

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年6月24日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売 出)内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】	One DC 先進国株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集(売 出)内国投資信託受益証券 の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

One DC 先進国株式インデックスファンド  
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

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

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2022年6月25日から2022年12月23日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

#### 振替受益権について

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

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

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

##### <ファンドの特色>

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

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

## 指数の著作権等

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

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

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

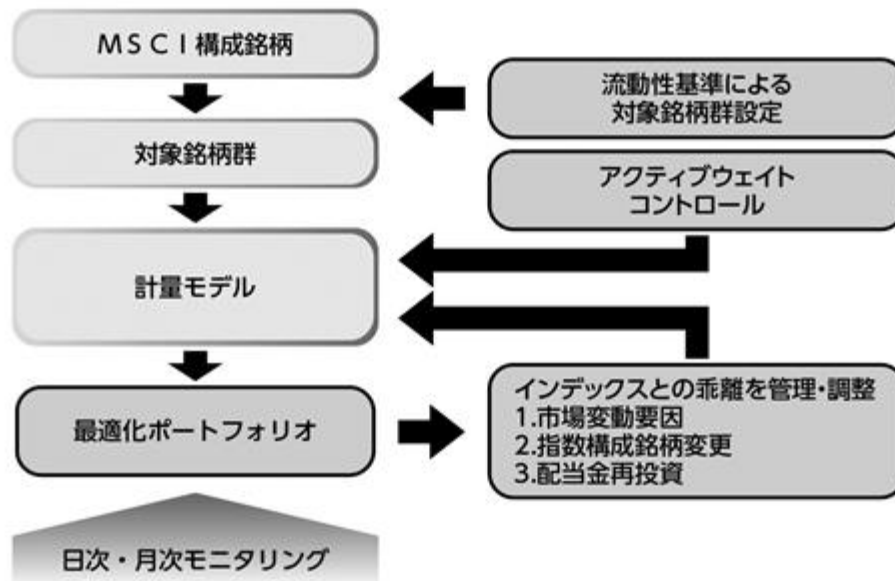
## 2 マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。

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

## 3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

### 運用プロセス

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



※上記はマザーファンドの運用プロセスです。

## ■ 分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

### < 商品分類 >

#### ・ 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ( )	特殊型
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### ・ 商品分類定義

追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいう。



## &lt; 属性区分 &gt;

## ・ 属性区分表

投資対象資産 ( 実際の組入資産 )	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2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4回  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 ) )  資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	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 ( M S C I コクサイ・ インデックス ( 円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジな し ) )

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

(注2) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

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

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

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

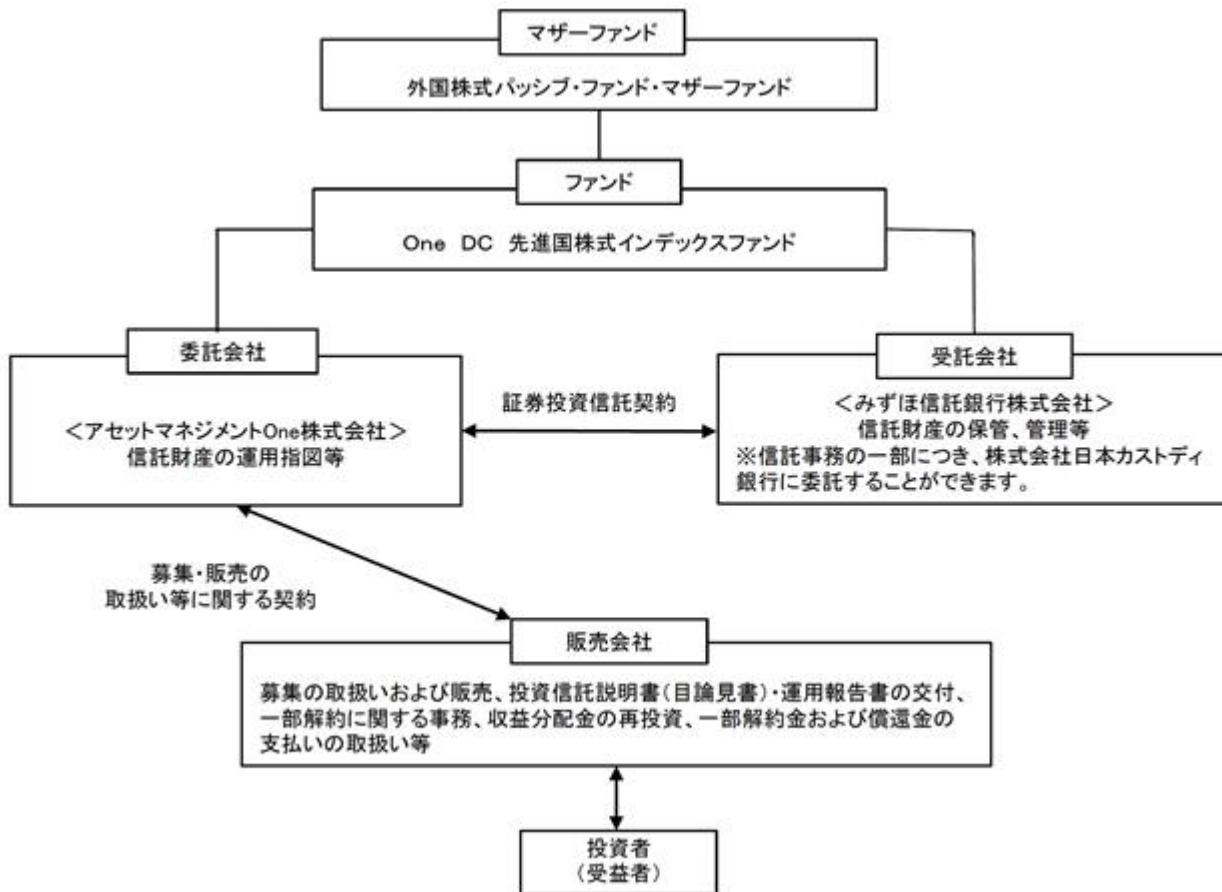
(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券(投資信託証券)への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## (2) 【ファンドの沿革】

2019年4月15日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

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

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

#### ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2022年3月31日現在）

## 委託会社の沿革

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

## 大株主の状況

（2022年3月31日現在）

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

1：A種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

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

#### <投資対象>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

#### <投資態度>

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

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

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

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

### (2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
  6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、次の15.で定めるものを除きます。）
  15. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
  18. 預託証券または預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.

の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	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。 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。 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

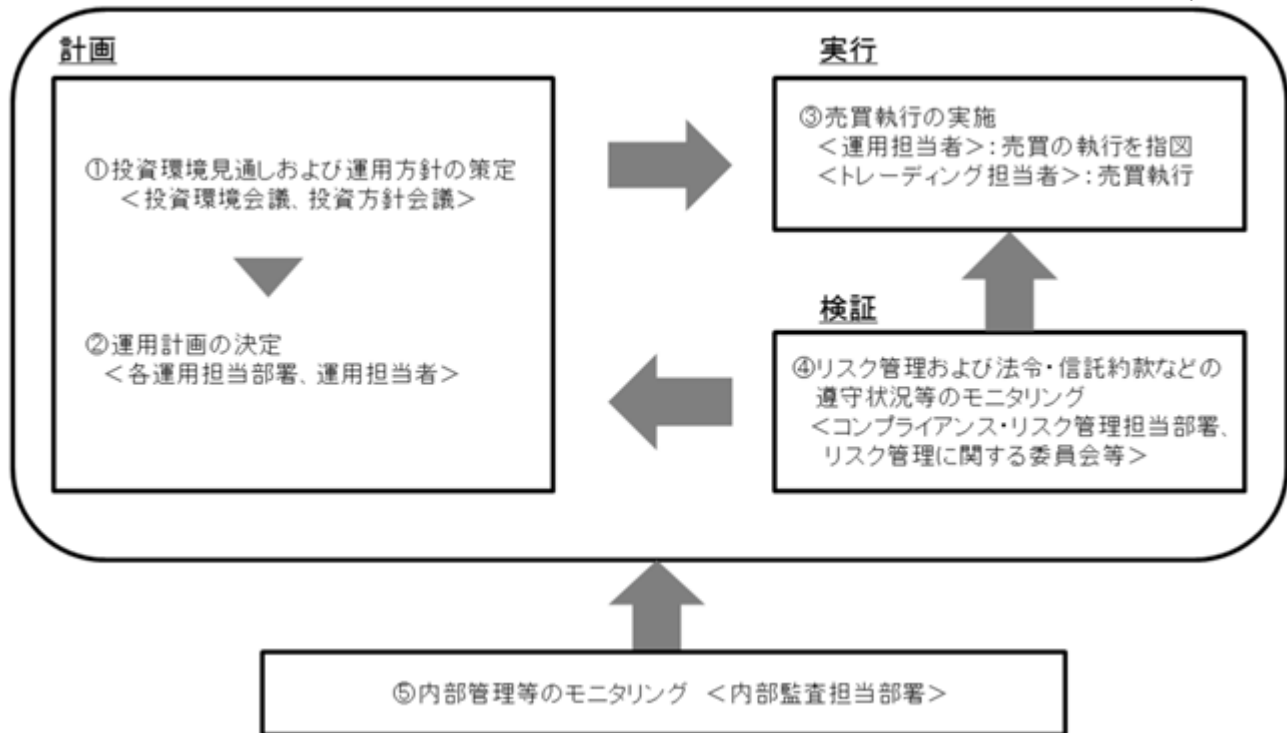
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、原則として信託財産の純資産総額の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





#### 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2022年3月31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3月25日(休業日の場合は翌営業日))に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2)上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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

#### (5)【投資制限】

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

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

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

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

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

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)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

#### 信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

#### 先物取引等の運用指図（約款第23条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
  1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対

象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ 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。

#### スワップ取引の運用指図(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第25条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えるこ

となった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

8) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

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

2) 上記1)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。

3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

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

- 2)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第30条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第31条)

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

#### 資金の借入れ(約款第37条)

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



内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 信用リスク

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

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

#### 流動性リスク

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

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

## カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

### <その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

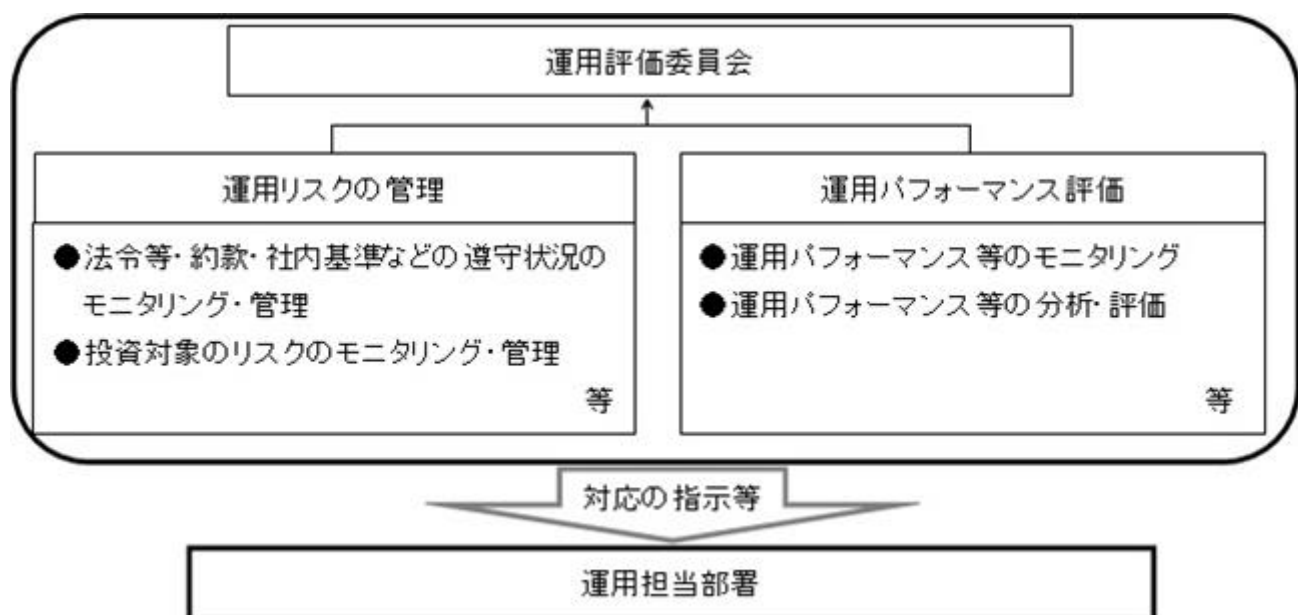
#### 注意事項

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

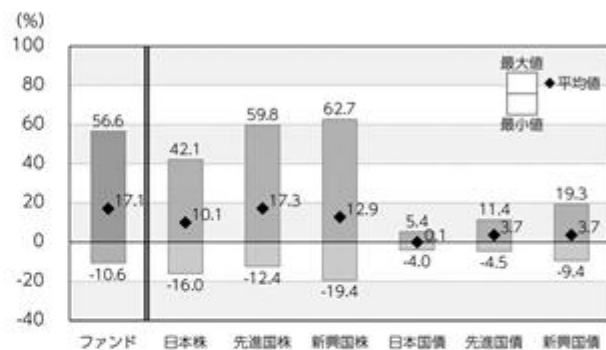
リスク管理体制は2022年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数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0.10989%（税抜0.0999%）

