

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2023年2月7日提出
【計算期間】	オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース） 第8計算期間 （自 2022年5月13日 至 2022年11月14日） オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定額分配コース） 第8特定期間 （自 2022年5月13日 至 2022年11月14日） オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定率分配コース） 第8特定期間 （自 2022年5月13日 至 2022年11月14日） オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース） 第8特定期間 （自 2022年5月13日 至 2022年11月14日）
【ファンド名】	オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース） オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定額分配コース） オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定率分配コース） オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 小松 幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

世界のさまざまな資産に投資することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

【オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)】

【オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定額分配コース)】

【オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定率分配コース)】

【オール・マーケット・インカム戦略(予想分配金提示型コース)】

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表【オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)】

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表【オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定額分配コース)】
【オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定率分配コース)】

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表【オール・マーケット・インカム戦略(予想分配金提示型コース)】

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	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なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款(以下「目論見書等」といいます。)において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、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
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、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
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信(リート)	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信(リート)以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信(リート)およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、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
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの	
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの	
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配 分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配 分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの	
決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの	
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの	
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの	
	年6回(隔月)	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの	
	年12回(毎月)	目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの	
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの	
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの	

投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東(中東)	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、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きます。)を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、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なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動(一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。)をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ(アドレス<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照下さい。

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・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 >



世界の株式、債券および非伝統的資産など、さまざまな資産に投資し、安定した高いインカム収入および長期的な資産成長を追求します。

◆ 世界のさまざまな資産に投資します。



※当ファンドにおける非伝統的資産の例として、MLP、優先株式、オプションなどがあります。

※上記は例であり、上記の資産のすべてに投資するわけではありません。また、上記以外の資産に投資することがあります。

◆ 投資対象について

優先株式：配当や残余財産の分配を、普通株式よりも優先的に受ける権利がある株式。議決権が制限されるケースが多い。

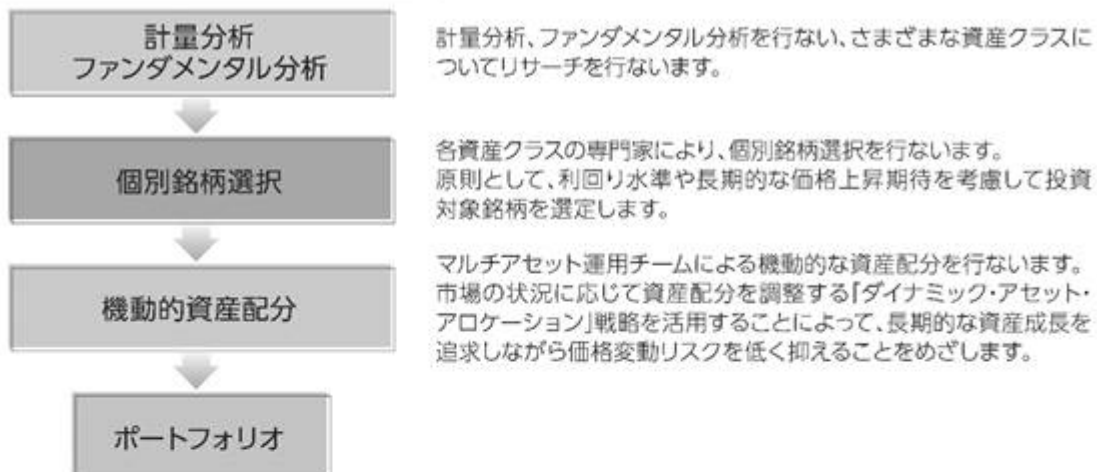
証券化商品：社債、貸出債権(ローン)、不動産などの保有資産を、流動化する目的で発行された証券。

MLP：米国で行なわれている共同投資事業形態のひとつであり、その出資持分が米国の金融商品取引所等で取引されている。

低ボラティリティ株式：過去の価格変動率が相対的に低い株式。

◆ 市場の状況に応じてポートフォリオを機動的に調整します。

ポートフォリオ構築のプロセス



◆ 米ドル売り／円買いの為替取引を行なうことにより、円に対する米ドルの為替変動リスクの低減をめざします。

※ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

※米ドル売り／円買いの為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が米ドルの金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※投資対象ファンドに米ドル建て以外の資産が含まれていることに起因するリスクがあります。くわしくは「投資リスク」をご参照下さい。



2 米ドル短期金利＋年5%程度(米ドルベース、諸費用控除前)を長期的な目標リターンとして運用を行ないます。

目標リターン推移のイメージ



※上図はイメージ図であり、将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

※上記はあくまでも運用上の目標リターンであり、運用結果として保証されているわけではありません。

※目標リターンは、将来、変更される可能性があります。

※費用控除後の日本円ベースでの目標リターンは、以下のようになります。

「米ドル短期金利＋年5%程度－為替ヘッジコスト－諸費用(為替ヘッジコストを除く)」



運用は、アライアンス・バーンスタインが行ないます。

✦ アライアンス・バーンスタイン(AB)について ✦

- ABIは、ニューヨークをはじめ世界各国に拠点を有する世界有数の資産運用会社です。
- 1967年の創立から積み重ねた歴史と経験をもとに、世界の機関投資家、富裕層、個人投資家に質の高い運用サービスを提供しています。
- 運用サービスには、株式、債券、マルチアセット、オルタナティブ等があり、それぞれに特化したチームが調査・運用を行ないます。

※アライアンス・バーンスタインおよびABIは、アライアンス・バーンスタイン・エル・ピーとその傘下の関連会社を含みます。



4 分配方針の異なる4つのコースがあります。

資産成長重視コース

毎年5月12日および11月12日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注)第1計算期間は、2019年5月12日(休業日の場合翌営業日)までとします。

[分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※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。

奇数月定額分配コース

毎年奇数月の各12日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注)第1計算期末には、収益の分配は行ないません。第1計算期間は、2019年1月12日(休業日の場合翌営業日)までとします。分配開始は、2019年3月の決算からになります。

[分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※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。

- 奇数月に定額分配を行なうことをめざします。分配金額は年1回見直しを行ないます。

奇数月定率分配コース

毎年奇数月の各12日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注)第1計算期末には、収益の分配は行ないません。第1計算期間は、2019年1月12日(休業日の場合翌営業日)までとします。分配開始は、2019年3月の決算からになります。

[分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※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。

- 目標分配率を年3%(各決算時0.5%)程度とし、目標分配率に応じた分配を奇数月に行なうことをめざします。

※目標分配率は変更される場合があります。

※各計算期末の前営業日の基準価額に対し、0.5%程度の分配を行なうことをめざします。

予想分配金提示型コース

毎月12日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注)第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。第1計算期間は、2018年12月12日(休業日の場合翌営業日)までとします。分配開始は、2019年3月の決算からになります。

[分配方針]

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ② 原則として、分配対象額の範囲内で、下記に基づき分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※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。

- 計算期末の前営業日の基準価額の水準に応じ、下記の金額の分配をめざします。

*基準価額は1万口当たりとし、既払分配金を加算しません。

計算期末の前営業日から当該計算期末までに基準価額が急激に変動した場合等には、下記の分配を行なわないことがあります。

計算期末の前営業日の基準価額	分配金額(1万口当たり、税引前)
10,100円未満	基準価額の水準等を勘案した分配金額
10,100円以上 10,200円未満	50円
10,200円以上 10,300円未満	100円
10,300円以上 10,400円未満	150円
10,400円以上 10,500円未満	200円
10,500円以上	250円

※基準価額に応じて、毎月の分配金額が変動します。基準価額が上記の一定の水準に一度でも到達すればその水準に応じた分配を続ける、というものではありません。

※分配により基準価額は下落します。そのため、基準価額に影響を与え、次期以降の分配金額は変動する場合があります。

販売会社によっては4つのコースのうち、一部のコースのみのお取扱いとなる場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の2本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- 外国投資証券を通じて、世界の株式、債券や非伝統的資産など、さまざまな資産に投資します。



