003,940.000	
IMPERIAL OIL LTD	22,066	56.270	1,241,653.820	
ENBRIDGE INC	196,479	52.790	10,372,126.410	
IGM FINANCIAL INC	5,366	45.390	243,562.740	
MANULIFE FINANCIAL CORP	189,250	27.050	5,119,212.500	
LOBLAW CO LTD	15,486	100.750	1,560,214.500	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	78,873	52.650	4,152,663.450	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,202	97.550	2,946,205.100	
SUN LIFE FINANCIAL INC	57,083	68.330	3,900,481.390	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,320	648.750	1,505,100.000	
METRO INC	22,764	67.420	1,534,748.880	
EMERA INC	23,836	58.780	1,401,080.080	

ONEX CORP	6,489	91.820	595,819.980	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	30.500	572,363.000	
POWER CORP OF CANADA	56,439	41.880	2,363,665.320	
QUEBECOR INC-B	16,042	30.770	493,612.340	
ROYAL BANK OF CANADA	139,486	145.000	20,225,470.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	90,681	91.610	8,307,286.410	
SHAW COMM INC-B	42,601	37.640	1,603,501.640	
SUNCOR ENERGY INC	143,108	37.840	5,415,206.720	
LUNDIN MINING CORP	64,310	11.940	767,861.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	43,824	45.590	1,997,936.160	
THOMSON REUTERS CORP	16,740	129.580	2,169,169.200	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,388	113.590	1,066,382.920	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	177,819	106.270	18,896,825.130	
TC ENERGY CORP	94,979	66.630	6,328,450.770	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,298	124.610	1,158,623.780	
WESTON (GEORGE) LTD	7,886	139.670	1,101,437.620	
INTACT FINANCIAL CORP	17,901	181.130	3,242,408.130	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	47,007	54.020	2,539,318.140	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,931	2,126.350	4,105,981.850	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	18,623	182.250	3,394,041.750	
TOURMALINE OIL CORP	32,364	46.260	1,497,158.640	
KEYERA CORP	23,772	31.040	737,882.880	
PARKLAND CORP	14,497	34.700	503,045.900	
ALTAGAS LTD	24,053	27.690	666,027.570	
PEMBINA PIPELINE CORP	56,442	42.290	2,386,932.180	
DOLLARAMA INC	26,438	63.710	1,684,364.980	
CENOVUS ENERGY INC W/I	134,422	19.960	2,683,063.120	
NORTHLAND POWER INC	23,490	36.320	853,156.800	
TMX GROUP LTD	4,797	133.050	638,240.850	
IVANHOE MINES LTD	61,930	11.290	699,189.700	
NUTRIEN LTD	55,564	93.430	5,191,344.520	
TFI INTERNATIONAL INC	8,999	135.980	1,223,684.020	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	11,346	36.620	415,490.520	
WSP GLOBAL INC	12,991	161.910	2,103,372.810	
IA FINANCIAL CORP INC	11,660	81.280	947,724.800	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	38.260	630,716.100	
NUVEI CORP	4,960	78.920	391,443.200	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	44.020	477,396.900	
AIR CANADA	17,940	24.240	434,865.600	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	26,443	72.690	1,922,141.670	
SHOPIFY INC	10,946	1,078.950	11,810,186.700	
FIRSTSERVICE CORP	3,293	193.230	636,306.390	