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## ・ 信託財産留保額

ありません。

## ・ その他の費用

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

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

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

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

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

上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

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3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3月31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	14,509,006,885	100.00
内 日本	14,509,006,885	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	219,310	0.00
純資産総額	14,509,226,195	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3月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	736,176,961,668	95.56
内 アメリカ	520,707,165,567	67.59
内 イギリス	31,188,169,716	4.05
内 カナダ	29,148,579,424	3.78
内 スイス	24,925,594,327	3.24
内 フランス	22,850,236,612	2.97
内 ドイツ	18,001,504,773	2.34
内 オーストラリア	16,368,075,108	2.12
内 オランダ	13,693,883,045	1.78
内 アイルランド	13,301,664,244	1.73
内 スウェーデン	7,432,672,960	0.96
内 デンマーク	5,874,363,399	0.76
内 スペイン	5,161,513,910	0.67
内 香港	4,699,317,990	0.61
内 イタリア	3,870,632,187	0.50
内 ジャージー	2,847,766,594	0.37
内 フィンランド	2,558,349,631	0.33
内 シンガポール	2,311,616,912	0.30
内 ベルギー	1,826,781,559	0.24
内 ノルウェー	1,721,496,285	0.22
内 ケイマン諸島	1,651,218,339	0.21
内 イスラエル	1,522,995,381	0.20
内 バミューダ	970,697,840	0.13
内 オランダ領キュラソー	804,281,460	0.10
内 ルクセンブルグ	665,748,909	0.09
内 ニュージーランド	591,421,281	0.08
内 オーストリア	461,214,451	0.06
内 ポルトガル	366,026,510	0.05
内 リベリア	264,456,410	0.03
内 パナマ	223,692,203	0.03
内 マン島	165,824,641	0.02
投資信託受益証券	1,385,208,994	0.18
内 オーストラリア	1,044,038,369	0.14
内 シンガポール	341,170,625	0.04
投資証券	16,738,988,895	2.17

	内 アメリカ	15,608,134,413	2.03
	内 イギリス	475,124,711	0.06
	内 フランス	317,195,899	0.04
	内 香港	255,852,451	0.03
	内 カナダ	82,681,421	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		16,104,402,733	2.09
純資産総額		770,405,562,290	100.00

## その他資産の投資状況

2022年3月31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)		16,269,567,659	2.11
	内 アメリカ	12,234,471,570	1.59
	内 ドイツ	2,318,236,519	0.30
	内 イギリス	713,504,514	0.09
	内 カナダ	624,664,656	0.08
	内 オーストラリア	378,690,400	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3月31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	2,327,511,251	6.0993 14,196,274,091	6.2337 14,509,006,885	- -	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3月31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3月31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	1,802,987	20,623.10 37,183,197,407	21,757.27 39,228,075,506	- -	5.09
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	783,973	36,148.70 28,339,610,323	38,413.32 30,115,009,953	- -	3.91
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	50,168	380,741.62 19,101,045,742	407,071.58 20,421,967,416	- -	2.65
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	93,830	107,903.15 10,124,553,065	133,893.43 12,563,221,109	- -	1.63
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	33,047	331,872.08 10,967,376,680	347,437.06 11,481,752,531	- -	1.49
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	31,433	331,469.74 10,419,088,410	349,165.20 10,975,309,954	- -	1.42
7	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	274,822	29,851.96 8,203,977,698	33,889.79 9,313,660,142	- -	1.21
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	260,172	26,507.39 6,896,481,458	27,886.56 7,255,302,478	- -	0.94
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	103,449	58,379.47 6,039,298,174	63,743.15 6,594,166,138	- -	0.86
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	289,073	20,349.85 5,882,592,870	21,980.02 6,353,830,350	- -	0.82

11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	143,396	38,826.12 5,567,511,248	43,767.88 6,276,140,053	- -	0.81
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	324,495	18,443.21 5,984,732,352	17,200.69 5,581,538,096	- -	0.72
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	183,537	27,389.72 5,027,028,267	27,409.24 5,030,609,773	- -	0.65
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	265,522	19,104.87 5,072,765,702	18,895.79 5,017,248,509	- -	0.65
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	308,983	15,594.88 4,818,553,682	15,981.67 4,938,065,330	- -	0.64
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	465,217	9,703.57 4,514,266,271	10,253.83 4,770,257,985	- -	0.62
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	114,752	42,565.94 4,884,527,139	37,752.41 4,332,165,630	- -	0.56
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	211,722	17,084.65 3,617,197,263	20,253.09 4,288,026,245	- -	0.56
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	96,432	45,317.36 4,370,043,765	44,334.55 4,275,269,672	- -	0.55
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	808,465	5,730.50 4,632,909,380	5,262.76 4,254,765,348	- -	0.55
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	617,383	6,106.14 3,769,827,515	6,418.13 3,962,445,341	- -	0.51
22	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	194,212	17,691.95 3,435,989,609	20,041.36 3,892,273,093	- -	0.51
23	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	45,470	77,301.03 3,514,878,145	85,054.73 3,867,439,027	- -	0.50
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	76,859	45,696.22 3,512,165,873	49,145.83 3,777,299,501	- -	0.49
25	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	45,194	70,989.68 3,208,307,777	77,239.10 3,490,744,115	- -	0.45
26	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	199,836	18,300.69 3,657,138,451	17,252.09 3,447,589,536	- -	0.45
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	450,836	7,432.55 3,350,864,975	7,613.88 3,432,612,060	- -	0.45

28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品 小売り	48,526	62,584.47 3,036,974,222	70,554.16 3,423,711,328	- -	0.44
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	463,112	6,540.92 3,029,182,145	6,859.95 3,176,929,563	- -	0.41
30	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	89,434	29,337.61 2,623,779,968	35,479.63 3,173,085,864	- -	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3月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.56
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.17
合計	97.91

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2022年3月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.25
銀行		5.85
コンピュータ・周辺機器		5.35
半導体・半導体製造装置		4.95
医薬品		4.90
石油・ガス・消耗燃料		4.17
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.15
情報技術サービス		3.78
資本市場		3.21
保険		3.06
インターネット販売・通信販売		3.03
ヘルスケア機器・用品		2.41
自動車		2.27
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.17
化学		2.00
電力		1.73
ホテル・レストラン・レジャー		1.73
バイオテクノロジー		1.73
金属・鉱業		1.72
飲料		1.61
機械		1.59
食品		1.53
食品・生活必需品小売り		1.50
専門小売り		1.48
航空宇宙・防衛		1.47
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.45
繊維・アパレル・贅沢品		1.34
各種電気通信サービス		1.21

娯楽	1.18
陸運・鉄道	1.15
各種金融サービス	1.06
家庭用品	1.06
コングロマリット	0.98
メディア	0.91
総合公益事業	0.87
電気設備	0.80
通信機器	0.68
専門サービス	0.68
タバコ	0.64
航空貨物・物流サービス	0.60
電子装置・機器・部品	0.54
建設関連製品	0.53
パーソナル用品	0.52
複合小売り	0.48
消費者金融	0.46
商業サービス・用品	0.43
不動産管理・開発	0.38
商社・流通業	0.34
家庭用耐久財	0.28
無線通信サービス	0.27
容器・包装	0.26
エネルギー設備・サービス	0.23
建設資材	0.23
建設・土木	0.21
自動車部品	0.19
ガス	0.13
運送インフラ	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
水道	0.11
紙製品・林産品	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
販売	0.09
海運業	0.08
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	95.56

（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3月31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 Jun22	買建	435	11,447,294,889	12,234,471,570	1.59
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun22	買建	439	2,242,181,081	2,318,236,519	0.30
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun22	買建	59	687,347,017	713,504,514	0.09
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun22	買建	24	611,289,753	624,664,656	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun22	買建	22	363,963,500	378,690,400	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3月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2020年3月25日)	617	617	0.8135	0.8135
第2計算期間末 (2021年3月25日)	3,594	3,594	1.2920	1.2920
第3計算期間末 (2022年3月25日)	13,965	13,965	1.6365	1.6365
2021年3月末日	3,798	-	1.3333	-
4月末日	4,291	-	1.3957	-
5月末日	5,308	-	1.4160	-
6月末日	6,350	-	1.4512	-
7月末日	7,229	-	1.4716	-
8月末日	7,829	-	1.5077	-
9月末日	7,815	-	1.4724	-
10月末日	8,678	-	1.5801	-
11月末日	9,536	-	1.5739	-
12月末日	10,219	-	1.6379	-
2022年1月末日	12,440	-	1.5230	-
2月末日	12,560	-	1.5126	-
3月末日	14,509	-	1.6731	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
--	--------------



第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	18.7
第2計算期間	58.8
第3計算期間	26.7

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	940,446,792	181,390,647
第2計算期間	2,509,518,622	486,240,064
第3計算期間	7,129,990,610	1,378,344,523

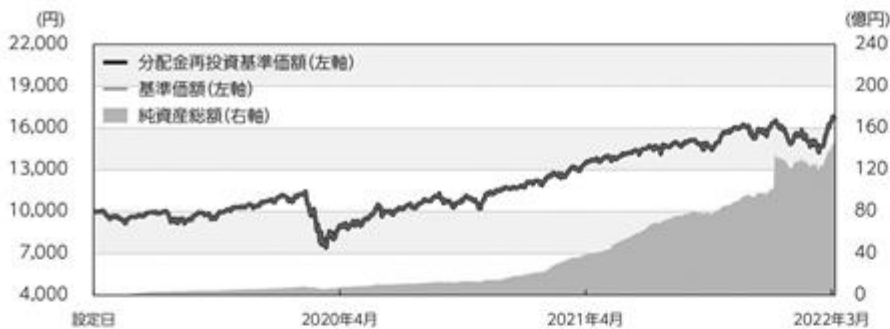
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2022年3月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2019年4月15日~2022年3月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2019年4月15日)

## 分配の推移(税引前)

2020年 3月	0円
2021年 3月	0円
2022年 3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	95.56
内 アメリカ	67.59
内 イギリス	4.05
内 カナダ	3.78
内 スイス	3.24
内 フランス	2.97
内 その他	13.93
投資信託受益証券	0.18
内 オーストラリア	0.14
内 シンガポール	0.04
投資証券	2.17
内 アメリカ	2.03
内 イギリス	0.06
内 フランス	0.04
内 香港	0.03
内 カナダ	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.09
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	5.09
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.91
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.65
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.63
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.49
6	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.42
7	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.21
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	0.94
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	0.86
10	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.82

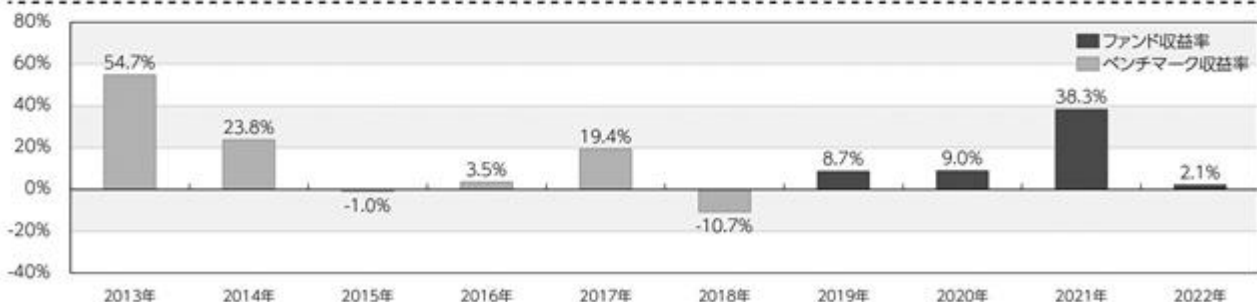
その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.11

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	ソフトウェア	7.25
2	銀行	5.85
3	コンピュータ・周辺機器	5.35
4	半導体・半導体製造装置	4.95
5	医薬品	4.90

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2019年は設定日から年末までの収益率、および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。

※2018年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」です。

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

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

1円以上1円単位とします。

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

1口単位とします。

・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。  
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は、2019年4月15日(設定日)から原則として無期限です。

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

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年3月26日から翌年3月25日までとします。

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

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

g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### ロ．信託約款の変更等

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

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

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

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



#### 4【受益者の権利等】

##### (1) 収益分配金請求権

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

##### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### (3) 一部解約請求権

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

##### (4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2021年3月26日から2022年3月25日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【One DC 先進国株式インデックスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2021年3月25日現在	第3期 2022年3月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	14,128,493	40,272,848
親投資信託受益証券	3,594,842,899	13,965,363,091
流動資産合計	3,608,971,392	14,005,635,939
資産合計	3,608,971,392	14,005,635,939
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,940,368	34,108,639
未払受託者報酬	219,838	1,155,731
未払委託者報酬	878,371	4,617,263
その他未払費用	35,097	184,830
流動負債合計	14,073,674	40,066,463
負債合計	14,073,674	40,066,463
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,782,334,703	8,533,980,790
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	812,563,015	5,431,588,686
（分配準備積立金）	421,395,305	1,779,239,258
元本等合計	3,594,897,718	13,965,569,476
純資産合計	3,594,897,718	13,965,569,476
負債純資産合計	3,608,971,392	14,005,635,939

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	2020年3月26日 至 2021年3月25日	自	2021年3月26日 至 2022年3月25日
<b>営業収益</b>				
受取利息		4		112
有価証券売買等損益		607,977,803		1,600,025,192
営業収益合計		607,977,807		1,600,025,304
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,194		3,187
受託者報酬		330,162		1,832,012
委託者報酬		1,340,457		7,319,138
その他費用		52,936		292,953
営業費用合計		1,724,749		9,447,290
営業利益又は営業損失( )		606,253,058		1,590,578,014
経常利益又は経常損失( )		606,253,058		1,590,578,014
当期純利益又は当期純損失( )		606,253,058		1,590,578,014
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( )		87,875,504		144,608,518
期首剰余金又は期首欠損金( )		141,553,253		812,563,015
剰余金増加額又は欠損金減少額		435,738,714		3,727,209,001
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		30,198,319		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		405,540,395		3,727,209,001
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		554,152,826
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		554,152,826
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( )		812,563,015		5,431,588,686