※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

◆当ファンドは、通常の状態では投資対象とする外国投資証券への投資割合を高位に維持することを基本とします。

◆当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～3.の運用が行なわれないことがあります。

主な投資制限

- 株式への直接投資は、行ないません。
- 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への直接投資は、行ないません。

〔収益分配金に関する留意事項〕

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

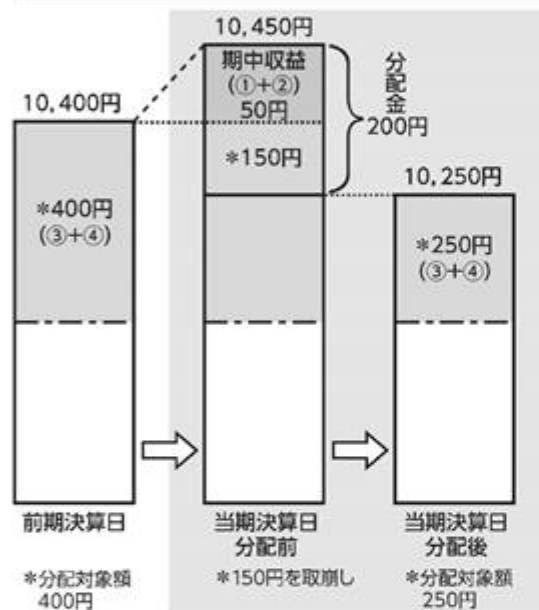
投資信託で分配金が
支払われるイメージ



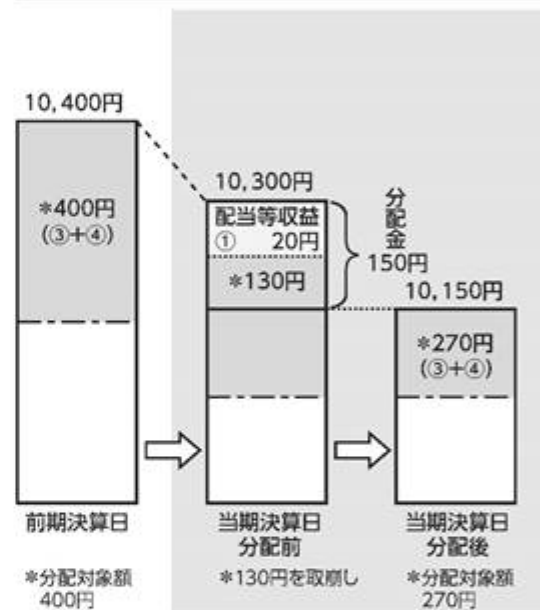
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

（前期決算日から基準価額が上昇した場合）



（前期決算日から基準価額が下落した場合）



（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

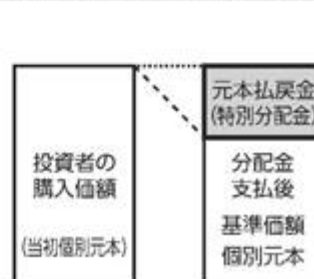
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

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

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）



（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



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

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

（注）普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

< 投資対象ファンドの概要 >

「AB SICAV I」が発行する

「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」

形態 / 表示通貨	ルクセンブルク籍の外国投資証券 / 円建
運用の基本方針	世界の株式、債券および非伝統的資産など、さまざまな資産に投資を行ない、安定した高いインカム収入および長期的な資産成長を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
主要投資対象	世界の株式、債券および非伝統的資産など
運用方針	<ol style="list-style-type: none"> 1. 新興国を含む、世界の株式、債券および非伝統的資産など、さまざまな資産に投資を行ない、安定した高いインカム収入および長期的な資産成長を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。 2. ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針を基本とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・原則として、利回り水準や長期的な価格上昇期待を考慮して投資対象銘柄を選定します。 ・市場の状況に応じてポートフォリオを機動的に調整する「ダイナミック・アセット・アロケーション」戦略を活用することで、長期的な資産成長を追求しながら価格変動リスクを低く抑えることをめざします。 3. さまざまな通貨建ての資産に投資することがあり、米ドル以外の通貨建て資産については当該通貨売り / 米ドル買いの為替取引を行なうことがあります。また、原則としてオール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）の純資産総額とほぼ同程度の米ドル売り / 円買いの為替取引を行ない、円に対する米ドルの為替変動リスクの低減をめざします。 4. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
設定日	2018年11月13日
信託期間	無期限
決算日	5月末日（初回決算：2019年5月31日）
収益分配	原則として、毎月分配を行ないます。
管理報酬等	<p>純資産総額に下記の率（年率）を乗じた額</p> <p>投資顧問報酬：日々の平均純資産総額の年率0.70%</p> <p>管理会社報酬：50,000米ドルまたは日々の平均純資産総額の年率0.01%のうちいずれか低い金額</p> <p>その他費用：保管報酬、管理事務代行報酬、名義書換代行報酬、ファンドの資産および収益に課せられる税金、組入有価証券の売買時の売買手数料、監査費用、弁護士費用等、投資対象ファンドの運営に必要な各種経費がかかります。</p> <p>なお、投資顧問報酬、管理会社報酬、その他費用（ルクセンブルク年次税以外の税金、仲介手数料および借入利息を除く）の総額は、平均純資産総額に対する年率0.85%を上限とします。今後、この数値は見直される場合があります。</p>
申込手数料	かかりません。
投資顧問会社	アライアンス・バーンスタイン・エル・ピー

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」

形態 / 表示通貨	国内籍の証券投資信託 / 円建
運用の基本方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券

投資態度	<p>円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。</p> <p>円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
設定日	2009年 4月23日
信託期間	無期限
決算日	毎年12月9日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用 （信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

(2) 【ファンドの沿革】

2018年11月13日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）
お取扱窓口	<p>販売会社</p> <p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など
運用指図 2		損益 信託金（ 3 ）
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社 再信託受託会社： 日本マスタートラスト信託銀行株式会社	信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など
		損益 投資
投資対象	投資対象ファンドの投資証券 など	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、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に払込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、以下の2本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- 外国投資証券を通じて、世界の株式、債券や非伝統的資産など、さまざまな資産に投資します。



< 委託会社の概況（2022年11月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

- 1959年12月12日 大和証券投資信託委託株式会社として設立
- 1960年 2月17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
- 1960年 4月 1日 営業開始
- 1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
- 1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
- 1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
- 2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。
（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
- 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・ 大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

< 各ファンド共通 >

主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

- ルクセンブルク籍の外国投資法人「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」（以下「オール・マーケット・インカム（クラスS1D）」といいます。）の投資証券（円建）
- ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券

投資態度

- イ．主として、オール・マーケット・インカム（クラスS1D）の投資証券への投資を通じて、世界の株式、債券および非伝統的資産など、さまざまな資産に投資を行ない、安定した高いインカム収入および長期的な資産成長を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
- ロ．当ファンドは、オール・マーケット・インカム（クラスS1D）とダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態では、オール・マーケット・インカム（クラスS1D）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．オール・マーケット・インカム（クラスS1D）では、原則として純資産総額とほぼ同程度の米ドル売り／円買いの為替取引を行なうことにより、円に対する米ドルの為替変動リスクの低減をめざします。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンドの名称	「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」
選定の方針	世界の株式、債券および非伝統的資産など、さまざまな資産に投資を行ない、安定した高いインカム収入および長期的な資産成長を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざすファンドである。円に対する米ドルの為替変動リスクを低減するため、米ドル売り／円買いの為替取引を行なう。

くわしくは「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>」をご参照下さい。

(2)【投資対象】

<各ファンド共通>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．に掲げる親投資信託の受益証券、次の2．に掲げる外国投資証券（以下「組入外国投資証券」といいます。）、ならびに次の3．から5．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンドの受益証券