	CANOPY GROWTH CORP	18,634	10.720	199,756.480	
	HYDRO ONE LTD	35,738	32.230	1,151,835.740	
カナダ・ドル 小計		3,811,554		251,560,915.650 (22,811,543,831)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	109,500	3.820	418,290.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	176,600	37.200	6,569,520.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.140	259,896.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	67,400	9.740	656,476.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.770	557,634.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	6.040	814,796.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	320,953	13.340	4,281,513.020	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.550	2,061,476.100	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.210	823,440.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	111,300	32.700	3,639,510.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.300	295,650.000	
	VENTURE CORP LTD	42,100	18.120	762,852.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.540	823,556.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	295,215	3.620	1,068,678.300	
シンガポール・ドル 小計		3,206,940		23,033,287.920 (1,973,722,442)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	253,013	8.312	2,103,044.050	
	LOGITECH INTL-REG	18,008	73.000	1,314,584.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	274,536	117.300	32,203,072.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	50,816	130.950	6,654,355.200	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	68,016	342.200	23,275,075.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	222.600	917,557.200	
	SIKA INHABER	13,838	296.100	4,097,431.800	
	SGS SA-REG	613	2,576.000	1,579,088.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	213,886	79.190	16,937,632.340	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	160.500	683,569.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	329	2,090.000	687,610.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	16.800	335,647.200	
	SWISSCOM AG-REG	2,419	548.000	1,325,612.000	
	ABB LTD	160,591	31.400	5,042,557.400	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,095	46.660	657,672.700	
	GEBERIT AG	3,539	596.000	2,109,244.000	
	LONZA GROUP AG-REG	7,169	603.000	4,322,907.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	110	10,080.000	1,108,800.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	10	103,100.000	1,031,000.000	
	GIVAUDAN-REG	901	3,585.000	3,230,085.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,734	443.000	6,527,162.000		
ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,604	371.400	1,338,525.600		

	HOLCIM LTD	51,147	50.700	2,593,152.900	
	TEMENOS GROUP	6,753	108.200	730,674.600	
	BACHEM HOLDING AG	500	505.000	252,500.000	
	SONOVA HOLDING AG	5,210	318.900	1,661,469.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,934	253.100	1,248,795.400	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,125	1,381.000	1,553,625.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	287.200	859,015.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	55.350	254,167.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,494	221.400	330,771.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,053	591.800	1,806,765.400	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	163.000	856,728.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	616	913.500	562,716.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	89.250	717,570.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,176	1,244.000	2,706,944.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,008	58.180	1,222,245.440	
	SWISS RE LTD	29,213	98.060	2,864,626.780	
	ALCON INC	48,573	70.960	3,446,740.080	
	UBS GROUP AG	342,779	19.065	6,535,081.630	
	VAT GROUP AG	2,412	339.800	819,597.600	
スイス・フラン	小計	1,670,459		148,505,418.820 (18,554,267,027)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	63,697	497.600	31,695,627.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	40,190	434.800	17,474,612.000	
	ERICSSON LM-B SHS	279,450	115.140	32,175,873.000	
	GETINGE AB-B SHS	24,421	354.900	8,667,012.900	
	INVESTOR AB-A SHS	55,733	206.900	11,531,157.700	
	LUNDBERGS B	7,382	470.300	3,471,754.600	
	SKF AB-B SHS	32,228	187.900	6,055,641.200	
	SANDVIK AB	114,371	232.900	26,637,005.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	166,438	120.600	20,072,422.800	
	SKANSKA AB-B SHS	31,968	238.500	7,624,368.000	
	SWEDBANK AB	89,378	168.520	15,061,980.560	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	54,382	161.950	8,807,164.900	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	134,020	96.860	12,981,177.200	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	212.800	5,041,444.800	
	VOLVO AB-B SHS	134,282	210.900	28,320,073.800	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	69.640	11,026,031.560	
	TELE2 AB-B SHS	46,083	130.650	6,020,743.950	
	INDUSTRIVARDEN A	14,273	287.600	4,104,914.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,940	282.400	3,371,856.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	25,219	180.300	4,546,985.700	
	SECURITAS AB-B SHS	48,354	118.950	5,751,708.300	
	INVESTOR AB-B SHS	169,419	194.960	33,029,928.240	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,270	177.960	11,793,409.200	