## (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3期	
	自 2021年3月26日	至 2022年3月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	2021年3月25日現在	2022年3月25日現在
1. 期首元本額	759,056,145円	2,782,334,703円
期中追加設定元本額	2,509,518,622円	7,129,990,610円
期中一部解約元本額	486,240,064円	1,378,344,523円
2. 受益権の総数	2,782,334,703口	8,533,980,790口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2020年3月26日 至 2021年3月25日	自 2021年3月26日 至 2022年3月25日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,866,697円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(390,421,287円)、信託約款に規定される収益調整金(391,167,710円)及び分配準備積立金(5,107,321円)より分配対象収益は812,563,015円(1万口当たり2,920.43円)ですが、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(129,703,538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(1,316,265,958円)、信託約款に規定される収益調整金(3,652,349,428円)及び分配準備積立金(333,269,762円)より分配対象収益は5,431,588,686円(1万口当たり6,364.66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2期	第3期
	自 2020年3月26日 至 2021年3月25日	自 2021年3月26日 至 2022年3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	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2期 2021年3月25日現在	第3期 2022年3月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期 2021年3月25日現在	第3期 2022年3月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	593,672,103	1,582,799,553
合計	593,672,103	1,582,799,553

（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2期 2021年3月25日現在	第3期 2022年3月25日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2920円 (12,920円)

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年3月25日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,290,455,142	13,965,363,091	
親投資信託受益証券	合計	2,290,455,142	13,965,363,091	
合計			13,965,363,091	

（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3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	34,741,308,948
コール・ローン	329,263,307
株式	720,697,242,100
投資信託受益証券	1,350,500,986
投資証券	15,931,520,159
派生商品評価勘定	691,688,411
未収入金	5,489,863
未収配当金	1,165,877,442
差入委託証拠金	4,111,481,766
流動資産合計	779,024,372,982
資産合計	
779,024,372,982	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,139,968
未払金	26,988,885,264
未払解約金	66,526,000
流動負債合計	27,057,551,232
負債合計	
27,057,551,232	
純資産の部	
元本等	
元本	123,328,925,650
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	628,637,896,100
元本等合計	751,966,821,750
純資産合計	
751,966,821,750	
負債純資産合計	
779,024,372,982	



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年3月26日 至 2022年3月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年3月25日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	104,889,479,890円
同期中追加設定元本額	103,031,930,311円
同期中一部解約元本額	84,592,484,551円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,391,148,011円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,190,189円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	14,560,439円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	78,285,813円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	19,774,288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)	11,052,667円
たわらノーロード 先進国株式	30,475,466,362円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	388,354,778円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,827,744,040円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	604,832,032円
たわらノーロード バランス(堅実型)	70,183,214円
たわらノーロード バランス(標準型)	577,517,679円
たわらノーロード バランス(積極型)	708,913,564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)	978,767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)	444,836,688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)	334,732,241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)	496,446,086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)	1,240,682円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	19,992,924円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,417,953円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,811,667円
たわらノーロード 全世界株式	251,751,712円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,504,740,436円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,290,455,142円
Oneグローバルバランス	1,609,886円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	156,950,758円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	786,004,660円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,008,795,887円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	96,620,801円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	265,136,966円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	248,861,251円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,707,695円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	688,599,498円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	134,292,551円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	171,657,937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)	307,636,538円
投資のソムリエ	6,692,652,207円
クルーズコントロール	20,585,230円
投資のソムリエ<DC年金>	405,758,296円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	189,274,749円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	150,045,351円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	208,588,172円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,399,002,739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)	217,571,884円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	27,383,489円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	13,516,135円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,721,471円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	48,523,178円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	99,320,181円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	246,893,106円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	165,831,146円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	25,532,209円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,851,451円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,748,372円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	33,197,966円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	802,225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)	9,268,070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)	9,535,221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)	3,567,658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)	5,746,722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)	9,098,436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)	43,260,162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)	8,287,986円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	991,867,776円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	63,315,785円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,191,119,239円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,189,289,414円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,081,796,406円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	170,633,224円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	8,157,951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)	15,701,451円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,826,759円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	20,058,840円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	28,742,911円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,177,897円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,677,704円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,721,211円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,543,805円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	457,827円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,850,869円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,053,955円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	198,795,672円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	300,531,972円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	981,894,426円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	80,923,036円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	45,557,973円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	321,405,112円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	13,275,132円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,498,399円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	126,001,232円

D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,183,083円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	40,068,986円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	62,430,474円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	125,815,330円
動的パッケージファンド<DC年金>	2,361,170円
コア資産形成ファンド	1,604,080円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,790,582,610円
MHAM外国株式インデックスファンド	138,672,540円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	16,038,581円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	316,953,248円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,864,966,172円
計	123,328,925,650円
2. 受益権の総数	123,328,925,650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3月26日 至 2022年3月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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3月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年3月25日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	10,838,096,485	
投資信託受益証券	30,054,587	
投資証券	413,445,334	
合計	11,281,596,406	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年2月16日から2022年3月25日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2022年3月25日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	352,834,859	-	-	352,840,679	5,820
アメリカ・ドル	280,738,000	-	-	280,740,300	2,300
イギリス・ポンド	16,252,011	-	-	16,253,243	1,232
カナダ・ドル	13,524,283	-	-	13,524,839	556
ユーロ	42,320,565	-	-	42,322,297	1,732
合計	352,834,859	-	-	352,840,679	5,820

## (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3月25日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	13,347,999,995	-		14,037,542,618	689,542,623
合計	13,347,999,995	-		14,037,542,618	689,542,623

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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3月25日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.0972円 (60,972円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年3月25日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	50,168	3,272.990	164,199,362.320	
	ABBOTT LABORATORIES	194,477	117.820	22,913,280.140	
	AES CORP	69,518	24.240	1,685,116.320	
	ABIOMED INC	5,195	321.470	1,670,036.650	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	98,467	129.250	12,726,859.750	
	ADVANCED MICRO DEVICES	179,887	120.530	21,681,780.110	
	ADOBE INC	52,426	432.140	22,655,371.640	
	CHUBB LTD	47,353	213.190	10,095,186.070	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,587	242.410	5,960,134.670	
	ALLEGHANY CORP	1,610	849.540	1,367,759.400	

ALLSTATE CORP	31,858	138.750	4,420,297.500	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	75,588	194.690	14,716,227.720	
AMGEN INC	61,846	236.870	14,649,462.020	
HESS CORP	30,949	106.510	3,296,377.990	
AMERICAN EXPRESS CO	72,485	188.890	13,691,691.650	
AMERICAN ELECTRIC POWER	53,809	96.440	5,189,339.960	
AFLAC INC	69,897	64.490	4,507,657.530	
AMERICAN INTL GROUP	91,992	63.160	5,810,214.720	
AMERCO	980	620.070	607,668.600	
ANALOG DEVICES	59,057	164.960	9,742,042.720	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	76,154	65.580	4,994,179.320	
VALERO ENERGY CORP	43,931	96.440	4,236,705.640	
ANSYS INC	9,632	310.960	2,995,166.720	
APPLE INC	1,802,987	174.070	313,845,947.090	
APPLIED MATERIALS INC	98,977	138.590	13,717,222.430	
ALBEMARLE CORP	13,127	214.150	2,811,147.050	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	62,008	90.430	5,607,383.440	
AMEREN CORP	29,225	89.550	2,617,098.750	
ARROW ELECTRONICS INC	8,479	125.970	1,068,099.630	
AUTODESK INC	23,622	213.050	5,032,667.100	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	46,347	216.950	10,054,981.650	
AUTOZONE INC	2,325	2,013.610	4,681,643.250	
AVERY DENNISON CORP	8,463	166.820	1,411,797.660	
BALL CORP	36,110	92.950	3,356,424.500	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	143,396	352.370	50,528,448.520	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,453	52.040	4,394,934.120	
BAXTER INTERNATIONAL INC	53,593	77.680	4,163,104.240	
BECTON DICKINSON & CO	31,363	263.090	8,251,291.670	
AMETEK INC	25,989	132.500	3,443,542.500	
VERIZON COMM INC	455,118	51.000	23,211,018.000	
WR BERKLEY CORP	23,787	65.340	1,554,242.580	
BEST BUY CO INC	24,718	96.710	2,390,477.780	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	567.700	1,395,974.300	
YUM! BRANDS INC	32,468	119.700	3,886,419.600	
FIRSTENERGY CORP	60,981	43.910	2,677,675.710	
BOEING CO	61,574	189.050	11,640,564.700	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	117.120	1,393,376.640	
BORGWARNER INC	27,800	38.520	1,070,856.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	157,548	42.870	6,754,082.760	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,979	106.370	1,380,576.230	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,635	150.500	1,901,567.500	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,566	1,379.500	3,539,797.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	244,317	72.410	17,690,993.970	
ONEOK INC	47,748	70.430	3,362,891.640	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	147.070	1,160,529.370	
UNITED RENTALS INC	7,998	358.980	2,871,122.040	
SEMPRA ENERGY	34,200	158.860	5,433,012.000	
FEDEX CORP	27,905	225.120	6,281,973.600	
VERISIGN INC	10,834	215.110	2,330,501.740	
AMPHENOL CORP	66,623	75.420	5,024,706.660	
BROWN-FORMAN CORP	35,212	66.430	2,339,133.160	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.500	661,472.500	
CSX CORP	244,684	36.680	8,975,009.120	
COTERRA ENERGY INC	83,065	27.030	2,245,246.950	
CAMPBELL SOUP CO	21,404	43.320	927,221.280	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,281	226.460	4,139,915.260	
CARDINAL HEALTH INC	31,396	57.270	1,798,048.920	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	93,250	18.490	1,724,192.500	
CATERPILLAR INC	59,525	222.210	13,227,050.250	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	139.290	1,510,600.050	
CITRIX SYSTEMS INC	14,230	100.860	1,435,237.800	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	10.890	1,057,124.970	
CERNER CORP	32,630	93.650	3,055,799.500	
JPMORGAN CHASE & CO	324,495	140.690	45,653,201.550	
CHURCH & DWIGHT CO INC	25,740	97.240	2,502,957.600	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,116	134.820	2,307,579.120	
CINTAS CORP	9,996	410.410	4,102,458.360	
CISCO SYSTEMS INC	463,112	54.500	25,239,604.000	
CLOROX COMPANY	13,725	134.100	1,840,522.500	
COCA-COLA CO/THE	450,836	60.980	27,491,979.280	
COPART INC	23,200	126.640	2,938,048.000	
COGNEX CORP	20,432	74.130	1,514,624.160	
COLGATE-PALMOLIVE CO	87,757	73.650	6,463,303.050	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	30,865	171.980	5,308,162.700	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,572	337.500	2,218,050.000	
NRG ENERGY, INC.	23,951	36.450	873,013.950	
COMCAST CORP-CL A	500,440	46.800	23,420,592.000	
CONAGRA BRANDS INC	54,302	32.280	1,752,868.560	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,437	91.410	3,513,526.170	
CMS ENERGY CORP	32,783	68.050	2,230,883.150	
COOPER COS INC	5,622	411.940	2,315,926.680	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	22,195	52.920	1,174,559.400	



CORNING INC	87,516	38.350	3,356,238.600	
SEALED AIR CORP	17,099	67.220	1,149,394.780	
HEICO CORP-CL A	7,767	127.130	987,418.710	
CUMMINS INC	16,065	209.240	3,361,440.600	
DR HORTON INC	38,194	78.830	3,010,833.020	
DANAHER CORP	70,812	286.530	20,289,762.360	
MOODY'S CORP	18,536	329.500	6,107,612.000	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	57,939	91.190	5,283,457.410	
TARGET CORP	52,747	217.040	11,448,208.880	
DEERE & CO	32,407	432.220	14,006,953.540	
MORGAN STANLEY	147,990	92.130	13,634,318.700	
REPUBLIC SERVICES INC	24,944	130.190	3,247,459.360	
COSTAR GROUP INC	43,151	67.440	2,910,103.440	
THE WALT DISNEY CO	199,836	138.960	27,769,210.560	
DOLLAR TREE INC	24,098	156.850	3,779,771.300	
DOVER CORP	16,291	157.230	2,561,433.930	
OMNICOM GROUP	23,813	83.990	2,000,053.870	
DTE ENERGY CO	21,376	127.790	2,731,639.040	
DUKE ENERGY CORP	84,611	107.470	9,093,144.170	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	132.400	1,845,523.600	
EBAY INC	67,552	57.230	3,866,000.960	
BANK OF AMERICA CORP	808,465	43.070	34,820,587.550	
CITIGROUP INC	218,163	56.420	12,308,756.460	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	110.640	1,561,241.040	
EATON CORP PLC	42,576	153.200	6,522,643.200	
CADENCE DESIGN SYS INC	29,947	162.120	4,855,007.640	
DISH NETWORK CORP	24,416	30.900	754,454.400	
ECOLAB INC	27,896	176.260	4,916,948.960	
PERKINELMER INC	12,304	179.340	2,206,599.360	
ELECTRONIC ARTS INC	31,297	125.570	3,929,964.290	
SALESFORCE.COM INC	107,934	213.980	23,095,717.320	
ERIE INDEMNITY CO	2,431	177.770	432,158.870	
EMERSON ELECTRIC CO	65,594	97.770	6,413,125.380	
ATMOS ENERGY CORP	15,336	115.670	1,773,915.120	
ENTERGY CORP	21,918	112.730	2,470,816.140	
EOG RESOURCES INC	64,412	121.010	7,794,496.120	
EQUIFAX INC	13,653	236.530	3,229,344.090	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	25,477	276.680	7,048,976.360	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	17,397	103.870	1,807,026.390	
EXXON MOBIL CORP	465,217	83.380	38,789,793.460	
FMC CORP	12,931	133.850	1,730,814.350	
NEXTERA ENERGY INC	215,962	83.700	18,076,019.400	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,101	419.390	1,719,918.390	
FAIR ISAAC CORP	2,962	465.170	1,377,833.540	
ASSURANT INC	5,823	182.870	1,064,852.010	
FASTENAL CO	62,823	57.350	3,602,899.050	
FIFTH THIRD BANCORP	76,312	45.850	3,498,905.200	