2. ルクセンブルク籍の外国投資法人「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」の投資証券（円建）

3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3．の証券の性質を有するもの

5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1. に掲げる投資信託の受益証券および前2. に掲げる外国投資証券を「投資信託証券」といいます。

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

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

前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前 に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

<投資先ファンドについて>

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は次のとおりです。

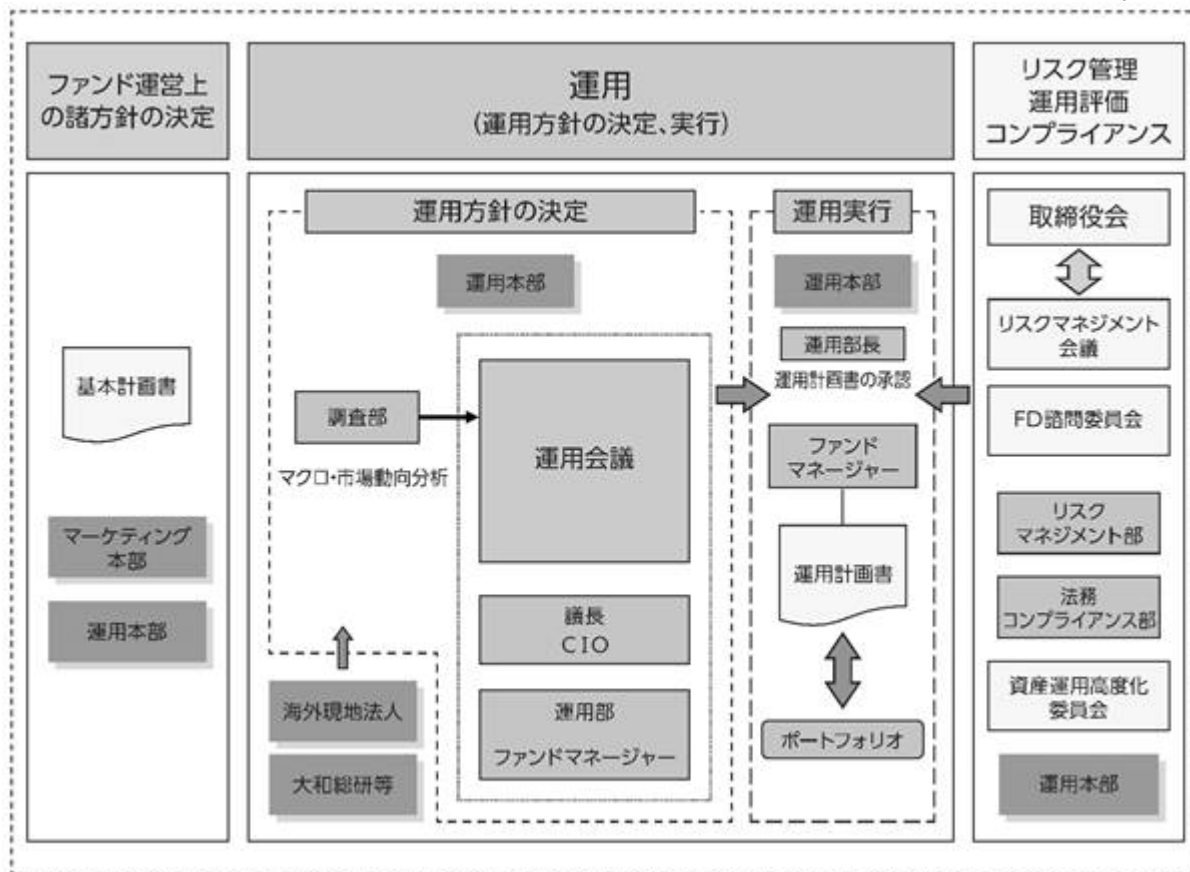
投資先ファンドの名称	「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」
運用の基本方針	新興国を含む、世界の株式、債券および非伝統的資産など、さまざまな資産に投資を行ない、安定した高いインカム収入および長期的な資産成長を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。円に対する米ドルの為替変動リスクを低減するため、米ドル売り/円買いの為替取引を行ないません。
主要な投資対象	世界の株式、債券および非伝統的資産など
委託会社等の名称	投資顧問会社： アライアンス・バーンスタイン・エル・ピー

くわしくは、「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>」をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ハ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO (0～5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー (0～5名程度)

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は35～45名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は2022年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

< 資産成長重視コース >

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

< 奇数月定額分配コース >

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

< 奇数月定率分配コース >

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

< 予想分配金提示型コース >

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、分配対象額の範囲内で、下記イ．およびロ．に基づき分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

イ．計算期末の前営業日の基準価額（1万口当たり。既払分配金を加算しません。以下において同じ。）が10,100円未満の場合、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。

ロ．計算期末の前営業日の基準価額が10,100円以上の場合、原則として、当該基準価額に応じ、下記の金額（1万口当たり）を分配することをめざします。

a．10,100円以上10,200円未満の場合・・・50円

b．10,200円以上10,300円未満の場合・・・100円

c．10,300円以上10,400円未満の場合・・・150円

d．10,400円以上10,500円未満の場合・・・200円

e．10,500円以上の場合・・・250円

なお、計算期末の前営業日から当該計算期末までに基準価額が急激に変動した場合等には、上記の分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

< 各ファンド共通 >

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

信用リスク集中回避（信託約款）

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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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なうこととします。

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借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なわないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、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、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、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。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< 参 考 > 投資対象ファンドについて

1. 「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ(クラスS1D)」
「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>」をご参照下さい。

2. ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

下記以外の項目(「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用(信託報酬)」等)については、「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>」をご参照下さい。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(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。))の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、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は、行ないません。</p>
<p>償還条項</p>	<p>信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき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、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。</p>

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、公社債など値動きのある証券(外国証券には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が

保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。

組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、公社債の価格は下落します。

組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

ハイ・イールド債券は、投資適格債券に比べ、一般に債務不履行が生じるリスクが高いと考えられます。ハイ・イールド債券は、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向があります。

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。

その他の価格変動

当ファンドはさまざまな資産を投資対象としています。

- ・優先株式の価格は、発行体の財政難、経営不安等が生じた場合、または生じることが予想される場合には、大きく下落する可能性があります。
- ・リートの価格は、不動産市況の変動、リートの収益や財務内容の変動、リートに関する法制度の変更等の影響を受けます。
- ・証券化商品の価格は、一般に金利が上昇した場合に下落します。また、ローンが担保となっている場合には、一般に金利が低下すると借り換えが増加し、ローンの期限前償還が増加することにより、証券化商品の価格は影響を受けます。
- ・MLPの多くは、主にエネルギーや天然資源に関わる特定の業種への投資となるため、市場動向にかかわらず基準価額の変動が大きくなる可能性があります。

デリバティブ取引を行なう場合、ファンドの基準価額は当該デリバティブ取引の価格変動の影響を受けます。

・先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建ている場合の先物価格の下落、または先物を売建ている場合の先物価格の上昇により損失が発生することがあります。

・カバードコールを行なう場合、対象資産の価格が上昇した場合の値上がり益が限定されるため、対象資産のみに投資した場合に対して投資成果が劣化する可能性があります。

その他の価格変動は、上記に限定されるものではありません。

組入資産の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

当ファンドは、米ドル売り／円買いの為替取引によって為替変動リスクの低減をめざしますが、投資対象ファンドは運用者の判断によって米ドル以外の通貨（円を含みます）を組入れることもあります。このため、当該米ドル以外の通貨が米ドルに対して下落した場合、基準価額が下落する要因となります。なお、米ドル売り／円買いの為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が米ドルの金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

ロ．カンントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカンントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付け、ご換金の申込みを取消することがあります。

ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、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ご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3)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。