	ASSA ABLOY AB-B	101,025	261.500	26,418,037.500	
	TELIA CO AB	269,954	37.205	10,043,638.570	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	338.100	7,019,632.200	
	BOLIDEN AB	24,047	400.800	9,638,037.600	
	ALFA LAVAL AB	27,930	284.000	7,932,120.000	
	KINNEVIK AB-B	21,449	253.200	5,430,886.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	11,401	586.600	6,687,826.600	
	HUSQVARNA AB-B SHS	45,158	121.300	5,477,665.400	
	NIBE INDUSTRIER AB	134,088	85.140	11,416,252.320	
	HEXAGON AB-B SHS	185,243	122.750	22,738,578.250	
	SAGAX AB	18,348	255.000	4,678,740.000	
	EPIROC AB-A	59,363	189.900	11,273,033.700	
	EPIROC AB-B	38,943	162.000	6,308,766.000	
	ESSITY AB-B	57,654	264.500	15,249,483.000	
	EQT AB	30,003	339.000	10,171,017.000	
	EMBRACER GROUP AB	49,142	84.570	4,155,938.940	
	LIFCO AB	25,738	203.500	5,237,683.000	
	EVOLUTION AB	16,147	1,060.000	17,115,820.000	
	NORDEA BANK ABP	310,272	109.640	34,018,222.080	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	266.800	3,987,326.000	
	SINCH AB	56,299	95.800	5,393,444.200	
スウェーデン・クローナ 小計		3,309,429		545,655,043.470 (6,711,557,035)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,457	1,029.500	10,765,481.500	
	A P MOLLER A/S	527	22,650.000	11,936,550.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	21,440.000	7,311,040.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	131.000	9,002,975.000	
	GENMAB A/S	6,251	2,199.000	13,745,949.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,132	389.100	7,444,261.200	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,448.000	1,990,224.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	164,082	643.100	105,521,134.200	
	GN STORE NORD A/S	10,448	366.000	3,823,968.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	97,991	162.800	15,952,934.800	
	COLOPLAST-B	11,922	916.400	10,925,320.800	
	DSV A/S	19,861	1,261.000	25,044,721.000	
	DEMANT A/S	10,739	267.300	2,870,534.700	
	TRYG A/S	35,784	152.000	5,439,168.000	
	PANDORA A/S	9,265	717.800	6,650,417.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	8,984	477.400	4,288,961.600	
	AMBU A/S B	14,156	120.500	1,705,798.000	
ORSTED A/S	19,205	655.400	12,586,957.000		
デンマーク・クローネ 小計		508,683		257,006,395.800 (4,507,892,182)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.230	796,933.980	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	9.350	462,348.150	

	FISHER & PAYKEL	57,388	28.010	1,607,437.880	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	262,943	4.400	1,156,949.200	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	5.790	357,439.860	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.890	607,152.180	
ニュージーランド・ドル 小計		665,902		4,988,261.250 (381,252,807)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	235.200	10,161,110.400	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	77.380	9,984,805.680	
	TELENOR ASA	67,435	137.300	9,258,825.500	
	SCHIBSTED ASA	7,537	231.700	1,746,322.900	
	ORKLA ASA	69,440	84.420	5,862,124.800	
	EQUINOR ASA	94,306	273.750	25,816,267.500	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	443.000	6,730,499.000	
	AKER BP ASA	15,217	271.400	4,129,893.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	29,484	212.400	6,262,401.600	
	ADEVINTA ASA	22,265	83.000	1,847,995.000	
	DNB BANK ASA	89,596	212.100	19,003,311.600	
	SCHIBSTED ASA	7,445	203.400	1,514,313.000	
ノルウェー・クローネ 小計		590,156		102,317,870.780 (1,330,132,320)	
ユーロ	CRH PLC	75,580	43.690	3,302,090.200	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,584	133.250	2,343,068.000	
	KERRY GROUP PLC-A	14,968	107.400	1,607,563.200	
	KINGSPAN GROUP PLC	14,307	87.000	1,244,709.000	
	UMICORE	17,749	32.330	573,825.170	
	AIR LIQUIDE	46,578	142.120	6,619,665.360	
	AIRBUS SE	57,535	116.300	6,691,320.500	
	AXA SA	189,506	27.575	5,225,627.950	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	67,438	31.510	2,124,971.380	
	ADIDAS AG	18,433	231.150	4,260,787.950	
	ASSICURAZIONI GENERALI	111,777	18.355	2,051,666.830	
	DASSAULT AVIATION SA	2,950	115.300	340,135.000	
	DANONE	63,231	54.760	3,462,529.560	
	SAFRAN SA	33,308	112.220	3,737,823.760	
	INTESA SANPAOLO	1,598,158	2.767	4,422,103.180	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,921	92.590	3,048,155.390	
	ACCOR SA	17,380	33.100	575,278.000	
	BOUYGUES	20,222	32.110	649,328.420	
	BNP PARIBAS	109,914	61.750	6,787,189.500	
	THALES SA	10,448	83.060	867,810.880	
	CAPGEMINI SA	15,519	193.100	2,996,718.900	
	UNICREDIT SPA	205,636	15.026	3,089,886.530	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,859	159.150	2,683,109.850	
COMMERZBANK AG	106,215	8.573	910,581.190		
EIFFAGE	8,477	96.000	813,792.000		