M&T BANK CORP	14,191	179.690	2,549,980.790	
FISERV INC	65,840	98.700	6,498,408.000	
FORD MOTOR CO	432,243	16.830	7,274,649.690	
FRANKLIN RESOURCES INC	29,162	27.600	804,871.200	
FREEMPORT-MCMORAN INC	162,036	51.450	8,336,752.200	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	684.070	868,768.900	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23,216	166.270	3,860,124.320	
DENTSPLY SIRONA INC	21,462	49.190	1,055,715.780	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,170	241.000	6,306,970.000	
GENERAL MILLS INC	65,491	66.360	4,345,982.760	
GENUINE PARTS CO	16,144	128.090	2,067,884.960	
GILEAD SCIENCES INC	137,962	59.140	8,159,072.680	
GARTNER INC	8,920	296.240	2,642,460.800	
MCKESSON CORP	16,959	303.950	5,154,688.050	
NVIDIA CORP	274,822	281.500	77,362,393.000	
GENERAL ELECTRIC CO	120,918	94.120	11,380,802.160	
WW GRAINGER INC	4,840	501.240	2,426,001.600	
HALLIBURTON CO	96,275	37.680	3,627,642.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	44,535	78.560	3,498,669.600	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	37,089	336.230	12,470,434.470	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,020	256.880	5,399,617.600	
HASBRO INC	14,977	85.500	1,280,533.500	
HENRY SCHEIN INC	15,048	87.890	1,322,568.720	
HEICO CORP	5,185	155.090	804,141.650	
HERSHEY FOODS CORP	15,684	211.240	3,313,088.160	
HP INC	123,459	38.530	4,756,875.270	
F5 INC	6,924	208.660	1,444,761.840	
CROWN HOLDINGS INC NPR	14,587	128.480	1,874,137.760	
JUNIPER NETWORKS INC	37,136	35.660	1,324,269.760	
HOLOGIC INC	28,297	75.190	2,127,651.430	
HOME DEPOT INC	114,752	315.780	36,236,386.560	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,012	80.880	1,618,570.560	
HORMEL FOODS CORP	30,733	50.260	1,544,640.580	
CENTERPOINT ENERGY INC	71,846	29.780	2,139,573.880	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	261.390	941,526.780	
HUMANA INC	14,200	437.420	6,211,364.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	208.440	1,911,603.240	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	163,175	15.140	2,470,469.500	
BIOGEN INC	16,349	213.010	3,482,500.490	
IDEX CORP	7,766	194.210	1,508,234.860	
ILLINOIS TOOL WORKS	34,544	210.690	7,278,075.360	
INTUIT INC	29,681	465.630	13,820,364.030	
IDEXX LABORATORIES INC	9,134	540.390	4,935,922.260	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25,943	154.730	4,014,160.390	

INTEL CORP	446,887	51.620	23,068,306.940	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27,504	127.980	3,519,961.920	
INTERNATIONAL PAPER CO	41,902	45.240	1,895,646.480	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	44,364	35.970	1,595,773.080	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	13,899	138.620	1,926,679.380	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	189.330	1,543,418.160	
INCYTE CORP	19,005	78.190	1,486,000.950	
JOHNSON & JOHNSON	289,073	175.240	50,657,152.520	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	38,109	71.640	2,730,128.760	
KLA CORPORATION	16,698	365.890	6,109,631.220	
DEVON ENERGY CORP	71,171	61.540	4,379,863.340	
KELLOGG CO	29,228	61.790	1,805,998.120	
KEYCORP	105,421	23.600	2,487,935.600	
KIMBERLY-CLARK CORP	36,242	120.090	4,352,301.780	
BLACKROCK INC/NEW YORK	16,688	738.280	12,320,416.640	
KROGER CO	75,628	56.750	4,291,889.000	
LAM RESEARCH CORP	15,473	556.220	8,606,392.060	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,157	467.930	2,413,115.010	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,772	152.960	1,647,685.120	
AKAMA I TECHNOLOGIES	17,689	117.380	2,076,334.820	
PLUG POWER INC	56,149	28.460	1,598,000.540	
LENNAR CORP	30,688	83.880	2,574,109.440	
ELI LILLY & CO	89,434	287.690	25,729,267.460	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	49.780	1,401,605.680	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	66.040	1,184,559.480	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	80,179	214.660	17,211,224.140	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,470	136.410	4,429,232.700	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,268	449.730	12,263,237.640	
LOEWS CORP	23,530	64.610	1,520,273.300	
LOWE'S COS INC	74,028	219.170	16,224,716.760	
DOMINION ENERGY INC	89,405	82.300	7,358,031.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	42.160	1,703,306.160	
MCCORMICK & CO INC	28,235	96.650	2,728,912.750	
MCDONALD'S CORPORATION	82,052	240.260	19,713,813.520	
S&P GLOBAL INC	38,996	407.670	15,897,499.320	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	295.000	1,313,930.000	
MARKEL CORPORATION	1,506	1,504.210	2,265,340.260	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	69,140	109.460	7,568,064.400	
MARSH & MCLENNAN COS	55,909	164.170	9,178,580.530	

MASCO CORP	24,668	52.920	1,305,430.560	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	6,858	383.900	2,632,786.200	
METLIFE INC	76,528	70.190	5,371,500.320	
MEDTRONIC PLC	147,793	106.350	15,717,785.550	
ACTIVISION BLIZZARD INC	85,934	79.620	6,842,065.080	
CVS HEALTH CORP	145,102	108.050	15,678,271.100	
MERCK & CO. INC.	277,738	80.410	22,332,912.580	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,958	63.580	3,049,169.640	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,705	271.440	2,905,765.200	
MICROSOFT CORP	783,973	304.100	238,406,189.300	
MICRON TECH INC	123,201	78.210	9,635,550.210	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,470	77.680	4,619,629.600	
3M CO	63,252	148.980	9,423,282.960	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	135.030	852,174.330	
ENTEGRIS INC	14,422	136.270	1,965,285.940	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	281.050	1,567,696.900	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,189	231.040	4,202,386.560	
ILLUMINA INC	16,449	343.050	5,642,829.450	
XCEL ENERGY INC	58,007	69.880	4,053,529.160	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	94.050	946,237.050	
NETAPP INC	24,953	86.300	2,153,443.900	
NEWELL BRANDS INC	41,984	21.880	918,609.920	
NEWMONT CORP	88,388	78.230	6,914,593.240	
NOVAVAX INC	8,342	81.450	679,455.900	
NVR INC	376	4,739.650	1,782,108.400	
NIKE INC-CL B	140,531	132.080	18,561,334.480	
NORDSON CORP	6,065	227.090	1,377,300.850	
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,894	279.550	7,518,217.700	
EVERSOURCE ENERGY	37,428	85.420	3,197,099.760	
NISOURCE INC	45,459	30.540	1,388,317.860	
NORTHERN TRUST CORP	21,751	116.590	2,535,949.090	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,618	454.570	7,554,044.260	
WELLS FARGO & CO	438,126	51.330	22,489,007.580	
NUCOR CORP	31,778	153.520	4,878,558.560	
CHENIERE ENERGY INC	25,939	141.570	3,672,184.230	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,799	135.070	6,186,070.930	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	103,065	57.750	5,952,003.750	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,909	316.670	3,454,553.030	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,456	700.240	5,220,989.440	
ORACLE CORP	180,547	82.240	14,848,185.280	
PACCAR INC	37,599	88.950	3,344,431.050	

PTC INC	11,726	108.010	1,266,525.260	
EXELON CORP	107,970	44.470	4,801,425.900	
PARKER HANNIFIN CORP	14,240	289.140	4,117,353.600	
PAYCHEX INC	34,695	127.740	4,431,939.300	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,332	436.260	3,634,918.320	
PPL CORPORATION	85,923	27.330	2,348,275.590	
PEPSICO INC	151,850	164.470	24,974,769.500	
PENTAIR PLC	17,214	55.430	954,172.020	
PFIZER INC	617,383	52.590	32,468,171.970	
ESSENTIAL UTILITIES INC	27,898	48.910	1,364,491.180	
CONOCOPHILLIPS	145,088	104.540	15,167,499.520	
PG&E CORP	161,265	11.820	1,906,152.300	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	25,590	251.260	6,429,743.400	
ALTRIA GROUP INC	201,649	52.500	10,586,572.500	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,451	193.250	8,976,655.750	
BROWN & BROWN INC	26,763	68.990	1,846,379.370	
GARMIN LTD	17,341	116.820	2,025,775.620	
PPG INDUSTRIES INC	26,706	129.510	3,458,694.060	
IPG PHOTONICS CORP	3,586	115.370	413,716.820	
COSTCO WHOLESALE CORP	48,526	558.110	27,082,845.860	
T ROWE PRICE GROUP INC	25,043	148.770	3,725,647.110	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	141.990	1,852,685.520	
PROCTER & GAMBLE CO	265,522	151.080	40,115,063.760	
PROGRESSIVE CORP	64,561	114.100	7,366,410.100	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,393	67.540	3,808,783.220	
PULTE GROUP INC	29,380	44.570	1,309,466.600	
GLOBAL PAYMENTS INC	32,283	134.930	4,355,945.190	
QUALCOMM INC	123,077	158.460	19,502,781.420	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	20,402	107.150	2,186,074.300	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	67.110	1,266,097.260	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,659	679.760	7,925,321.840	
RESMED INC	15,598	241.370	3,764,889.260	
US BANCORP	154,911	56.050	8,682,761.550	
SEAGEN INC	14,899	141.270	2,104,781.730	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	39,388	47.130	1,856,356.440	
ROSS STORES INC	38,805	90.420	3,508,748.100	
ROLLINS INC	25,920	33.540	869,356.800	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,669	461.450	5,384,660.050	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,593	275.000	3,463,075.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,519	76.870	2,038,515.530	
RPM INTERNATIONAL INC	13,691	79.880	1,093,637.080	
ACCENTURE PLC-CL A	69,410	325.290	22,578,378.900	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC	153,612	60.850	9,347,290.200	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,092	234.690	3,072,561.480	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	27,241	184.220	5,018,337.020	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	67,540	96.410	6,511,531.400	
BOOKING HOLDINGS INC	4,531	2,261.990	10,249,076.690	
SCHLUMBERGER LTD	155,685	42.640	6,638,408.400	
SCHWAB (CHARLES) CORP	159,534	90.930	14,506,426.620	
POOL CORP	4,438	450.520	1,999,407.760	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,960	124.150	2,850,484.000	
BUNGE LTD	14,313	113.990	1,631,538.870	
SEI INVESTMENTS CO	14,981	60.280	903,054.680	
ANTHEM INC	26,665	473.730	12,632,010.450	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,728	152.610	2,705,470.080	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	30,244	71.850	2,173,031.400	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	27,607	249.930	6,899,817.510	
CENTENE CORP	62,490	84.710	5,293,527.900	
SVB FINANCIAL GROUP	6,303	576.910	3,636,263.730	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	66.230	983,912.880	
SNAP-ON INC	6,252	206.910	1,293,601.320	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40,770	119.160	4,858,153.200	
ADVANCE AUTO PARTS	7,015	214.670	1,505,910.050	
EDISON INTERNATIONAL	43,001	66.960	2,879,346.960	
SOUTHERN CO	116,718	69.300	8,088,557.400	
TRUIST FINANCIAL CORP	147,441	58.790	8,668,056.390	
SOUTHWEST AIRLINES	14,171	43.920	622,390.320	
AT&T INC	785,557	23.330	18,327,044.810	
CHEVRON CORP	211,722	166.300	35,209,368.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,045	138.740	2,503,563.300	
STATE STREET CORP	39,623	89.010	3,526,843.230	
STARBUCKS CORP	129,319	87.120	11,266,271.280	
STEEL DYNAMICS INC	22,935	88.660	2,033,417.100	
STRYKER CORP	37,323	263.010	9,816,322.230	
NETFLIX INC	48,752	375.710	18,316,613.920	
NORTONLIFELOCK INC	65,805	28.060	1,846,488.300	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	53.440	894,051.200	
SYNOPSIS INC	16,447	325.560	5,354,485.320	
SYSCO CORP	56,592	81.530	4,613,945.760	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,354	281.080	11,061,622.320	
TELEFLEX INC	5,347	334.450	1,788,304.150	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	8.170	909,721.330	