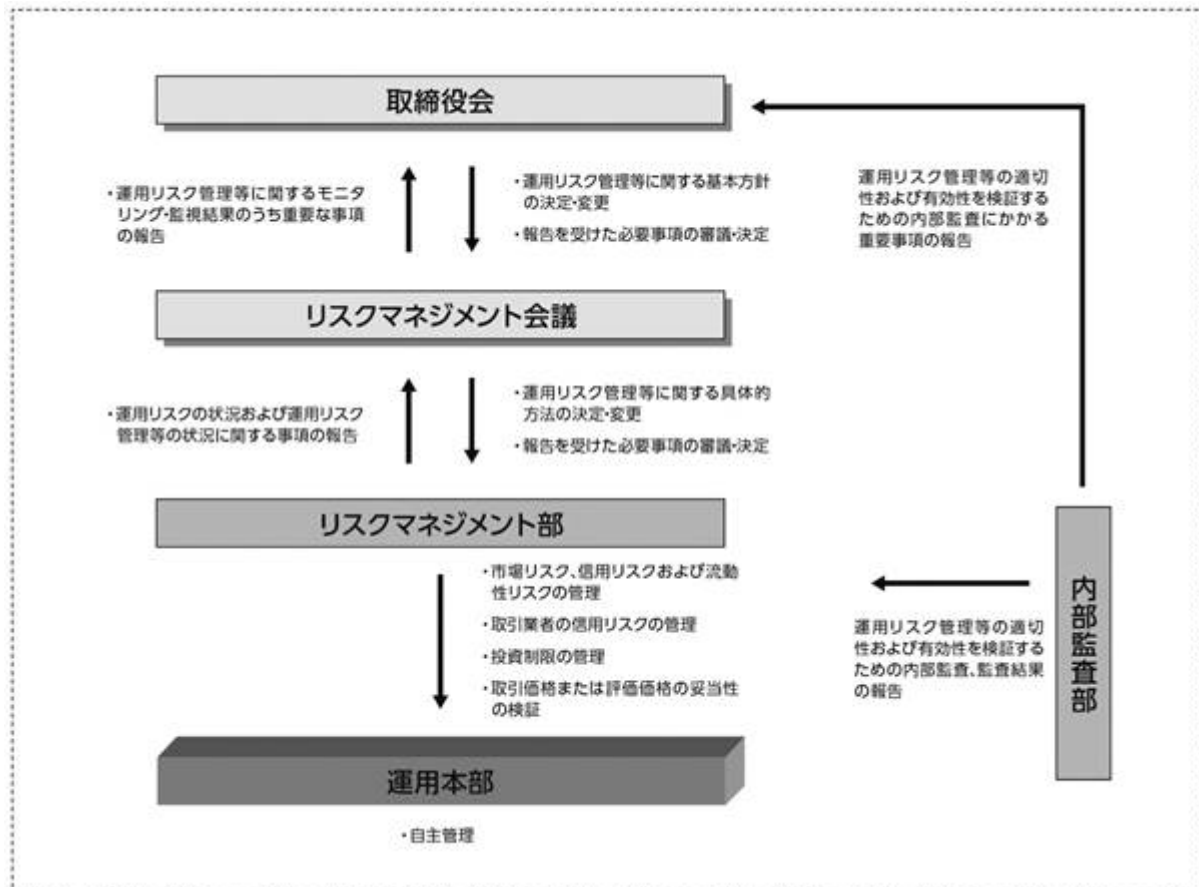
流動性リスクに関する事項

- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

- ・ 委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。
- ・ 取締役会等は、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。

参考情報

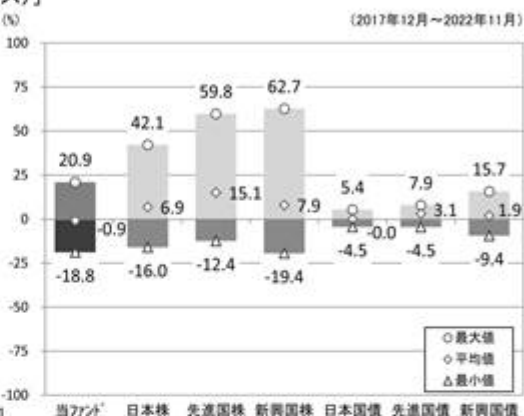
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

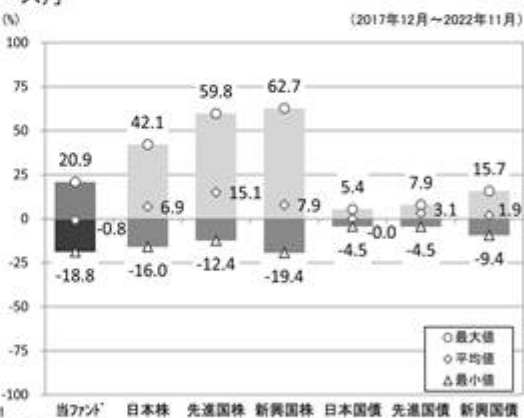
[オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)]



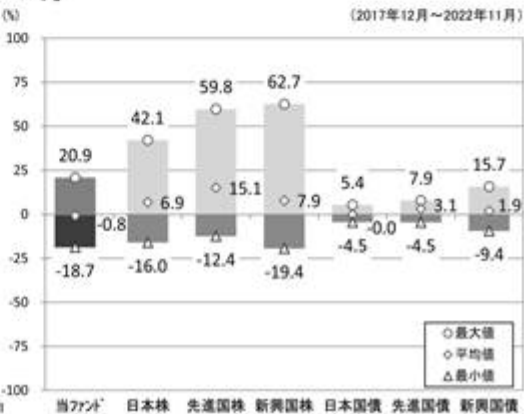
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



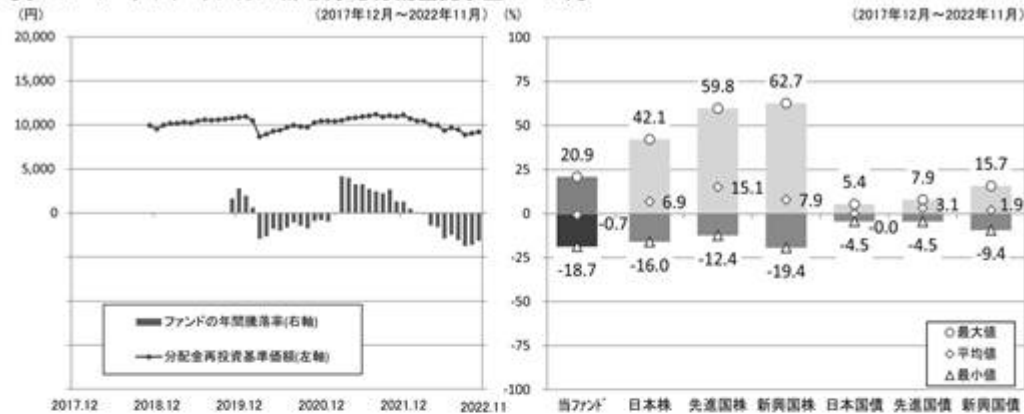
[オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定額分配コース)]



[オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定率分配コース)]



【オール・マーケット・インカム戦略(予想分配金提示型コース)】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ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において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 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)
 日本国債：NOMURA-BPI国債
 先進国債：FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース)

※指数について

●東証株価指数 (TOPIX) の指数値および同指数にかかる商標または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」といいます。) 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商標または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. (「MSCI」) が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>] ●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する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投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、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。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている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。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.3% (税抜3.0%) となっています。

具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税 (以下「消費税等」といいます。) が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(2) 【換金 (解約) 手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.9075%（税抜0.825%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、純資産総額に対し次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.30% （税抜）	年率0.50% （税抜）	年率0.025% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

投資対象ファンドの信託報酬等については、「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>」の<投資対象ファンドの概要>をご参照下さい。なお、当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、最大年率1.7575%（税込）程度です。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：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、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