FRESENIUS SE & CO KGAA	38,830	36.580	1,420,401.400	
UNITED INTERNET	9,882	34.460	340,533.720	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	36.780	203,981.880	
PUBLICIS GROUPE	25,345	63.300	1,604,338.500	
FAURECIA	10,774	41.350	445,504.900	
IBERDROLA SA	594,592	9.144	5,436,949.240	
ENI SPA	241,813	13.324	3,221,916.410	
JERONIMO MARTINS	33,135	19.450	644,475.750	
KESKO OYJ-B	23,804	26.500	630,806.000	
KBC GROUPE	26,587	76.840	2,042,945.080	
HANNOVER RUECK SE	5,321	171.700	913,615.700	
WARTSILA OYJ	48,612	10.215	496,571.580	
L'OREAL	24,554	353.100	8,670,017.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,069	670.000	18,136,230.000	
GEA GROUP AG	16,492	40.630	670,069.960	
BOLLORE	70,807	4.878	345,396.540	
MEDIOBANCA SPA	57,442	10.165	583,897.930	
MICHELIN(CGDE) -B	16,226	144.750	2,348,713.500	
CONTINENTAL AG	9,795	87.770	859,707.150	
DEUTSCHE POST AG-REG	95,937	51.210	4,912,933.770	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	16.370	347,142.220	
OMV AG	17,007	55.960	951,711.720	
VERBUND AG	6,916	94.000	650,104.000	
PERNOD-RICARD	20,447	190.250	3,890,041.750	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	15,912	85.480	1,360,157.760	
RENAULT SA	19,019	34.385	653,968.310	
REPSOL SA	150,289	11.668	1,753,572.050	
REMY COINTREAU	1,847	175.700	324,517.900	
MERCK KGAA	12,364	176.050	2,176,682.200	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	49,174	60.630	2,981,419.620	
RWE AG	64,426	36.520	2,352,837.520	
SEB SA	2,439	134.800	328,777.200	
SOCIETE GENERALE-A	78,864	33.795	2,665,208.880	
VINCI S.A.	52,344	100.040	5,236,493.760	
SODEXO	9,325	84.540	788,335.500	
SOFINA	1,382	340.000	469,880.000	
SOLVAY SA	6,931	106.300	736,765.300	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	52,892	142.120	7,517,011.040	
VIVENDI SE	68,746	11.715	805,359.390	
SAP SE	101,597	105.380	10,706,291.860	
TELEFONICA S.A	537,523	4.379	2,353,813.210	
TOTALENERGIES SE	244,535	51.130	12,503,074.550	
VALEO	25,393	25.470	646,759.710	
E.ON SE	208,641	11.940	2,491,173.540	
VOEST-ALPINE AG	9,875	30.580	301,977.500	