TERADYNE INC	18,196	122.690	2,232,467.240	
TEXAS INSTRUMENTS INC	101,257	184.210	18,652,551.970	
TEXTRON INC	24,999	74.660	1,866,425.340	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43,385	573.690	24,889,540.650	
GLOBE LIFE INC	9,737	100.430	977,886.910	
DAVITA INC	6,813	111.770	761,489.010	
TRACTOR SUPPLY CO	12,716	233.330	2,967,024.280	
BIO-TECHNE CORP	4,303	435.060	1,872,063.180	
TRIMBLE INC	27,466	71.140	1,953,931.240	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,751	436.600	2,074,286.600	
TYSON FOODS INC	32,029	86.330	2,765,063.570	
UGI CORP	25,006	35.420	885,712.520	
UNION PACIFIC CORP	70,664	270.210	19,094,119.440	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	164,631	101.710	16,744,619.010	
UNITEDHEALTH GROUP INC	103,449	513.460	53,116,923.540	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	146.350	1,184,849.600	
VF CORP	37,034	56.240	2,082,792.160	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	37.890	2,556,324.630	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,083	251.700	7,068,491.100	
VULCAN MATERIALS CO	14,881	180.840	2,691,080.040	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	78,807	47.020	3,705,505.140	
WALMART INC	168,434	142.830	24,057,428.220	
WASTE MANAGEMENT INC	46,117	155.040	7,149,979.680	
WATERS CORP	6,859	325.110	2,229,929.490	
WEBSTER FINANCIAL CORP	21,208	57.810	1,226,034.480	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,027	408.450	3,278,628.150	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,307	131.390	1,617,016.730	
VAIL RESORTS INC	4,389	258.620	1,135,083.180	
WESTERN DIGITAL CORP	35,249	50.500	1,780,074.500	
WABTEC CORP	20,279	96.950	1,966,049.050	
WHIRLPOOL CORP	7,053	182.790	1,289,217.870	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,520	138.430	2,563,723.600	
WYNN RESORTS LTD	12,220	81.370	994,341.400	
NASDAQ INC	13,278	174.630	2,318,737.140	
CME GROUP INC	39,597	244.930	9,698,493.210	
WILLIAMS COS INC	136,534	32.930	4,496,064.620	
LKQ CORP	31,694	45.400	1,438,907.600	
ALLIANT ENERGY CORP	29,150	60.560	1,765,324.000	
WEC ENERGY GROUP INC	35,339	96.610	3,414,100.790	
CARMAX INC	18,373	99.280	1,824,071.440	
TJX COMPANIES INC	132,656	60.070	7,968,645.920	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,884	427.370	2,514,645.080	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.940	564,884.060	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	21,528	57.830	1,244,964.240	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,928	163.700	2,116,313.600	
SIGNATURE BANK	6,557	305.530	2,003,360.210	
CBRE GROUP INC	37,223	90.060	3,352,303.380	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	25.850	407,887.150	
REGIONS FINANCIAL CORP	105,364	22.900	2,412,835.600	
DOMINO'S PIZZA INC	4,070	393.200	1,600,324.000	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,783	494.620	2,365,767.460	
T-MOBILE US INC	68,949	125.690	8,666,199.810	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	39.730	1,523,645.500	
MOSAIC CO/THE	40,897	68.570	2,804,307.290	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	353.600	1,482,644.800	
CELANESE CORP	11,567	143.860	1,664,028.620	
DEXCOM INC	10,401	468.390	4,871,724.390	
DISCOVERY INC-A	21,594	27.120	585,629.280	
EXPEDIA GROUP INC	15,713	195.020	3,064,349.260	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,694	106.400	2,627,441.600	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,408	311.720	3,867,821.760	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	26.370	950,216.580	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	62,272	135.090	8,412,324.480	
LIVE NATION	18,413	117.880	2,170,524.440	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,008	1,565.940	4,710,347.520	
TRANSDIGM GROUP INC	5,847	675.700	3,950,817.900	
MASTERCARD INC	96,432	349.350	33,688,519.200	
WESTERN UNION CO	46,712	18.550	866,507.600	
OWENS CORNING	10,366	92.820	962,172.120	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,114	107.540	1,625,359.560	
AERCAP HOLDINGS NV	13,522	54.520	737,219.440	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,660	8.560	159,729.600	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12,312	151.920	1,870,439.040	
DELTA AIR LINES INC	15,786	37.260	588,186.360	
INSULET CORP	7,813	251.610	1,965,828.930	
DISCOVER FINANCIAL	32,818	111.900	3,672,334.200	
TE CONNECTIVITY LTD	35,357	131.830	4,661,113.310	
MASIMO CORP	5,688	156.720	891,423.360	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,748	317.740	4,050,549.520	
VMWARE INC	22,568	117.370	2,648,806.160	
MERCADOLIBRE INC	5,036	1,236.440	6,226,711.840	



ULTA BEAUTY INC	5,573	395.840	2,206,016.320	
INVESCO LTD	38,530	21.830	841,109.900	
MSCI INC	8,860	495.730	4,392,167.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	170,898	92.580	15,821,736.840	
VISA INC	183,537	217.310	39,884,425.470	
KEURIG DR PEPPER INC	81,648	37.260	3,042,204.480	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,056	158.150	3,171,856.400	
DISCOVERY INC-C	32,456	27.110	879,882.160	
MARATHON PETROLEUM CORP	68,606	81.390	5,583,842.340	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,542	77.570	1,050,452.940	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,576	18.300	4,201,240.800	
XYLEM INC	20,831	86.340	1,798,548.540	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,220	107.140	3,130,630.800	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,719	203.590	960,741.210	
SPLUNK INC	18,329	142.980	2,620,680.420	
EPAM SYSTEMS INC	6,415	288.050	1,847,840.750	
ZILLOW GROUP INC	8,060	54.050	435,643.000	
HCA HEALTHCARE INC	27,377	260.600	7,134,446.200	
VERISK ANALYTICS INC	16,630	208.240	3,463,031.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	159.610	1,046,083.940	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,723	243.690	2,125,707.870	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	19,735	166.210	3,280,154.350	
NXP SEMICONDUCTOR NV	29,373	191.080	5,612,592.840	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	87.140	1,258,737.300	
LEAR CORP	7,051	142.760	1,006,600.760	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,131	113.700	1,265,594.700	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,542	76.800	2,038,425.600	
DOLLAR GENERAL CORP	25,074	220.900	5,538,846.600	
FORTINET INC	14,882	335.710	4,996,036.220	
HORIZON PHARMA PLC	24,103	109.810	2,646,750.430	
TESLA INC	93,830	1,013.920	95,136,113.600	
GENERAC HOLDINGS INC	7,096	323.420	2,294,988.320	
ENPHASE ENERGY INC	14,290	197.840	2,827,133.600	
GENERAL MOTORS CO	144,099	44.350	6,390,790.650	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	44.770	1,756,327.100	
APTIV PLC	29,162	118.780	3,463,862.360	
PHILLIPS 66	51,476	81.120	4,175,733.120	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	94.240	863,049.920	
META PLATFORMS INC	260,172	219.570	57,125,966.040	

IQVIA HOLDINGS INC	20,457	224.620	4,595,051.340	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,618	143.190	2,665,911.420	
SERVICENOW INC	22,023	581.090	12,797,345.070	
PALO ALTO NETWORKS INC	10,937	622.160	6,804,563.920	
WORKDAY INC	20,746	241.230	5,004,557.580	
ABBVIE INC	194,212	160.280	31,128,299.360	
ZOETIS INC	52,241	189.570	9,903,326.370	
NEWS CORP/NEW-CL A	40,345	22.550	909,779.750	
CDW CORP	14,923	175.840	2,624,060.320	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	37.020	1,570,129.260	
TWILIO INC	18,377	161.940	2,975,971.380	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	104.870	857,417.120	
SNAP INC	120,480	37.050	4,463,784.000	
TRADE DESK INC A	48,596	68.400	3,323,966.400	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,265	65.970	1,468,822.050	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	46.280	409,346.600	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	46.380	921,616.980	
OKTA INC	16,883	144.500	2,439,593.500	
BLACK KNIGHT INC	17,653	58.590	1,034,289.270	
BAKER HUGHES CO	88,694	38.290	3,396,093.260	
BROADCOM INC	45,194	626.430	28,310,877.420	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,285	122.570	1,138,062.450	
MONGODB INC	6,448	420.340	2,710,352.320	
BURLINGTON STORES INC	7,274	183.700	1,336,233.800	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	42,679	27.470	1,172,392.130	
VEEVA SYSTEMS INC	15,572	197.750	3,079,363.000	
TWITTER INC	86,209	38.820	3,346,633.380	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	16,816	51.100	859,297.600	
EVERGY INC	23,678	65.520	1,551,382.560	
ALLEGION PLC	9,404	112.590	1,058,796.360	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14,074	69.410	976,876.340	
STERIS PLC	11,289	232.370	2,623,224.930	
DOCUSIGN INC	22,555	104.550	2,358,125.250	
WIX.COM LTD	5,855	99.840	584,563.200	
DROPBOX INC	30,479	23.230	708,027.170	
KKR & CO INC	58,985	59.250	3,494,861.250	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	40.450	204,272.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	24,609	117.750	2,897,709.750	
MODERNA INC	38,060	179.680	6,838,620.800	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	29,828	151.890	4,530,574.920	
ARAMARK	22,573	37.310	842,198.630	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	20.230	1,211,534.240	
CIGNA CORP	36,545	242.100	8,847,544.500	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	53.510	1,753,522.700	

DOW INC	79,358	64.090	5,086,054.220	
AMCOR PLC	170,579	11.280	1,924,131.120	
PINTEREST INC	63,965	26.340	1,684,838.100	
PELTON INTERACTIVE INC	27,064	28.940	783,232.160	
FOX CORP-A	36,565	40.910	1,495,874.150	
FOX CORP-B	15,511	37.570	582,748.270	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	16.340	695,855.240	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	21,024	223.400	4,696,761.600	
CHEWY INC	9,648	45.900	442,843.200	
AVANTOR INC	57,365	33.810	1,939,510.650	
LYFT INC	26,175	38.980	1,020,301.500	
DYNATRACE INC	20,512	48.500	994,832.000	
CLOUDFLARE INC	29,127	122.390	3,564,853.530	
TRADEWEB MARKETS INC	10,585	87.710	928,410.350	
CARRIER GLOBAL CORP	88,615	46.170	4,091,354.550	
OTIS WORLDWIDE CORP	43,684	77.420	3,382,015.280	
INMODE LTD	5,754	40.090	230,677.860	
UBER TECHNOLOGIES INC	155,782	34.700	5,405,635.400	
CORTEVA INC	81,329	58.490	4,756,933.210	
MATCH GROUP INC	29,019	107.060	3,106,774.140	
BILL.COM HOLDINGS INC	8,262	236.440	1,953,467.280	
BLACKSTONE INC	75,671	125.700	9,511,844.700	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	3,343	75.910	253,767.130	
CARLYLE GROUP INC	17,850	46.600	831,810.000	
10X GENOMICS INC	8,136	68.990	561,302.640	
DATADOG INC	24,410	152.210	3,715,446.100	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	93.920	2,095,167.360	
UPSTART HOLDINGS INC	4,442	115.450	512,828.900	
INGERSOLL RAND INC	42,467	49.390	2,097,445.130	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,653	348.850	1,972,049.050	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	18,691	48.660	909,504.060	
ASANA INC	7,477	42.700	319,267.900	
UNITY SOFTWARE INC	5,698	99.770	568,489.460	
AON PLC	24,306	317.370	7,713,995.220	
SOFI TECHNOLOGIES INC	57,384	9.470	543,426.480	
BENTLEY SYSTEMS INC	17,230	41.980	723,315.400	
COINBASE GLOBAL INC	4,176	190.190	794,233.440	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	44.800	830,054.400	
IAC/INTERACTIVECORP	7,652	100.340	767,801.680	
AIRBNB INC	32,639	170.830	5,575,720.370	
ZENDESK INC	12,612	119.480	1,506,881.760	
CONSTELLATION ENERGY CORP	33,319	52.410	1,746,248.790	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	38.520	1,444,577.040	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	59.350	1,760,083.600	
VIATRIS INC	132,223	10.950	1,447,841.850	

CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	78.990	1,828,302.540	
DRAFTKINGS INC	35,534	19.050	676,922.700	
SNOWFLAKE INC	23,352	227.570	5,314,214.640	
DOORDASH INC	11,653	114.880	1,338,696.640	
ARISTA NETWORKS INC	25,635	139.670	3,580,440.450	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	39,016	63.890	2,492,732.240	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	13.390	2,431,141.960	
FNF GROUP	31,255	49.610	1,550,560.550	
MARVELL TECHNOLOGY INC	91,121	73.760	6,721,084.960	
ROBINHOOD MARKETS INC	20,748	12.960	268,894.080	
LUCID GROUP INC	44,910	26.250	1,178,887.500	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	3.630	410,611.080	
CATALENT INC	18,217	107.910	1,965,796.470	
SYNCHRONY FINANCIAL	62,486	36.400	2,274,490.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	45,607	48.640	2,218,324.480	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,756	169.750	637,581.000	
WAYFAIR INC	7,350	121.370	892,069.500	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	20,242	159.080	3,220,097.360	
HUBSPOT INC	5,077	474.510	2,409,087.270	
QORVO INC	11,596	130.700	1,515,597.200	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,603	134.770	350,806.310	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,342	138.720	2,128,242.240	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	5,852	337.740	1,976,454.480	
GODADDY INC	17,571	83.490	1,467,002.790	
KORNIT DIGITAL LTD	5,217	80.840	421,742.280	
ETSY INC	13,841	140.960	1,951,027.360	
TRANSUNION	20,148	102.220	2,059,528.560	
BLOCK INC	56,348	135.060	7,610,360.880	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,647	76.300	4,398,466.100	
CARVANA CO	8,245	148.650	1,225,619.250	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	48.550	1,087,956.950	
TELADOC HEALTH INC	15,648	69.390	1,085,814.720	
WESTROCK CO	27,826	47.120	1,311,161.120	
KRAFT HEINZ CO	75,414	38.630	2,913,242.820	
NOVOCURE LTD	10,423	82.150	856,249.450	
FORTIVE CORP	38,676	61.320	2,371,612.320	
WASTE CONNECTIONS INC	27,976	133.750	3,741,790.000	
ALPHABET INC-CL A	33,047	2,831.440	93,570,597.680	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	143,387	17.050	2,444,748.350	