() 「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

<投資対象ファンドより支弁する手数料等>

各ファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

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

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」の適用対象です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収（ ）され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

投資者ごと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。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資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、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資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。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、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、その後の当該投資者の個別元本となります。

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資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、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資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。

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2022年11月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）】

(1)【投資状況】（2022年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	1,246,840,262	98.94
内 ルクセンブルグ	1,246,840,262	98.94
親投資信託受益証券	9,980	0.00
内 日本	9,980	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,372,721	1.06
純資産総額	1,260,222,963	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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2)【投資資産】（2022年11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	ルクセンブルグ	投資証券	180,990.02	6,834.00 1,236,885,810	6,889.00 1,246,840,262	98.94
2	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,963	1.0018 9,980	1.0018 9,980	0.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.94%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	98.94%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (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 (2019年5月13日)	319,269,672	319,269,672	1.0219	1.0219
第2計算期間末 (2019年11月12日)	1,497,264,329	1,497,264,329	1.0615	1.0615
第3計算期間末 (2020年5月12日)	1,810,676,694	1,810,676,694	0.8921	0.8921
第4計算期間末 (2020年11月12日)	2,112,795,181	2,112,795,181	1.0043	1.0043
第5計算期間末 (2021年5月12日)	1,927,676,698	1,927,676,698	1.0651	1.0651
第6計算期間末 (2021年11月12日)	1,692,582,705	1,692,582,705	1.1019	1.1019
2021年11月末日	1,642,529,693	-	1.0857	-
12月末日	1,620,139,630	-	1.1040	-
2022年1月末日	1,529,010,046	-	1.0618	-
2月末日	1,490,866,752	-	1.0370	-
3月末日	1,491,012,742	-	1.0356	-
4月末日	1,430,067,558	-	0.9904	-
第7計算期間末 (2022年5月12日)	1,386,686,807	1,386,686,807	0.9605	0.9605
5月末日	1,424,017,453	-	0.9862	-
6月末日	1,334,252,267	-	0.9282	-
7月末日	1,377,759,588	-	0.9595	-
8月末日	1,338,719,871	-	0.9389	-
9月末日	1,254,970,860	-	0.8807	-
10月末日	1,275,072,202	-	0.8967	-

第8計算期間末 (2022年11月14日)	1,278,956,485	1,278,956,485	0.9061	0.9061
11月末日	1,260,222,963	-	0.9129	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.2
第2計算期間	3.9
第3計算期間	16.0
第4計算期間	12.6
第5計算期間	6.1
第6計算期間	3.5
第7計算期間	12.8
第8計算期間	5.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	302,442,784	0
第2計算期間	1,197,010,915	98,909,343
第3計算期間	874,277,485	255,071,203
第4計算期間	244,557,291	170,550,194
第5計算期間	96,843,908	390,815,185
第6計算期間	199,955,404	473,708,487
第7計算期間	38,613,441	130,989,974
第8計算期間	23,421,866	55,534,246

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

(1) 投資状況（2022年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	44,935,502,474	100.00
純資産総額	44,935,502,474	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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（2022年11月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

該当事項はありません。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

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。

（参考情報）運用実績

● オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）

2022年11月30日現在
基準価額・純資産の推移

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額	9,129円
純資産総額	12億円



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期			
	19年5月	19年11月	20年5月	20年11月	21年5月	21年11月	22年5月	22年11月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益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。

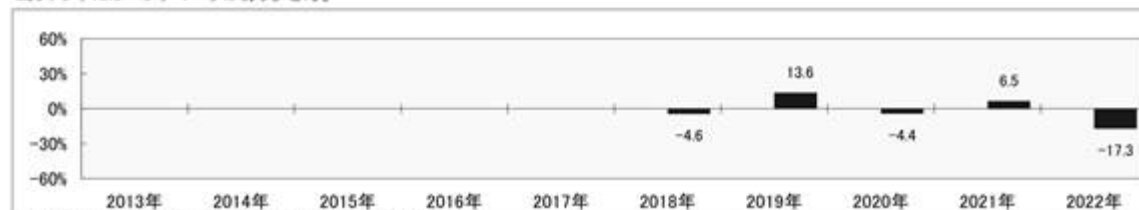
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
アライアンス・バーンスタイン・エル・ビー	オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ	98.9%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネー・ポートフォリオ・マザーファンド	0.0%
合計		98.9%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



*ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

*2018年は設定日(11月13日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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。

【オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定額分配コース）】

(1) 【投資状況】 (2022年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	412,939,494	98.76
内 ルクセンブルグ	412,939,494	98.76
親投資信託受益証券	9,980	0.00
内 日本	9,980	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,190,106	1.24
純資産総額	418,139,580	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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2022年11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	ルクセンブルグ	投資証券	59,941.86	6,834.00 409,642,692	6,889.00 412,939,494	98.76
2	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,963	1.0018 9,980	1.0018 9,980	0.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.76%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	98.76%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2019年5月13日)	129,426,742	130,192,809	1.0137	1.0197
第2特定期間末 (2019年11月12日)	496,116,743	498,991,375	1.0355	1.0415
第3特定期間末 (2020年5月12日)	556,962,476	560,871,077	0.8550	0.8610
第4特定期間末 (2020年11月12日)	630,747,529	634,757,265	0.9438	0.9498
第5特定期間末 (2021年5月12日)	632,918,333	636,783,052	0.9826	0.9886
第6特定期間末 (2021年11月12日)	616,619,190	620,324,952	0.9984	1.0044
2021年11月末日	605,330,913	-	0.9838	-
12月末日	589,656,806	-	1.0003	-
2022年1月末日	553,258,625	-	0.9563	-
2月末日	546,675,731	-	0.9341	-
3月末日	539,781,804	-	0.9268	-
4月末日	506,615,589	-	0.8865	-
第7特定期間末 (2022年5月12日)	488,047,950	491,477,447	0.8539	0.8599
5月末日	499,108,103	-	0.8766	-
6月末日	460,309,747	-	0.8251	-
7月末日	466,675,498	-	0.8467	-
8月末日	447,105,099	-	0.8284	-
9月末日	413,281,569	-	0.7712	-
10月末日	420,406,221	-	0.7852	-
第8特定期間末 (2022年11月14日)	420,494,392	423,698,272	0.7875	0.7935
11月末日	418,139,580	-	0.7934	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0120
第2特定期間	0.0180
第3特定期間	0.0180
第4特定期間	0.0180
第5特定期間	0.0180
第6特定期間	0.0180
第7特定期間	0.0180
第8特定期間	0.0180

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	2.6
第2特定期間	3.9
第3特定期間	15.7
第4特定期間	12.5
第5特定期間	6.0
第6特定期間	3.4
第7特定期間	12.7
第8特定期間	5.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	117,677,962	0
第2特定期間	364,657,206	13,229,811
第3特定期間	213,837,917	41,509,620
第4特定期間	75,191,356	58,335,537
第5特定期間	53,866,615	78,036,151
第6特定期間	96,718,777	123,211,657
第7特定期間	37,352,376	83,396,599
第8特定期間	8,754,320	46,357,034

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

● オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定額分配コース)

2022年11月30日現在 ※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。
基準価額・純資産の推移



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
 ※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

	直近1年間分配金合計額: 360円											設定来分配金合計額: 1,380円
決算期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
	21年1月	21年3月	21年5月	21年7月	21年9月	21年11月	22年1月	22年3月	22年5月	22年7月	22年9月	22年11月
分配金	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円	60円