HENKEL AG & CO KGAA	10,366	70.450	730,284.700	
SIEMENS AG-REG	74,631	139.500	10,411,024.500	
UPM-KYMMENE OYJ	55,982	32.820	1,837,329.240	
ING GROEP NV-CVA	380,432	12.886	4,902,246.750	
PUMA AG	10,448	87.880	918,170.240	
BAYER AG	94,861	52.770	5,005,814.970	
STORA ENSO OYJ-R SHS	55,548	18.175	1,009,584.900	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,500	73.520	1,286,600.000	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	82,756	74.310	6,149,598.360	
BASF SE	89,592	66.450	5,953,388.400	
BEIERSDORF AG	10,342	87.480	904,718.160	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,032	64.160	900,293.120	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,836	57.820	1,089,097.520	
ASM INTERNATIONAL NV	4,271	273.300	1,167,264.300	
ORANGE	191,727	10.882	2,086,373.210	
SAMPO OYJ-A SHS	49,985	44.300	2,214,335.500	
RANDSTAD NV	11,239	62.920	707,157.880	
ALLIANZ SE	40,157	223.100	8,959,026.700	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.000	1,074,544.000	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	106,390	28.770	3,060,840.300	
HERMES INTL	3,076	1,186.500	3,649,674.000	
ENDESA S.A.	28,639	18.330	524,952.870	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	70,248	7.299	512,740.150	
ERSTE GROUP BANK AG	31,546	41.840	1,319,884.640	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,509	262.600	3,547,463.400	
ARCELOR MITTAL (NL)	63,979	26.340	1,685,206.860	
DASSAULT SYSTEMES SA	64,596	40.275	2,601,603.900	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,877	21.960	502,378.920	
HEINEKEN NV	24,594	93.160	2,291,177.040	
AKZO NOBEL	18,717	91.740	1,717,097.580	
ASML HOLDING NV	40,314	559.700	22,563,745.800	
AEGON NV	189,323	4.805	909,697.010	
VOLKSWAGEN AG	3,153	240.400	757,981.200	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,903	182.700	3,270,878.100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	644,062	5.731	3,691,119.320	
KERING	7,293	616.200	4,493,946.600	
CNP ASSURANCES	13,987	21.830	305,336.210	
FORTUM OYJ	40,820	23.570	962,127.400	
AGEAS	17,055	44.240	754,513.200	
UCB SA	12,778	84.940	1,085,363.320	
NEMETSCHEK SE	4,841	76.600	370,820.600	
CARREFOUR SA	61,189	17.205	1,052,756.740	
NATURGY ENERGY GROUP SA	16,289	24.570	400,220.730	

NOKIA OYJ	510,690	4.875	2,489,613.750	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	88,659	29.285	2,596,378.810	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,629	87.440	2,328,439.760	
SANOFI	110,856	92.200	10,220,923.200	
STMICROELECTRONICS NV	65,099	39.100	2,545,370.900	
ELISA OYJ	13,642	50.680	691,376.560	
BANCO SANTANDER SA	1,674,154	3.346	5,601,719.280	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	46,237	17.020	786,953.740	
QIAGEN N.V.	20,427	42.900	876,318.300	
DEUTSCHE BANK AG-REG	213,285	13.896	2,963,808.360	
BMW VORZUG	6,957	77.550	539,515.350	
ENEL SPA	788,051	6.320	4,980,482.320	
COLRUYT NV	4,673	36.040	168,414.920	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	324,117	17.338	5,619,540.540	
SARTORIUS AG	2,686	411.100	1,104,214.600	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,151	50.440	360,696.440	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	126,618	32.470	4,111,286.460	
RATIONAL AG	479	681.400	326,390.600	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,501	131.850	461,606.850	
BECHTLE AG	7,533	47.080	354,653.640	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	3.080	1,051,656.760	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,943	85.000	1,185,155.000	
TELEPERFORMANCE	5,918	320.400	1,896,127.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,670	157.700	3,101,959.000	
EURAZEO	3,008	70.500	212,064.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,714	92.880	995,116.320	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,667	75.450	804,825.150	
INDITEX	104,255	25.330	2,640,779.150	
ESSILORLUXOTTICA	27,864	164.460	4,582,513.440	
SNAM SPA	198,963	4.747	944,477.360	
CREDIT AGRICOLE SA	114,926	13.560	1,558,396.560	
ORPEA	4,932	37.040	182,681.280	
ENAGAS	23,477	18.600	436,672.200	
WENDEL	2,220	92.900	206,238.000	
TENARIS SA	52,985	11.505	609,592.420	
TELECOM ITALIA SPA	832,580	0.413	343,855.540	
ATLANTIA SPA	45,718	16.175	739,488.650	
PROXIMUS	13,739	18.005	247,370.690	
TERNA SPA	167,140	6.620	1,106,466.800	
BIOMERIEUX	4,612	101.050	466,042.600	
GRIFOLS SA	30,687	14.440	443,120.280	
FERROVIAL SA	46,437	23.800	1,105,200.600	
LANXESS AG	7,194	51.700	371,929.800	
NESTE OYJ	43,290	37.590	1,627,271.100	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	19,572	26.020	509,263.440	
RECORDATI SPA	10,303	44.780	461,368.340	

DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	10.390	574,608.560	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,807	193.850	931,836.950	
KONE OYJ	31,956	54.780	1,750,549.680	
ELIA GROUP	2,862	113.900	325,981.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,456	352.400	865,494.400	
ENGIE	177,463	14.298	2,537,365.970	
ALSTOM	28,533	25.700	733,298.100	
ELECTRICITE DE FRANCE	41,549	8.136	338,042.660	
IPSEN SA	3,646	93.380	340,463.480	
ARKEMA SA	6,009	124.900	750,524.100	
LEGRAND SA	25,978	85.320	2,216,442.960	
AMPLIFON SPA	11,372	34.740	395,063.280	
ADP	2,313	129.350	299,186.550	
ORION OYJ	8,106	34.770	281,845.620	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	38,282	9.986	382,284.050	
SYMRISE AG	12,106	101.250	1,225,732.500	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	47.030	1,139,442.840	
PRYSMIAN SPA	21,822	27.540	600,977.880	
DIASORIN SPA	2,223	119.750	266,204.250	
CAIXABANK	409,723	3.291	1,348,398.390	
BUREAU VERITAS SA	29,810	24.510	730,643.100	
GETLINK	41,525	13.835	574,498.370	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	17.000	475,524.000	
AMADEUS IT GROUP SA	46,767	60.340	2,821,920.780	
BRENTAG SE	16,310	76.580	1,249,019.800	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	28.940	675,459.600	
EDENRED	24,865	38.360	953,821.400	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.649	260,621.860	
LEG IMMOBILIEN SE	6,113	112.650	688,629.450	
KION GROUP AG	7,508	78.100	586,374.800	
VONOVIA SE	70,086	47.310	3,315,768.660	
KNORR-BREMSE AG	6,860	88.100	604,366.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,475	55.360	1,576,376.000	
FERRARI NV	12,050	193.800	2,335,290.000	
CNH INDUSTRIAL NV	106,155	13.945	1,480,331.470	
AROUNDTOWN SA	106,018	5.290	560,835.220	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	36.170	292,687.640	
MONCLER SPA	22,855	54.440	1,244,226.200	
NEXI SPA	43,586	12.645	551,144.970	
PROSUS NV	90,679	67.830	6,150,756.570	
JDE PEET'S BV	7,308	26.270	191,981.160	
SIEMENS ENERGY AG	35,761	18.660	667,300.260	
INPOST SA	20,395	6.289	128,264.150	
EURONEXT NV	9,619	82.650	795,010.350	
IMCD NV	5,359	141.400	757,762.600	