	PAYPAL HOLDINGS INC	123,117	116.050	14,287,727.850	
	SEA LTD ADR	34,567	123.320	4,262,802.440	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	43,819	31.770	1,392,129.630	
	SUNRUN INC	17,098	32.280	551,923.440	
	ZILLOW GROUP INC-C	16,321	55.160	900,266.360	
	ALPHABET INC-CL C	31,433	2,826.240	88,837,201.920	
	ZSCALER INC	9,288	235.790	2,190,017.520	
	CABLE ONE INC	570	1,472.040	839,062.800	
	LINDE PLC	56,498	318.040	17,968,623.920	
	ROKU INC	12,563	127.330	1,599,646.790	
	AVALARA INC	10,495	100.970	1,059,680.150	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,811	559.320	7,724,768.520	
	VISTRA CORP	42,712	22.050	941,799.600	
アメリカ・ドル	小計	34,788,175		4,345,785,032.090 (530,489,978,867)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	17.815	818,830.840	
	ASHTREAD GROUP	49,729	52.000	2,585,908.000	
	SEVERN TRENT PLC	30,135	29.260	881,750.100	
	BARCLAYS PLC	1,812,763	1.683	3,050,880.120	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	5.256	652,774.170	
	BT GROUP PLC	1,005,980	1.847	1,858,045.060	
	BUNZL PLC	38,046	28.910	1,099,909.860	
	AVIVA PLC	399,688	4.357	1,741,440.610	
	CRODA INTERNATIONAL	14,503	73.840	1,070,901.520	
	DIAGEO PLC	257,084	37.475	9,634,222.900	
	SCHRODERS PLC	12,178	31.500	383,607.000	
	DCC PLC	11,135	57.840	644,048.400	
	NATIONAL GRID PLC	400,532	11.198	4,485,157.330	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.618	590,076.250	
	BAE SYSTEMS PLC	353,005	7.488	2,643,301.440	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	240,158	32.620	7,833,953.960	
	HALMA PLC	44,999	24.790	1,115,525.210	
	NEXT PLC	13,982	61.760	863,528.320	
	IMPERIAL BRANDS PLC	106,272	16.170	1,718,418.240	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	18.545	370,454.920	
	ANGLO AMERICAN PLC	141,403	39.410	5,572,692.230	
	COMPASS GROUP PLC	190,828	16.665	3,180,148.620	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,239,965	5.176	11,594,058.840	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	686,196	2.717	1,864,394.530	
	UNILEVER PLC	282,466	33.700	9,519,104.200	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.655	763,068.480	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	43,040	16.885	726,730.400	
	PEARSON PLC	86,953	7.672	667,103.410	

PERSIMMON PLC	35,252	21.920	772,723.840	
PRUDENTIAL PLC	307,481	10.820	3,326,944.420	
RIO TINTO PLC	123,611	58.570	7,239,896.270	
VODAFONE GROUP PLC	3,040,627	1.248	3,794,702.490	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	79,282	56.350	4,467,540.700	
RELX PLC	213,407	23.200	4,951,042.400	
RENTOKIL INITIAL PLC	204,183	5.150	1,051,542.450	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	847,047	0.923	781,824.380	
NATWEST GROUP PLC	606,899	2.242	1,360,667.550	
ST JAMES'S PLACE PLC	64,417	14.655	944,031.130	
SSE PLC	116,055	16.745	1,943,340.970	
BP PLC	2,174,658	3.892	8,463,768.930	
SAGE GROUP PLC(THE)	99,190	6.864	680,840.160	
SMITHS GROUP PLC	37,796	15.180	573,743.280	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,696	123.250	1,071,782.000	
STANDARD CHARTERED PLC	289,493	5.026	1,454,991.810	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,640,996	0.494	3,774,652.020	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.373	493,612.720	
TESCO PLC	827,233	2.750	2,274,890.750	
3I GROUP PLC	107,283	13.255	1,422,036.160	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	12.290	1,143,781.140	
GLAXOSMITHKLINE PLC	554,322	16.256	9,011,058.430	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,606	78.240	2,864,053.440	
WPP PLC	120,328	10.215	1,229,150.520	
ASTRAZENECA PLC	170,645	98.360	16,784,642.200	
WHITBREAD PLC	26,512	27.420	726,959.040	
INTERTEK GROUP PLC	17,114	51.420	880,001.880	
BURBERRY GROUP PLC	41,060	16.560	679,953.600	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,052	51.380	1,081,651.760	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.595	498,491.710	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	25.830	550,824.750	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	39.360	447,129.600	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	21.220	391,615.100	
AVEVA GROUP PLC	10,907	24.940	272,020.580	
ABRDN PLC	213,433	2.046	436,683.910	
EXPERIAN PLC	99,462	29.880	2,971,924.560	
MONDI PLC	58,736	15.115	887,794.640	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	10.395	384,012.090	
OCADO GROUP PLC	46,768	11.030	515,851.040	
INFORMA PLC	157,970	5.854	924,756.380	
GLENCORE PLC	1,097,413	5.003	5,490,357.230	
ENTAIN PLC	61,865	16.565	1,024,793.720	
COCA-COLA HBC AG	21,338	15.955	340,447.790	

	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	87,616	6.402	560,917.630	
	FERGUSON PLC	24,640	108.600	2,675,904.000	
	M&G PLC	270,401	2.215	598,938.210	
	JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.476	372,217.680	
	SHELL PLC	845,400	20.810	17,592,774.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	6.536	724,404.480	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.255	611,444.780	
イギリス・ポンド	小計	31,338,356		201,449,165.280 (32,421,228,660)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	115,189	32.640	3,759,768.960	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	152,152	36.300	5,523,117.600	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,182	741.000	2,357,862.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	112,553	20.870	2,348,981.110	
	ICL GROUP LTD	72,257	38.200	2,760,217.400	
	NICE LTD	6,507	701.100	4,562,057.700	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	124.200	2,166,048.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	281.000	1,312,832.000	
イスラエル・シュケル	小計	483,952		24,790,884.770 (940,568,647)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,170	63.480	1,153,431.600	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	311,649	27.720	8,638,910.280	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	405,348	23.890	9,683,763.720	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	189,907	18.940	3,596,838.580	
	TELSTRA CORP LTD	484,907	3.900	1,891,137.300	
	ASX LTD	20,036	80.620	1,615,302.320	
	BHP GROUP LTD	556,719	49.300	27,446,246.700	
	AMPOL LTD	22,528	29.910	673,812.480	
	COMPUTERSHARE LT	55,283	24.050	1,329,556.150	
	CSL LIMITED	52,853	267.400	14,132,892.200	
	REA GROUP LTD	6,134	136.420	836,800.280	
	TRANSURBAN GROUP	336,379	13.160	4,426,747.640	
	COCHLEAR LTD	7,511	221.530	1,663,911.830	
	ORIGIN ENERGY LTD	204,918	6.290	1,288,934.220	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	187,467	107.350	20,124,582.450	
	RIO TINTO LIMITED	40,398	116.010	4,686,571.980	
	APA GROUP	125,299	10.320	1,293,085.680	
	ARISTOCRAT LEISU	65,513	36.300	2,378,121.900	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.520	1,273,121.280	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	49,035	43.760	2,145,771.600	
	ORICA LTD	43,659	15.710	685,882.890	

	LEND LEASE CORP LTD	65,475	10.840	709,749.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	20.420	1,027,636.500	
	MACQUARIE GROUP LTD	37,862	196.590	7,443,290.580	
	SUNCORP GROUP LTD	127,921	11.140	1,425,039.940	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	360,795	31.790	11,469,673.050	
	NEWCREST MINING LTD	100,257	26.000	2,606,682.000	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.050	568,927.950	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	171,012	11.330	1,937,565.960	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	131,418	10.560	1,387,774.080	
	REECE LTD	31,558	19.050	601,179.900	
	SANTOS LTD	352,203	7.890	2,778,881.670	
	SONIC HEALTHCARE	51,568	35.220	1,816,224.960	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	27.000	701,595.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	227,460	5.000	1,137,300.000	
	WESFARMERS LTD	121,938	50.340	6,138,358.920	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	104,861	33.200	3,481,385.200	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	135,730	36.420	4,943,286.600	
	SEEK LTD	38,405	29.990	1,151,765.950	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	86.140	541,303.760	
	MINERAL RESOURCES LTD	16,953	48.500	822,220.500	
	BRAMBLES LTD	170,977	9.540	1,631,120.580	
	CROWN RESORTS LTD	35,145	12.500	439,312.500	
	EVOLUTION MINING LTD	224,674	4.420	993,059.080	
	AURIZON HOLDINGS LTD	235,025	3.650	857,841.250	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	11.660	923,856.780	
	XERO LTD	14,590	102.760	1,499,268.400	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	30.940	735,784.140	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	7.090	1,137,732.300	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.050	910,656.800	
	SOUTH32 LTD(AUD)	489,406	5.080	2,486,182.480	
	COLES GROUP LTD	146,272	17.850	2,610,955.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	51.800	767,831.400	
	オーストラリア・ドル 小計	7,629,018		178,648,865.510 (16,366,022,569)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	48,157	77.900	3,751,430.300	
	BARRICK GOLD CORP	194,489	30.680	5,966,922.520	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	23,190	15.380	356,662.200	
	BANK OF MONTREAL	70,933	148.800	10,554,830.400	
	BANK OF NOVA SCOTIA	132,876	91.180	12,115,633.680	
	NATIONAL BANK OF CANADA	37,640	98.280	3,699,259.200	
	BCE INC	7,697	67.660	520,779.020	



BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	156,345	70.580	11,034,830.100	
BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	29.340	887,535.000	
SAPUTO INC	26,668	29.830	795,506.440	
BLACKBERRY LTD	49,855	9.560	476,613.800	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	83,249	19.130	1,592,553.370	
CGI INC	24,878	101.540	2,526,112.120	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	56.930	931,545.590	
CAE INC	32,283	31.940	1,031,119.020	
CAMECO CORP	45,781	36.340	1,663,681.540	
ROGERS COMM-CL B	40,495	66.880	2,708,305.600	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,499	158.800	7,860,441.200	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	129,855	78.890	10,244,260.950	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	185.370	1,135,205.880	
CANADIAN UTILITIES LTD	19,269	37.130	715,457.970	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	78,006	168.140	13,115,928.840	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	47.050	1,021,596.650	
OPEN TEXT CORP	33,592	53.350	1,792,133.200	
EMPIRE CO LTD	16,169	43.170	698,015.730	
KINROSS GOLD CORP	123,889	7.100	879,611.900	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	73.650	978,513.900	
FORTIS INC	54,125	60.340	3,265,902.500	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	66,080	41.920	2,770,073.600	
TELUS CORP	31,890	32.120	1,024,306.800	
GREAT WEST LIFECO INC	26,893	35.960	967,072.280	
IMPERIAL OIL LTD	27,505	56.800	1,562,284.000	
ENBRIDGE INC	223,624	56.910	12,726,441.840	
IGM FINANCIAL INC	12,478	45.330	565,627.740	
MANULIFE FINANCIAL CORP	210,735	26.130	5,506,505.550	
LOBLAW CO LTD	18,965	109.520	2,077,046.800	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	94,400	53.400	5,040,960.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	31,727	80.010	2,538,477.270	
SUN LIFE FINANCIAL INC	63,767	69.720	4,445,835.240	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,909	636.430	1,851,374.870	
METRO INC	28,229	70.000	1,976,030.000	
EMERA INC	30,854	60.470	1,865,741.380	
ONEX CORP	7,000	83.550	584,850.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	35.460	685,193.580	
POWER CORP OF CANADA	59,749	39.090	2,335,588.410	
QUEBECOR INC-B	17,195	28.820	495,559.900	
ROYAL BANK OF CANADA	155,542	140.490	21,852,095.580	

CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	102,975	102.850	10,590,978.750	
SHAW COMM INC-B	45,342	38.470	1,744,306.740	
SUNCOR ENERGY INC	160,650	41.210	6,620,386.500	
LUNDIN MINING CORP	68,762	13.050	897,344.100	
TECK RESOURCES LTD-CL B	51,746	50.910	2,634,388.860	
THOMSON REUTERS CORP	17,791	132.950	2,365,313.450	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	116.220	1,123,266.300	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	199,501	100.890	20,127,655.890	
TC ENERGY CORP	109,064	71.060	7,750,087.840	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,698	109.520	1,062,124.960	
WESTON (GEORGE) LTD	8,379	153.400	1,285,338.600	
INTACT FINANCIAL CORP	18,757	185.060	3,471,170.420	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	51,554	60.550	3,121,594.700	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,190	2,123.770	4,651,056.300	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	21,576	198.800	4,289,308.800	
TOURMALINE OIL CORP	33,964	54.860	1,863,265.040	
KEYERA CORP	24,571	30.670	753,592.570	
PARKLAND CORP	15,665	34.390	538,719.350	
ALTAGAS LTD	34,755	27.680	962,018.400	
PEMBINA PIPELINE CORP	59,037	47.060	2,778,281.220	
DOLLARAMA INC	32,237	67.900	2,188,892.300	
CENOVUS ENERGY INC W/I	142,169	20.150	2,864,705.350	
NORTHLAND POWER INC	25,030	41.370	1,035,491.100	
TMX GROUP LTD	7,632	129.070	985,062.240	
IVANHOE MINES LTD	64,027	11.910	762,561.570	
NUTRIEN LTD	61,558	133.890	8,242,000.620	
TFI INTERNATIONAL INC	9,399	138.250	1,299,411.750	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	37.660	457,569.000	
WSP GLOBAL INC	13,164	166.020	2,185,487.280	
IA FINANCIAL CORP INC	12,011	76.300	916,439.300	
GFL ENVIRONMENTAL INC	17,254	38.740	668,419.960	
NUVEI CORP	7,929	92.000	729,468.000	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	11,764	52.900	622,315.600	
AIR CANADA	18,814	23.540	442,881.560	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,472	71.550	2,323,371.600	
SHOPIFY INC	12,630	882.590	11,147,111.700	
FIRSTSERVICE CORP	5,101	177.930	907,620.930	
CANOPY GROWTH CORP	20,287	9.930	201,449.910	
HYDRO ONE LTD	37,626	32.470	1,221,716.220	
カナダ・ドル 小計	4,284,437		291,023,628.240 (28,319,509,264)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	213,200	4.120	878,384.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	198,410	35.640	7,071,332.400	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.630	300,622.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	72,800	9.820	714,896.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.825	627,984.220	
	KEPPEL CORP LTD	144,600	6.490	938,454.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	370,598	12.300	4,558,355.400	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	855,130	2.620	2,240,440.600	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	166,400	5.400	898,560.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,666	32.030	4,153,201.980	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	7.100	309,560.000	
	VENTURE CORP LTD	22,300	17.280	385,344.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	4.870	946,728.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.910	1,198,766.900	
シンガポール・ドル 小計	3,518,287		25,222,629.500 (2,269,027,750)		
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	303,566	7.554	2,293,137.560	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	70.820	1,344,376.060	
	NESTLE SA-REGISTERED	308,983	119.920	37,053,241.360	
	CIE FINANC RICHEMONT	57,540	114.250	6,573,945.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	76,859	372.600	28,637,663.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,316	201.600	1,071,705.600	
	SIKA INHABER	15,252	304.000	4,636,608.000	
	SGS SA-REG	650	2,686.000	1,745,900.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	240,161	80.470	19,325,755.670	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,712	161.400	921,916.800	
	BARRY CALLEBAUT AG	435	2,104.000	915,240.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	16.480	347,266.560	
	SWISSCOM AG-REG	2,998	561.200	1,682,477.600	
	ABB LTD	175,875	32.090	5,643,828.750	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,351	43.370	839,252.870	
	GEBERIT AG	4,078	572.600	2,335,062.800	
	LONZA GROUP AG-REG	8,302	654.800	5,436,149.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	11,160.000	1,305,720.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	112,100.000	1,233,100.000	
	GIVAUDAN-REG	1,032	3,882.000	4,006,224.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,462	447.700	7,370,037.400	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,786	405.000	1,533,330.000	
	HOLCIM LTD	58,461	44.800	2,619,052.800	
TEMENOS GROUP	7,082	97.660	691,628.120		
BACHEM HOLDING AG	526	497.000	261,422.000		
SONOVA HOLDING AG	6,012	359.000	2,158,308.000		