※分配金は、収益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。

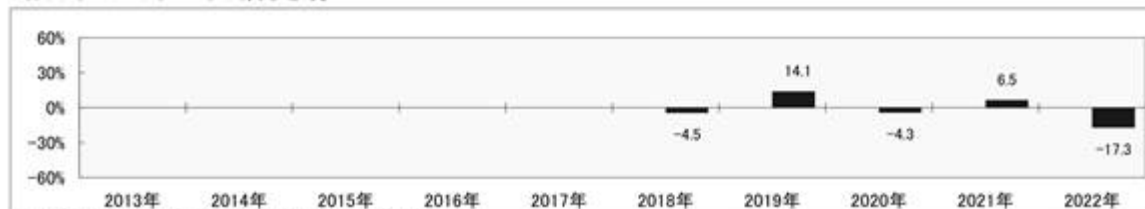
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
アライアンス・バーンスタイン・エル・ビー	オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ	98.8%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネー・ポートフォリオ・マザーファンド	0.0%
合計		98.8%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
 ・2018年は設定日(11月13日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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。

【オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定率分配コース)】

(1) 【投資状況】（2022年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	1,597,303,883	99.09
内 ルクセンブルグ	1,597,303,883	99.09
親投資信託受益証券	9,980	0.00
内 日本	9,980	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,654,056	0.91
純資産総額	1,611,967,919	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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2022年11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	ルクセンブルグ	投資証券	231,862.95	6,834.00 1,584,551,421	6,889.00 1,597,303,883	99.09
2	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,963	1.0018 9,980	1.0018 9,980	0.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	99.09%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	99.09%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2019年5月13日)	317,125,223	318,689,009	1.0140	1.0190
第2特定期間末 (2019年11月12日)	1,522,868,454	1,530,193,377	1.0395	1.0445
第3特定期間末 (2020年5月12日)	2,152,630,836	2,163,876,668	0.8614	0.8659
第4特定期間末 (2020年11月12日)	2,387,305,371	2,399,799,811	0.9553	0.9603
第5特定期間末 (2021年5月12日)	2,453,572,491	2,465,867,152	0.9978	1.0028
第6特定期間末 (2021年11月12日)	2,196,905,760	2,207,704,960	1.0172	1.0222
2021年11月末日	2,094,423,705	-	1.0022	-
12月末日	2,094,196,641	-	1.0190	-
2022年1月末日	2,001,307,023	-	0.9753	-
2月末日	1,964,778,964	-	0.9527	-
3月末日	1,960,321,484	-	0.9467	-
4月末日	1,873,024,291	-	0.9059	-
第7特定期間末 (2022年5月12日)	1,811,032,139	1,820,354,093	0.8742	0.8787
5月末日	1,862,064,879	-	0.8975	-
6月末日	1,741,289,028	-	0.8447	-
7月末日	1,772,572,375	-	0.8690	-
8月末日	1,730,516,401	-	0.8504	-
9月末日	1,617,166,327	-	0.7941	-
10月末日	1,629,385,998	-	0.8085	-
第8特定期間末 (2022年11月14日)	1,607,261,021	1,615,168,001	0.8131	0.8171
11月末日	1,611,967,919	-	0.8192	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0100
第2特定期間	0.0150
第3特定期間	0.0150
第4特定期間	0.0140
第5特定期間	0.0150
第6特定期間	0.0150
第7特定期間	0.0140
第8特定期間	0.0120

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	2.4
第2特定期間	4.0
第3特定期間	15.7
第4特定期間	12.5
第5特定期間	6.0
第6特定期間	3.4
第7特定期間	12.7
第8特定期間	5.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	302,757,252	0
第2特定期間	1,216,098,431	63,870,938
第3特定期間	1,147,453,747	113,364,576
第4特定期間	251,223,228	251,409,129
第5特定期間	257,822,452	297,778,196
第6特定期間	185,928,084	485,020,212
第7特定期間	102,939,865	191,234,459
第8特定期間	23,348,116	118,148,535

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

● オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定率分配コース)

2022年11月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,192円
純資産総額	16億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.8%
3カ月間	-2.7%
6カ月間	-7.4%
1年間	-15.8%
3年間	-14.6%
5年間	-
設定来	-8.2%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 260円 設定来分配金合計額: 1,100円

決算期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期
	21年1月	21年3月	21年5月	21年7月	21年9月	21年11月	22年1月	22年3月	22年5月	22年7月	22年9月	22年11月
分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	45円	45円	40円	40円	40円

※分配金は、収益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を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。

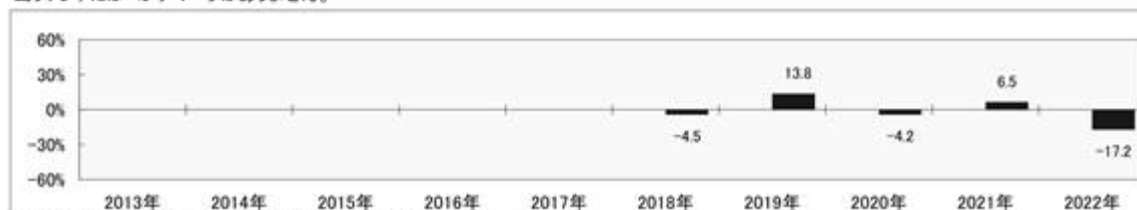
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
アライアンス・バーンスタイン・エル・ビー	オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ	99.1%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネー・ポートフォリオ・マザーファンド	0.0%
合計		99.1%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2018年は設定日(11月13日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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。

【オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）】

(1) 【投資状況】（2022年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	48,251,059	99.42
内 ルクセンブルグ	48,251,059	99.42
親投資信託受益証券	9,980	0.02
内 日本	9,980	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	270,504	0.56
純資産総額	48,531,543	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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2022年11月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	ルクセンブルグ	投資証券	7,004.07	6,834.00 47,865,835	6,889.00 48,251,059	99.42
2	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,963	1.0018 9,980	1.0018 9,980	0.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	99.42%
親投資信託受益証券	0.02%
合計	99.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (2019年5月13日)	37,869,559	38,058,222	1.0036	1.0086
第2特定期間末 (2019年11月12日)	91,842,285	92,297,747	1.0082	1.0132
第3特定期間末 (2020年5月12日)	94,135,223	94,135,223	0.8311	0.8311
第4特定期間末 (2020年11月12日)	97,765,612	97,765,612	0.9353	0.9353
第5特定期間末 (2021年5月12日)	94,693,927	94,693,927	0.9913	0.9913
第6特定期間末 (2021年11月12日)	89,486,228	89,931,287	1.0053	1.0103
2021年11月末日	87,335,168	-	0.9906	-
12月末日	83,945,772	-	1.0073	-
2022年1月末日	78,265,183	-	0.9694	-
2月末日	75,854,742	-	0.9470	-
3月末日	74,651,145	-	0.9455	-
4月末日	71,431,373	-	0.9050	-
第7特定期間末 (2022年5月12日)	69,214,052	69,214,052	0.8777	0.8777
5月末日	71,122,399	-	0.9012	-
6月末日	66,967,715	-	0.8482	-
7月末日	60,903,672	-	0.8767	-
8月末日	59,657,492	-	0.8579	-
9月末日	54,476,503	-	0.8047	-
10月末日	49,798,390	-	0.8193	-

第8特定期間末 (2022年11月14日)	50,325,117	50,325,117	0.8279	0.8279
11月末日	48,531,543	-	0.8342	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0200
第2特定期間	0.0350
第3特定期間	0.0250
第4特定期間	0.0000
第5特定期間	0.0000
第6特定期間	0.0200
第7特定期間	0.0000
第8特定期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	2.4
第2特定期間	3.9
第3特定期間	15.1
第4特定期間	12.5
第5特定期間	6.0
第6特定期間	3.4
第7特定期間	12.7
第8特定期間	5.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	27,732,700	0
第2特定期間	55,342,405	1,982,614
第3特定期間	42,083,487	19,907,595
第4特定期間	6,569,276	15,310,523
第5特定期間	11,281,746	20,285,797
第6特定期間	2,260,452	8,771,572
第7特定期間	2,373,968	12,529,932
第8特定期間	514,700	18,582,138