	WORLDLINE SA	23,570	45.480	1,071,963.600	
	NN GROUP NV	28,124	50.440	1,418,574.560	
	FINECOBANK SPA	65,274	15.490	1,011,094.260	
	ARGENX SE	4,255	252.300	1,073,536.500	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	67,941	21.000	1,426,761.000	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	37,831	31.365	1,186,569.310	
	ZALANDO SE	20,857	61.720	1,287,294.040	
	STELLANTIS NV	196,248	16.340	3,206,692.320	
	AENA SME SA	7,076	150.000	1,061,400.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	48,760	39.000	1,901,640.000	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,029	38.395	615,433.450	
	ABN AMRO BANK NV	34,382	12.892	443,252.740	
	EXOR NV	9,966	72.160	719,146.560	
	SCOUT24 SE	9,670	52.320	505,934.400	
	COVESTRO AG	19,158	52.720	1,010,009.760	
	HELLOFRESH SE	16,990	48.840	829,791.600	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	74,093	54.470	4,035,845.710	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	10.795	601,810.450	
	AMUNDI SA	5,924	67.950	402,535.800	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,281	8.876	206,642.150	
	ADYEN NV	1,920	1,877.800	3,605,376.000	
	UNIPER SE	10,427	39.000	406,653.000	
	DELIVERY HERO SE	16,645	43.270	720,229.150	
ユーロ	小計	17,831,375		461,368,079.790 (60,236,216,497)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	16.420	2,692,880.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	79.850	12,935,700.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	53,500	50.950	2,725,825.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	116,440	437.400	50,930,856.000	
	MTR CORP	137,500	42.750	5,878,125.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	167.900	12,726,820.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	120,450	34.750	4,185,637.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	49.900	7,285,400.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,175,456	12.100	14,223,017.600	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	200,000	45.750	9,150,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	353,500	31.800	11,241,300.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	32.800	5,348,564.800	
	SINO LAND CO	505,400	10.280	5,195,512.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	138,500	97.550	13,510,675.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	48.350	2,393,325.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	132,000	133.400	17,608,800.000	

XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	21.600	3,585,600.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	16.080	3,492,576.000	
AIA GROUP LTD	1,175,027	87.200	102,462,354.400	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.880	4,841,600.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	22.000	5,544,000.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	133,000	31.400	4,176,200.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	21.000	2,188,200.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	151,750	35.950	5,455,412.500	
ESR CAYMAN LTD	203,800	26.100	5,319,180.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.880	1,812,400.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	23.050	3,471,330.000	
WH GROUP LTD	897,000	5.730	5,139,810.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	256,332	59.750	15,315,837.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	186,332	52.300	9,745,163.600	
香港・ドル 小計	8,261,353		350,582,101.400 (5,185,109,280)	
合計	106,329,407		598,417,771,479 (598,417,771,479)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年2月15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	101,202.000	1,028,212.320	
		GOODMAN GROUP	158,185.000	3,609,781.700	
		GPT GROUP	207,292.000	1,048,897.520	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,031,171.250	
		SCENTRE GROUP	479,376.000	1,414,159.200	
		STOCKLAND	243,481.000	954,445.520	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	631,908.700	
	オーストラリア・ドル 小計		1,975,372.000	9,718,576.210 (799,936,008)	
シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	248,606.000	703,554.980	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	545,177.000	1,117,612.850	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	348,063.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	484,500.000	838,185.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,470,583.000	3,007,415.830 (257,705,462)	