	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	279.300	1,664,348.700	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,150	1,404.500	1,615,175.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	252.500	790,325.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	48.340	242,956.840	
	SCHINDLER NAMEN	1,661	198.600	329,874.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,592	591.600	2,125,027.200	
	VIFOR PHARMA AG	5,556	166.000	922,296.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	904.500	732,645.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	92.500	774,410.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,497	1,127.500	2,815,367.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,896	52.820	1,367,826.720	
	SWISS RE LTD	32,843	86.380	2,836,978.340	
	ALCON INC	55,647	70.700	3,934,242.900	
	UBS GROUP AG	388,869	17.765	6,908,257.780	
	VAT GROUP AG	3,145	348.000	1,094,460.000	
スイス・フラン	小計	1,902,775		170,136,541.530 (22,378,059,307)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	72,757	513.400	37,353,443.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	42,042	450.700	18,948,329.400	
	ERICSSON LM-B SHS	324,469	86.440	28,047,100.360	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	342.700	8,826,238.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	216.700	12,663,297.900	
	LUNDBERGS B	7,859	463.200	3,640,288.800	
	SKF AB-B SHS	47,698	160.750	7,667,453.500	
	SANDVIK AB	124,173	212.800	26,424,014.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	178,021	101.950	18,149,240.950	
	SKANSKA AB-B SHS	33,216	217.000	7,207,872.000	
	SWEDBANK AB	94,382	153.840	14,519,726.880	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	69,136	181.550	12,551,640.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	88.220	14,294,815.920	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	186.100	4,503,247.800	
	VOLVO AB-B SHS	155,325	181.680	28,219,446.000	
	SWEDISH MATCH AB	167,443	72.400	12,122,873.200	
	TELE2 AB-B SHS	48,914	130.700	6,393,059.800	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	269.400	4,119,664.800	
	INDUSTRIVARDEN C	21,478	265.700	5,706,704.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	145.400	3,912,277.800	
	SECURITAS AB-B SHS	44,275	108.950	4,823,761.250	
	INVESTOR AB-B SHS	198,720	203.100	40,360,032.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	137.760	11,335,857.120	
	ASSA ABLOY AB-B	109,448	256.400	28,062,467.200	
	TELIA CO AB	283,582	36.805	10,437,235.510	
	LUNDIN ENERGY AB	21,720	390.600	8,483,832.000	
	BOLIDEN AB	29,779	483.300	14,392,190.700	

	ALFA LAVAL AB	36,562	317.200	11,597,466.400	
	KINNEVIK AB-B	22,633	236.650	5,356,099.450	
	FASTIGHETS AB BALDER	12,157	590.600	7,179,924.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	100.250	4,788,842.250	
	NIBE INDUSTRIER AB	160,889	96.480	15,522,570.720	
	HEXAGON AB-B SHS	215,068	131.650	28,313,702.200	
	SAGAX AB	19,038	261.400	4,976,533.200	
	EPIROC AB-A	73,781	196.000	14,461,076.000	
	EPIROC AB-B	41,205	164.600	6,782,343.000	
	ESSITY AB-B	68,868	220.500	15,185,394.000	
	EQT AB	31,718	340.500	10,799,979.000	
	EMBRACER GROUP AB	51,636	79.040	4,081,309.440	
	LIFCO AB	26,835	224.000	6,011,040.000	
	EVOLUTION AB	19,180	1,045.000	20,043,100.000	
	NORDEA BANK ABP	350,614	102.780	36,036,106.920	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	284.100	4,414,629.900	
	SINCH AB	59,403	80.160	4,761,744.480	
スウェーデン・クローナ 小計		3,722,244		593,477,974.150 (7,709,278,884)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	790.400	8,621,683.200	
	A P MOLLER A/S	640	21,340.000	13,657,600.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	20,760.000	7,452,840.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	113.300	8,258,097.100	
	GENMAB A/S	7,190	2,367.000	17,018,730.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,915	440.600	10,536,949.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	873	2,383.000	2,080,359.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	185,686	730.000	135,550,780.000	
	GN STORE NORD A/S	15,343	314.800	4,829,976.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	113,252	191.900	21,733,058.800	
	COLOPLAST-B	12,609	959.600	12,099,596.400	
	DSV A/S	22,036	1,306.000	28,779,016.000	
	DEMANT A/S	11,367	280.100	3,183,896.700	
	TRYG A/S	37,118	161.600	5,998,268.800	
	PANDORA A/S	9,912	628.800	6,232,665.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,433	484.000	6,017,572.000	
	AMBU A/S B	15,501	96.020	1,488,406.020	
ORSTED A/S	20,637	761.400	15,713,011.800		
デンマーク・クローネ 小計		572,666		309,252,506.820 (5,585,100,273)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	156,778	7.740	1,213,461.720	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	51,768	9.820	508,361.760	
	FISHER & PAYKEL	60,887	24.520	1,492,949.240	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.710	1,031,668.980	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.730	360,038.820	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	5.160	681,930.120	

ニュージーランド・ドル 小計		683,462		5,288,410.640 (449,038,947)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	236.000	10,738,944.000	
	NORSK HYDRO ASA	153,213	91.660	14,043,503.580	
	TELENOR ASA	71,764	128.350	9,210,909.400	
	SCHIBSTED ASA	8,211	218.000	1,789,998.000	
	ORKLA ASA	72,906	77.480	5,648,756.880	
	EQUINOR ASA	108,570	319.900	34,731,543.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,042	448.000	7,186,816.000	
	AKER BP ASA	15,719	316.000	4,967,204.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	28,465	227.500	6,475,787.500	
	ADEVINTA ASA	24,382	83.040	2,024,681.280	
	DNB BANK ASA	104,666	205.300	21,487,929.800	
	SCHIBSTED ASA	8,058	192.000	1,547,136.000	
ノルウェー・クローネ 小計		657,500		119,853,209.440 (1,687,533,189)	
ユーロ	CRH PLC	84,988	38.420	3,265,238.960	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	18,348	105.600	1,937,548.800	
	KERRY GROUP PLC-A	17,775	102.000	1,813,050.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	90.860	1,585,597.860	
	UMICORE	18,962	38.610	732,122.820	
	AIR LIQUIDE	52,388	157.440	8,247,966.720	
	AIRBUS SE	65,339	107.400	7,017,408.600	
	AXA SA	216,650	25.670	5,561,405.500	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	72,106	27.970	2,016,804.820	
	ADIDAS AG	20,499	210.350	4,311,964.650	
	ASSICURAZIONI GENERALI	118,133	19.065	2,252,205.640	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	138.300	431,496.000	
	DANONE	71,115	51.510	3,663,133.650	
	SAFRAN SA	36,923	104.560	3,860,668.880	
	INTESA SANPAOLO	1,856,317	2.031	3,770,179.820	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,364	78.470	2,696,543.080	
	ACCOR SA	18,305	28.310	518,214.550	
	BOUYGUES	28,068	32.460	911,087.280	
	BNP PARIBAS	124,819	51.100	6,378,250.900	
	THALES SA	11,069	118.000	1,306,142.000	
	CAPGEMINI SA	18,043	189.700	3,422,757.100	
	UNICREDIT SPA	239,573	9.489	2,273,308.190	
	KONINKLIJKE DSM NV	19,072	161.150	3,073,452.800	
	COMMERZBANK AG	112,781	7.142	805,481.900	
	EIFFAGE	8,993	91.960	826,996.280	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	46,809	32.245	1,509,356.200	
UNITED INTERNET	10,010	31.290	313,212.900		
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,955	33.660	200,445.300		
PUBLICIS GROUPE	25,936	55.220	1,432,185.920		

FAURECIA	11,287	23.780	268,404.860	
IBERDROLA SA	645,640	9.544	6,161,988.160	
ENI SPA	278,887	13.314	3,713,101.510	
JERONIMO MARTINS	34,644	20.650	715,398.600	
KESKO OYJ-B	33,781	25.430	859,050.830	
KBC GROUPE	27,733	65.200	1,808,191.600	
HANNOVER RUECK SE	7,306	150.600	1,100,283.600	
WARTSILA OYJ	50,956	9.864	502,629.980	
L'OREAL	27,592	349.900	9,654,440.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,562	624.700	19,092,081.400	
GEA GROUP AG	17,490	39.260	686,657.400	
BOLLORE	114,808	4.590	526,968.720	
MEDIOBANCA SPA	60,688	9.086	551,411.160	
MICHELIN(CGDE) -B	18,693	119.550	2,234,748.150	
CONTINENTAL AG	13,448	65.340	878,692.320	
DEUTSCHE POST AG-REG	110,500	44.585	4,926,642.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	16.840	375,380.440	
OMV AG	17,896	40.750	729,262.000	
VERBUND AG	7,320	90.000	658,800.000	
PERNOD-RICARD	22,709	186.400	4,232,957.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	83.160	1,401,578.640	
RENAULT SA	19,671	22.865	449,777.410	
REPSOL SA	158,826	11.990	1,904,323.740	
REMY COINTREAU	1,986	174.900	347,351.400	
MERCK KGAA	14,538	181.550	2,639,373.900	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	57,159	55.420	3,167,751.780	
RWE AG	68,191	37.550	2,560,572.050	
SEB SA	2,596	123.200	319,827.200	
SOCIETE GENERALE-A	92,169	24.090	2,220,351.210	
VINCI S.A.	60,035	91.530	5,495,003.550	
SODEXO	9,822	72.980	716,809.560	
SOFINA	1,449	328.400	475,851.600	
SOLVAY SA	9,984	92.000	918,528.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	59,837	150.800	9,023,419.600	
VIVENDI SE	90,999	11.785	1,072,423.210	
SAP SE	115,189	100.420	11,567,279.380	
TELEFONICA S.A	563,665	4.203	2,369,083.990	
TOTALENERGIES SE	275,451	46.685	12,859,429.930	
VALEO	26,570	15.740	418,211.800	
E.ON SE	236,021	10.366	2,446,593.680	
VOEST-ALPINE AG	10,593	28.280	299,570.040	
HENKEL AG & CO KGAA	10,815	61.250	662,418.750	
SIEMENS AG-REG	84,320	130.120	10,971,718.400	
UPM-KYMMENE OYJ	61,276	31.130	1,907,521.880	
ING GROEP NV-CVA	423,971	9.431	3,998,470.500	

PUMA AG	10,980	76.340	838,213.200	
BAYER AG	108,913	59.530	6,483,590.890	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	18.070	1,057,727.450	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21,171	61.700	1,306,250.700	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	94,395	63.120	5,958,212.400	
BASF SE	99,004	52.300	5,177,909.200	
BEIERSDORF AG	10,944	92.160	1,008,599.040	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,634	53.120	777,358.080	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,767	58.580	1,392,270.860	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	332.600	1,725,528.800	
ORANGE	228,345	10.714	2,446,488.330	
SAMPO OYJ-A SHS	52,583	43.970	2,312,074.510	
RANDSTAD NV	11,897	57.740	686,932.780	
ALLIANZ SE	45,177	212.650	9,606,889.050	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	281,622	4.279	1,205,060.530	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	113,114	28.490	3,222,617.860	
HERMES INTL	3,399	1,204.000	4,092,396.000	
ENDESA S.A.	30,147	18.450	556,212.150	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.140	516,521.880	
ERSTE GROUP BANK AG	39,151	32.480	1,271,624.480	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	14,999	237.150	3,557,012.850	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,059	30.255	2,028,870.040	
DASSAULT SYSTEMES SA	74,638	45.065	3,363,561.470	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	24.580	579,375.180	
HEINEKEN NV	29,631	87.600	2,595,675.600	
AKZO NOBEL	19,812	76.300	1,511,655.600	
ASML HOLDING NV	45,470	615.700	27,995,879.000	
AEGON NV	196,332	4.615	906,072.180	
VOLKSWAGEN AG	3,315	221.000	732,615.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,877	151.980	3,172,886.460	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	718,852	5.120	3,680,522.240	
KERING	8,029	577.200	4,634,338.800	
CNP ASSURANCES	14,608	21.820	318,746.560	
FORTUM OYJ	43,311	16.705	723,510.250	
AGEAS	18,136	46.010	834,437.360	
UCB SA	13,322	107.800	1,436,111.600	
NEMETSCHEK SE	5,104	87.540	446,804.160	
CARREFOUR SA	64,831	18.785	1,217,850.330	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	25.510	450,940.270	
NOKIA OYJ	583,729	4.880	2,848,597.520	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	100,110	27.020	2,704,972.200	
WOLTERS KLUWER-CVA	28,827	94.980	2,737,988.460	
SANOFI	125,382	93.190	11,684,348.580	