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

● オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）

2022年11月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,342円
純資産総額	48百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.8%
3カ月間	-2.8%
6カ月間	-7.4%
1年間	-15.8%
3年間	-14.3%
5年間	-
設定来	-8.0%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 0円 設定来分配金合計額： 1,000円

決算期	第37期	第38期	第39期	第40期	第41期	第42期	第43期	第44期	第45期	第46期	第47期	第48期
	21年12月	22年1月	22年2月	22年3月	22年4月	22年5月	22年6月	22年7月	22年8月	22年9月	22年10月	22年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

※分配金は、収益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。

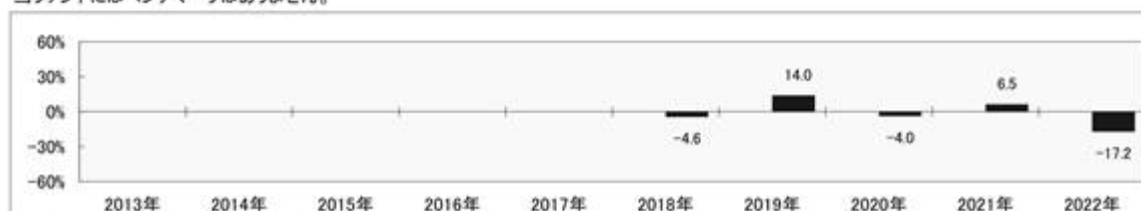
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
アライアンス・バーンスタイン・エル・ビー	オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ	99.4%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド	0.0%
合計		99.4%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2018年は設定日（11月13日）から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとし、なお、販売会社によっては「資産成長重視コース」、「奇数月定額分配コース」、「奇数月定率分配コース」、「予想分配金提示型コース」のうち、一部のコースのみのお取扱いとなる場合があります。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、次のイ．またはロ．に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けは行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはルクセンブルクの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとし、申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

継続申込期間においては、委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとし、

取得申込者は販売会社に、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当ファンドの受益権の振替を行な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なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、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なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとし、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ない、受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、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ない、

2【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までには受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

<一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、次のイ．またはロ．に掲げる日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはルクセンブルクの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター） 0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、一部解約請求の受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた一部解約請求を取消することができるものとします。

一部解約請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して6営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、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なうものとし、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なわれます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産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(注1、注2)により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いいます。

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 組入外国投資法人の投資証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。
- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 本邦通貨表示の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
 2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)
 3. 価格情報会社の提供する価額

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号(コールセンター) 0120-106212(営業日の9:00~17:00)

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

< 資産成長重視コース >

毎年5月13日から11月12日まで、および11月13日から翌年5月12日までとします。

< 奇数月定額分配コース >

毎年1月13日から3月12日まで、3月13日から5月12日まで、5月13日から7月12日まで、7月13日から9月12日まで、9月13日から11月12日まで、および11月13日から翌年1月12日までとします。

< 奇数月定率分配コース >

毎年1月13日から3月12日まで、3月13日から5月12日まで、5月13日から7月12日まで、7月13日から9月12日まで、9月13日から11月12日まで、および11月13日から翌年1月12日までとします。

< 予想分配金提示型コース >

毎月13日から翌月12日までとします。

上記にかかわらず、上記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。)が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき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出ます。
2. 委託会社は、当ファンドが主要投資対象とする組入外国投資証券が存続しないこととなる場合には、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出ます。
3. 委託会社は、前1.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、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
4. 前3.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンド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。以下本4.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、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、前3.から前5.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 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。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で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。
9. 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において、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。

信託約款の変更等

1. 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当ファンドと他のファンドとの併合（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。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.まで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。

2. 委託会社は、前1.の事項(前1.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、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」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信託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。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンド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。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行行使しないときは、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。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託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。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 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、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、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。

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を「奇数月定額分配コース」、「奇数月定率分配コース」および「予想分配金提示型コース」については毎年5月および11月の計算期間の末日ならびに償還時に、「資産成長重視コース」については計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知っている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

1. 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ない、次のアドレスに掲載します。

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その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。

< 換金請求権 >

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第3 【ファンドの経理状況】

【オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（2022年5月13日から2022年11月14日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第7期 2022年5月12日現在	第8期 2022年11月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,280,347	17,328,412
投資証券	1,373,979,403	1,267,840,515
親投資信託受益証券	9,982	9,980
流動資産合計	1,395,269,732	1,285,178,907
資産合計	1,395,269,732	1,285,178,907
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,608,730	-
未払受託者報酬	209,397	186,800
未払委託者報酬	6,702,053	5,979,658
その他未払費用	62,745	55,964
流動負債合計	8,582,925	6,222,422
負債合計	8,582,925	6,222,422
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 1,443,656,842	¹ 1,411,544,462
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	² 56,970,035	² 132,587,977
(分配準備積立金)	259,400,199	298,659,946
元本等合計	1,386,686,807	1,278,956,485
純資産合計	1,386,686,807	1,278,956,485
負債純資産合計	1,395,269,732	1,285,178,907

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自	2021年11月13日 至 2022年5月12日	自	2022年5月13日 至 2022年11月14日
営業収益				
受取配当金		73,574,140		56,428,309
有価証券売買等損益		271,364,541		127,567,199
営業収益合計		197,790,401		71,138,890
営業費用				
支払利息		2,182		3,073
受託者報酬		209,397		186,800
委託者報酬		6,702,053		5,979,658
その他費用		62,745		55,964
営業費用合計		6,976,377		6,225,495
営業損失()		204,766,778		77,364,385
経常損失()		204,766,778		77,364,385
当期純損失()		204,766,778		77,364,385
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		2,506,558		1,016,592
期首剰余金又は期首欠損金()		156,549,330		56,970,035
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,078,665		2,197,702
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,197,702
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,078,665		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,337,810		1,467,851
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,337,810		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,467,851
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		56,970,035		132,587,977

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第8期	
	自 2022年5月13日	至 2022年11月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間末日</p> <p>2022年11月12日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2022年11月14日としております。このため、当計算期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第7期	第8期
	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
1. 1 期首元本額	1,536,033,375円	1,443,656,842円
期中追加設定元本額	38,613,441円	23,421,866円
期中一部解約元本額	130,989,974円	55,534,246円

2.	計算期間末日における受益権の総数	1,443,656,842口	1,411,544,462口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は56,970,035円でありませ	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は132,587,977円でありませ

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第7期	第8期
	自 2021年11月13日 至 2022年5月12日	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(65,297,120円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(107,107,162円)及び分配準備積立金(194,103,079円)より分配対象額は366,507,361円(1万口当たり2,538.74円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(49,145,323円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(109,193,330円)及び分配準備積立金(249,514,623円)より分配対象額は407,853,276円(1万口当たり2,889.41円)であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第8期
	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第8期 2022年11月14日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第7期 2022年5月12日現在	第8期 2022年11月14日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	269,573,599	126,479,853
親投資信託受益証券	2	2
合計	269,573,601	126,479,855

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第7期 2022年5月12日現在	第8期 2022年11月14日現在

該当事項はありません。	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)

第8期 自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第7期 2022年5月12日現在	第8期 2022年11月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9605円 (9,605円)	0.9061円 (9,061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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	185,519.537	1,267,840,515	
投資証券 合計			1,267,840,515	
親投資信託受益 証券	ダイワ・マネーポートフォリオ・マ ザーファンド	9,963	9,980	
親投資信託受益証券 合計			9,980	
合計			1,267,850,495	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、ルクセンブルク籍の外国投資法人「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」の投資証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、すべて同ファンドの投資証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーポートフォリオ・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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（米ドル建て）