投資信託受益証券 合計			3,445,955	1,057,641,470 (1,057,641,470)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,320.000	607,627.200	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,788.000	2,531,752.560	
		AMERICAN TOWER CORP	44,301.000	10,379,281.290	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	150,150.000	1,079,578.500	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,356.000	3,180,731.400	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,801.000	1,730,976.950	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,440.000	1,691,593.200	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	42,028.000	7,043,052.240	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,360.000	3,724,790.400	
		DUKE REALTY TRUST	35,306.000	1,925,942.300	
		EQUINIX INC	8,702.000	5,824,944.760	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,573.000	1,268,663.150	
		EQUITY RESIDENTIAL	34,397.000	2,955,390.240	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,132.000	1,939,858.200	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	13,998.000	2,718,551.580	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	49,946.000	1,603,266.600	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	75,616.000	1,355,794.880	
		INVITATION HOMES INC	55,207.000	2,285,569.800	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,241,406.000	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	54,080.000	1,123,782.400	
		MID AMERICA	11,699.000	2,428,478.420	
		PROLOGIS INC	72,030.000	10,468,840.200	
		PUBLIC STORAGE	15,276.000	5,432,756.640	
		REALTY INCOME CORP	53,267.000	3,563,029.630	
		REGENCY CENTERS CORP	14,665.000	955,571.400	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,551.000	3,263,951.850	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	31,871.000	4,458,752.900	
		SUN COMMUNITIES INC	11,066.000	2,093,908.520	
		UDR INC	28,289.000	1,544,862.290	
	VENTAS INC	40,408.000	2,022,824.480		
	VICI PROPERTIES INC	57,882.000	1,629,957.120		
	VORNADO REALTY TRUST	15,123.000	616,111.020		
	WELLTOWER INC	40,744.000	3,246,074.480		
WEYERHAEUSER CO	72,184.000	2,953,047.440			
WP CAREY INC	19,446.000	1,474,395.720			
アメリカ・ドル	小計		1,233,442.000	102,365,115.760 (11,814,981,661)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC		75,770.000	407,945.680	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	583,932.860	
	SEGRO PLC	120,360.000	1,486,446.000	
イギリス・債券 小計		270,158.000	2,478,324.540 (387,213,426)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	456,127.800	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	319,437.240	
カナダ・ドル 小計		21,687.000	775,565.040 (70,328,238)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	337,601.200	
	GECINA SA	4,763.000	530,121.900	
	KLEPIERRE	17,099.000	404,562.340	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	884,503.200	
ユーロ 小計		39,445.000	2,156,788.640 (281,590,325)	
香港・ドル	LINK REIT	199,700.000	13,280,050.000	
香港・ドル 小計		199,700.000	13,280,050.000 (196,411,940)	
投資証券 合計		1,764,432	12,750,525,590 (12,750,525,590)	
合計			13,808,167,060 (13,808,167,060)	

(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)

- 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。
- 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。
- 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 608銘柄	67.70	-	-	72.99
	投資証券 35銘柄	-	-	1.84	
イギリス・債券	株式 79銘柄	4.48	-	-	4.76
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.13	-	-	0.13
オーストラリア・ドル	株式 55銘柄	1.88	-	-	2.11
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.12	-	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.55	-	-	3.74
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.31	-	-	0.36
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.89	-	-	3.03
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	1.04	-	-	1.10
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.70	-	-	0.74
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.06	-	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.21	-	-	0.22

ユーロ	株式	227銘柄	9.37	-	-	9.88
	投資証券	4銘柄	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.81	-	-	0.88
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年2月28日現在

資産総額	289,127,424,411円
負債総額	1,677,604,432円
純資産総額(-)	287,449,819,979円
発行済数量	51,397,553,151口
1口当たり純資産額(/)	5.5927円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年2月28日現在

資産総額	622,188,461,421円
負債総額	1,412,231,590円
純資産総額(-)	620,776,229,831円
発行済数量	110,161,914,051口
1口当たり純資産額(/)	5.6351円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2022年2月28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（2022年2月28日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年2月28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	1,457,224,919,605
追加型株式投資信託	816	14,809,317,410,845
単位型公社債投資信託	28	57,065,906,952
単位型株式投資信託	224	1,299,846,341,843
合計	1,094	17,623,454,579,245

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	1,278,455	1,119,327
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産	3,524,781	3,991,834
ソフトウェア	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	9,482,127	11,153,554
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								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 其他有価証券	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	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
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「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い

- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)・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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2021年5月14日	有価証券報告書
2021年5月14日	有価証券届出書
2021年11月15日	半期報告書
2021年11月15日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年3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 公認会計士 稲葉 宏和
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DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>の2021年2月16日から2022年2月15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、DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>の2022年2月15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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年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。