STMICROELECTRONICS NV	73,813	39.895	2,944,769.630	
ELISA OYJ	14,618	53.480	781,770.640	
BANCO SANTANDER SA	1,930,917	3.064	5,916,329.680	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	17.550	860,143.050	
QIAGEN N.V.	26,264	43.670	1,146,948.880	
DEUTSCHE BANK AG-REG	223,697	11.540	2,581,463.380	
BMW VORZUG	7,256	68.350	495,947.600	
ENEL SPA	900,710	5.770	5,197,096.700	
COLRUYT NV	5,030	36.890	185,556.700	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	361,891	16.744	6,059,502.900	
SARTORIUS AG	2,847	386.900	1,101,504.300	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	39.760	438,632.320	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	146,169	30.570	4,468,386.330	
RATIONAL AG	516	670.800	346,132.800	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	142.600	693,891.600	
BECHTLE AG	8,139	51.520	419,321.280	
KONINKLIJKE KPN NV	358,749	3.092	1,109,251.900	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	88.050	1,301,290.950	
TELEPERFORMANCE	6,688	343.100	2,294,652.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,373	158.850	3,236,251.050	
EURAZEO	3,311	71.700	237,398.700	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	93.380	1,056,874.840	
HEINEKEN HOLDING NV-A	14,733	70.700	1,041,623.100	
INDITEX	123,463	20.650	2,549,510.950	
ESSILORLUXOTTICA	31,990	167.360	5,353,846.400	
SNAM SPA	210,122	5.000	1,050,610.000	
CREDIT AGRICOLE SA	138,901	10.674	1,482,629.270	
ORPEA	5,291	35.490	187,777.590	
ENAGAS	24,864	20.030	498,025.920	
WENDEL	2,354	90.650	213,390.100	
TENARIS SA	55,855	13.905	776,663.770	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.326	296,101.230	
ATLANTIA SPA	48,155	18.360	884,125.800	
PROXIMUS	14,640	17.365	254,223.600	
TERNA SPA	159,225	7.162	1,140,369.450	
BIOMERIEUX	4,870	96.780	471,318.600	
GRIFOLS SA	31,982	15.420	493,162.440	
FERROVIAL SA	58,773	25.060	1,472,851.380	
LANXESS AG	7,376	42.200	311,267.200	
NESTE OYJ	45,715	35.260	1,611,910.900	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	20,487	12.350	253,014.450	
RECORDATI SPA	10,908	45.420	495,441.360	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.912	572,665.800	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	212.000	1,273,696.000	
KONE OYJ	39,369	48.430	1,906,640.670	

ELIA GROUP	2,918	130.400	380,507.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	352.100	1,094,678.900	
ENGIE	203,977	11.808	2,408,560.410	
ALSTOM	38,519	21.780	838,943.820	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	8.594	558,713.120	
IPSEN SA	3,873	111.900	433,388.700	
ARKEMA SA	6,392	112.000	715,904.000	
LEGRAND SA	29,484	86.160	2,540,341.440	
AMPLIFON SPA	12,300	36.530	449,319.000	
ADP	3,975	134.200	533,445.000	
ORION OYJ	13,559	40.420	548,054.780	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	11.365	675,149.190	
SYMRISE AG	14,802	106.650	1,578,633.300	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,552	40.470	1,034,089.440	
PRYSMIAN SPA	30,112	30.560	920,222.720	
DIASORIN SPA	2,429	129.750	315,162.750	
CAIXABANK	494,492	3.020	1,493,365.840	
BUREAU VERITAS SA	31,295	26.610	832,759.950	
GETLINK	44,292	16.085	712,436.820	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	22.280	658,619.080	
AMADEUS IT GROUP SA	48,952	56.780	2,779,494.560	
BRENNTAG SE	17,236	74.640	1,286,495.040	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	25.390	626,802.930	
EDENRED	26,160	44.730	1,170,136.800	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.471	260,626.250	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	103.900	852,915.100	
KION GROUP AG	7,874	62.040	488,502.960	
VONOVIA SE	78,465	42.800	3,358,302.000	
KNORR-BREMSE AG	7,195	71.180	512,140.100	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	54.000	1,626,480.000	
FERRARI NV	14,047	193.500	2,718,094.500	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	15.125	1,699,853.370	
AROUNDTOWN SA	113,225	5.300	600,092.500	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,858	36.550	323,759.900	
MONCLER SPA	23,707	49.260	1,167,806.820	
NEXI SPA	58,847	10.850	638,489.950	
PROSUS NV	103,986	49.395	5,136,388.470	
JDE PEET'S BV	7,893	26.125	206,204.620	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	21.230	987,364.840	
INPOST SA	22,392	5.234	117,199.720	
EURONEXT NV	10,081	81.400	820,593.400	
IMCD NV	5,720	153.050	875,446.000	
WORLDLINE SA	24,912	40.335	1,004,825.520	
NN GROUP NV	29,715	44.310	1,316,671.650	
FINECOBANK SPA	71,819	14.050	1,009,056.950	
ARGENX SE	4,531	288.700	1,308,099.700	

	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	81,698	23.095	1,886,815.310	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	47,088	25.710	1,210,632.480	
	ELECTRICITE DE FRANCE SA-RTS	44,030	0.367	16,159.010	
	ZALANDO SE	26,225	47.880	1,255,653.000	
	STELLANTIS NV	219,223	14.412	3,159,441.870	
	AENA SME SA	9,001	145.050	1,305,595.050	
	CELLNEX TELECOM SAU	58,193	42.640	2,481,349.520	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	31.150	706,170.500	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	11.420	603,375.700	
	EXOR NV	10,514	67.400	708,643.600	
	SCOUT24 SE	10,048	51.380	516,266.240	
	COVESTRO AG	20,258	47.480	961,849.840	
	HELLOFRESH SE	17,856	40.610	725,132.160	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	93,424	53.280	4,977,630.720	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	10.550	621,278.950	
	AMUNDI SA	6,292	61.050	384,126.600	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.848	412,424.390	
	ADYEN NV	2,124	1,822.800	3,871,627.200	
	UNIPER SE	11,072	23.950	265,174.400	
	DELIVERY HERO SE	17,246	38.780	668,799.880	
ユーロ	小計	20,144,819		493,646,079.390 (66,321,350,766)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	172,000	16.000	2,752,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	171,296	76.150	13,044,190.400	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	53.000	3,037,642.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	133,591	384.000	51,298,944.000	
	MTR CORP	192,441	42.000	8,082,522.000	
	HANG SENG BANK LTD	79,896	149.800	11,968,420.800	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	129,972	32.850	4,269,580.200	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	51.200	7,747,584.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	9.730	12,117,800.380	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	262,904	46.450	12,211,890.800	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	372,495	28.650	10,671,981.750	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	32.150	5,564,071.900	
	SINO LAND CO	443,200	10.560	4,680,192.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	146,065	95.000	13,876,175.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	47.500	2,518,450.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	154,656	130.000	20,105,280.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	19.520	3,474,560.000	

CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	14.060	3,275,980.000	
AIA GROUP LTD	1,337,916	82.800	110,779,444.800	
HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.900	5,048,182.400	
SANDS CHINA LTD	260,600	18.100	4,716,860.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	29.800	4,172,000.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	20.500	2,345,200.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	160,135	39.250	6,285,298.750	
ESR CAYMAN LTD	216,400	24.450	5,290,980.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	7.870	1,939,955.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	161,300	20.900	3,371,170.000	
WH GROUP LTD	931,500	4.810	4,480,515.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	305,445	58.150	17,761,626.750	
CK ASSET HOLDINGS LTD	234,195	52.850	12,377,205.750	
香港・ドル 小計	8,921,169		369,265,703.680 (5,760,544,977)	
合計	118,646,860		720,697,242,100 (720,697,242,100)	

## (2) 株式以外の有価証券

2022年3月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	108,264.000	1,168,168.560	
		GOODMAN GROUP	181,923.000	4,135,109.790	
		GPT GROUP	219,223.000	1,082,961.620	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	1,073,348.960	
		SCENTRE GROUP	611,542.000	1,865,203.100	
		STOCKLAND	259,328.000	1,073,617.920	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	715,143.400	
	オーストラリア・ドル 小計		2,199,646.000	11,113,553.350 (1,018,112,624)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	421,678.000	1,227,082.980	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,251,428.200	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	206,400.000	392,160.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	445,500.000	824,175.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,642,409.000	3,694,846.180 (332,388,362)	
	投資信託受益証券 合計		3,842,055	1,350,500,986 (1,350,500,986)	

投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	64,312.000	839,271.600	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,940.000	3,058,407.800	
		AMERICAN TOWER CORP	50,172.000	11,815,004.280	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	157,479.000	1,135,423.590	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,036.000	3,656,755.200	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,660.000	1,975,039.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,305.000	1,851,872.050	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	47,738.000	8,368,948.780	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	30,389.000	4,183,045.850	
		DUKE REALTY TRUST	41,687.000	2,338,223.830	
		EQUINIX INC	9,964.000	7,090,681.320	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,950.000	1,522,855.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	39,977.000	3,521,973.700	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,117.000	2,391,881.360	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	14,436.000	2,812,998.960	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	60,560.000	2,044,505.600	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,471,970.500	
		INVITATION HOMES INC	63,432.000	2,542,988.880	
		IRON MOUNTAIN INC	30,120.000	1,580,998.800	
		KIMCO REALTY	71,173.000	1,714,557.570	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	70,999.000	1,448,379.600	
		MID AMERICA	12,263.000	2,516,367.600	
		PROLOGIS INC	81,466.000	12,699,734.740	
		PUBLIC STORAGE	17,475.000	6,520,272.000	
		REALTY INCOME CORP	60,450.000	4,036,851.000	
		REGENCY CENTERS CORP	15,613.000	1,055,438.800	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	12,147.000	3,952,755.270	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	36,454.000	4,743,759.020	
		SUN COMMUNITIES INC	13,479.000	2,314,209.510	
		UDR INC	34,357.000	1,943,231.920	
		VENTAS INC	42,297.000	2,594,920.950	
		VICI PROPERTIES INC	68,285.000	1,853,254.900	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	736,686.430		
WELLTOWER INC	48,613.000	4,601,706.580			
WEYERHAEUSER CO	83,265.000	3,169,898.550			
WP CAREY INC	20,717.000	1,661,710.570			
アメリカ・ドル	小計	1,480,265.000	121,766,581.810 (14,864,046,642)		
イギリス・ポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	114,313.000	586,425.690		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	590,216.350		

	SEGR0 PLC	126,044.000	1,627,228.040	
イギリス・ポンド	小計	317,449.000	2,803,870.080 (451,254,851)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	473,604.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	367,235.040	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	840,839.640 (81,822,105)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	349,655.320	
	GECINA SA	5,045.000	528,211.500	
	KLEPIERRE	17,716.000	402,684.680	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	828,477.350	
ユーロ	小計	41,362.000	2,109,028.850 (283,348,026)	
香港・ドル	LINK REIT	241,816.000	16,092,854.800	
香港・ドル	小計	241,816.000	16,092,854.800 (251,048,535)	
投資証券	合計	2,104,038	15,931,520,159 (15,931,520,159)	
合計			17,282,021,145 (17,282,021,145)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 606銘柄 投資証券 36銘柄	70.55 -	- -	- 1.98	73.90
イギリス・ポンド	株式 78銘柄 投資証券 3銘柄	4.31 -	- -	- 0.06	4.45
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 53銘柄 投資信託受益証券 7銘柄	2.18 -	- 0.14	- -	2.36
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	3.77 -	- -	- 0.01	3.85
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	0.30 -	- 0.04	- -	0.35
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.98	-	-	3.03
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	1.03	-	-	1.04
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.74	-	-	0.76
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	0.22	-	-	0.23
ユーロ	株式 228銘柄	8.82	-	-	9.03

	投資証券	4銘柄	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.77	-	-	0.81
	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3月31日現在

資産総額	14,555,009,846円
負債総額	45,783,651円
純資産総額( - )	14,509,226,195円
発行済数量	8,672,211,708口
1口当たり純資産額( / )	1.6731円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	771,026,182,732円
負債総額	620,620,442円
純資産総額( - )	770,405,562,290円
発行済数量	123,586,748,009口
1口当たり純資産額( / )	6.2337円



## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6)受益権の再分割

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

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2022年3月31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3月31日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

##### 1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年3月31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	1,478,274,797,635
追加型株式投資信託	812	15,311,739,458,456
単位型公社債投資信託	27	53,798,310,639
単位型株式投資信託	223	1,265,390,314,377
合計	1,088	18,109,202,881,107

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

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

## 重要な会計方針

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

(未適用の会計基準等)

## 1. 収益認識に関する会計基準等

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

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

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

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

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

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

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

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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あります。

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あります。

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おります。

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おります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第35期(2020年3月31日現在)

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

## 第36期(2021年3月31日現在)

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

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

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

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

## 第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円



## (2) 損益計算書項目

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

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

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

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

（単位：百万円）

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

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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



## (3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

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

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

## 重要な会計方針

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

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

## 会計上の見積りの変更

第37期中間会計期間  
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

## （会計方針の変更）

## 1. 収益認識に関する会計基準等の適用

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

## 2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

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

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

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

項目	第37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1.減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
（1）金銭の信託	25,866	25,866	-
（2）投資有価証券 その他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

（注）現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

### 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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



## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

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

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## （収益認識関係）

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間  
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬（注）	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬に含めて表示しております。

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6.重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

## （セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## （1）サービスごとの情報

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

## （2）地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## （3）主要な顧客ごとの情報

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

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,741百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

名称	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
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている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5月6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One DC 先進国株式インデックスファンドの2021年3月26日から2022年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One DC 先進国株式インデックスファンドの2022年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注1) 上記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。