貸借対照表

2021年5月31日

資産

投資有価証券の評価額	\$	1,137,322,767
定期預金		163,073,191
売却済み有価証券からの未収金		289,212,906
元本売却の未収金		15,921,359
ブローカーおよび預託機関に預け入れている現金		26,651,190
未収配当金および未収利息		8,860,495
外国為替先渡取引による評価益		4,451,026
スワップ取引の評価益		2,637,452
スワップ取引における前払プレミアム		11,235,046
先物取引の評価益		764,483
スワップ取引の未収利息		1,518,399
		1,661,648,314
		1,661,648,314

負債

購入済み有価証券への未払金	282,472,241
ブローカーおよび預託機関への未払金	3,961,896
解約元本の未払金	5,069,948
外国為替先渡取引による評価損	5,177,964
スワップ取引の評価損	16,317,865
未払配当	7,783,273

スワップ取引における前受プレミアム	9,739,943
先物取引の評価損	1,701,760
スワップ取引の未払利息	840,568
オプション取引の売建玉の評価額	523,321
未払費用およびその他負債	2,478,639
	336,067,418
純資産	\$ 1,325,580,896

損益計算書及び純資産変動計算書

2021年5月31日で終了する会計年度

投資収益

配当収益	\$ 13,705,446
利息	31,864,049
スワップ取引の収益	8,830,588
	54,400,083

費用

運用管理費用	17,293,552
スワップ取引に係る費用	3,042,506
運用会社報酬	1,064,166
名義書換代理人報酬	752,338
税金	545,145
専門家報酬	418,259
預託機関および保管会社報酬	659,332
会計および管理会社報酬	171,999
販売手数料	593,798
印刷料	6,895
雑費	135,750
	24,683,740

費用の払戻または免除	(1,262)
費用合計	24,682,478
投資利益合計	29,717,605

実現損益

証券投資，外国為替先渡取引，スワップ取引，先物取引，オプション取引，為替取引	67,900,612
資本源泉徴収税	97

評価損益の変動

証券投資	151,292,634
先物取引	(3,775,615)

外国為替先渡取引	(3,079,328)
スワップ取引	(4,569,590)
オプション取引の売建玉	991,988
評価損益の変動合計	238,478,403
元本異動	
元本増減	(77,983,038)
分配金	(91,201,657)
純資産	
期首純資産	1,256,287,188
期末純資産	\$ 1,325,580,896

投資明細表

2021年5月31日現在

<u>証券明細</u>	<u>利率</u>	<u>償還日</u>	<u>株数(-)/ 元本(000)</u>	<u>評価額 (USD)</u>	<u>純資産 に 占める 割合 (%)</u>
証券取引所または当局の規制の及ぶ市場で取引可能な有価証券					
普通株					
資本財					
建設・土木					
Shimizu Corp			979	\$ 8,004	0.0%
通信サービス					
各種電気通信サービス					
AT&T, Inc			12,932	380,589	0.0
BCE, Inc			128	6,364	0.0
Comcast Corp- Class A			20,096	1,152,304	0.0
Elisa Oyj			252	14,944	0.0
HKT Trust & HKT Ltd- Class SS			6,718	9,176	0.0
Lumen Technologies, Inc			23,206	321,171	0.0
Nippon Telegraph & Telephone Corp			74,583	2,016,766	0.2
Orange SA			9,350	119,446	0.0
Shaw Communications, Inc- Class B			816	24,398	0.0
Spark New Zealand Ltd			326,635	1,063,581	0.1
Swisscom AG			46	26,020	0.0
Telefonica SA			347,358	1,708,109	0.1
Telenor ASA			33,946	591,001	0.1
TELUS Corp			759	17,127	0.0

Verizon Communications, Inc	7,504	423,901	0.1
Washington H Soul Pattinson & Co., Ltd	191	4,373	0.0
		<u>7,879,270</u>	<u>0.6</u>
エンターテイメント			
Activision Blizzard, Inc	13,916	1,353,428	0.0
Electronic Arts, Inc	14,588	2,085,063	0.2
Netflix, Inc	1,693	851,258	0.1
Nintendo Co., Ltd	899	556,335	0.1
Take-Two Interactive Software, Inc	1,320	244,939	0.0
Ubisoft Entertainment SA	6,504	475,084	0.0
		<u>5,566,107</u>	<u>0.4</u>
インタラクティブメディア・サービス			
Alphabet, Inc- Class A	601	1,416,467	0.1
Alphabet, Inc- Class C	1,883	4,540,967	0.4
Auto Trader Group PLC	159,640	1,272,305	0.1
Facebook, Inc- Class A	34,508	11,343,815	0.9
Kakaku.com, Inc	26,600	794,356	0.0
		<u>19,367,910</u>	<u>1.5</u>
メディア			
Fox Corp- Class B	6,310	228,927	0.0
iHeartMedia, Inc- Class A	1,495	34,699	0.0
Interpublic Group of Cos., Inc(The)	45,051	1,517,768	0.1
Omnicom Group, Inc	390	32,074	0.0
ViacomCBS, Inc- Class B	1,029	43,650	0.0
		<u>1,857,118</u>	<u>0.1</u>
無線通信サービス			
KDDI Corp	2,860	97,621	0.0
Rogers Communications, Inc- Class B	628	32,423	0.0
SoftBank Corp	137,594	1,769,486	0.1
Tele2 AB - Class B	888	12,105	0.0
Vodafone Group PLC	463,073	843,149	0.1
		<u>2,754,784</u>	<u>0.2</u>
		<u>37,425,189</u>	<u>2.8</u>
一般消費財			
自動車部品			
Aisin Corp	33,300	1,459,821	0.1
Aptiv PLC	31,389	4,721,533	0.4
Bridgestone Corp	1,012	45,065	0.0
Magna International, Inc- Class A (United States)	506	50,883	0.0
		<u>6,277,302</u>	<u>0.5</u>
自動車			

Bayerische Motoren Werke AG	6,831	726,465	0.1
Daimler AG	15,303	1,430,198	0.1
Porsche Automobil Holding SE (Preference Shares)	272	30,303	0.0
Tesla, Inc	3,566	2,229,535	0.2
Toyota Motor Corp	3,762	312,886	0.0
		<u>4,729,387</u>	<u>0.4</u>
卸売			
Genuine Parts Co	262	34,353	0.0
ホテル、レストラン・レジャー			
Aristocrat Leisure Ltd	51,916	1,677,260	0.1
Chipotle Mexican Grill, Inc- Class A	282	386,898	0.0
Compass Group PLC	63,176	1,442,120	0.0
Darden Restaurants, Inc	3,147	450,745	0.1
McDonald's Corp	5,077	1,187,459	0.1
Starbucks Corp	15,848	1,804,770	0.2
		<u>6,949,252</u>	<u>0.5</u>
家庭用耐久財			
Casio Computer Co., Ltd	344	6,032	0.0
Electrolux AB - Class B	55,849	1,591,238	0.1
Garmin Ltd	6,880	978,612	0.0
Husqvarna AB - Class B	741	10,931	0.0
Iida Group Holdings Co., Ltd	261	7,055	0.0
Lennar Corp- Class A	2,130	210,891	0.0
Persimmon PLC	5,445	244,182	0.0
PulteGroup, Inc	7,940	458,853	0.1
Sekisui Chemical Co., Ltd	676	11,854	0.0
Sekisui House Ltd	1,093	23,107	0.0
Sony Corp	6,700	669,176	0.2
Sony Group Corp	6,700	669,176	0.0
Whirlpool Corp	114	27,028	0.0
		<u>4,908,135</u>	<u>0.4</u>
インターネット販売・カタログ販売			
Amazon.com, Inc	3,925	12,650,550	0.9
eBay, Inc	16,556	1,007,929	0.1
HelloFresh SE	10,333	935,467	0.1
MercadoLibre, Inc	694	942,917	0.1
Zalando SE	5,690	608,799	0.0
		<u>16,145,662</u>	<u>1.2</u>
レジャー製品			
Hasbro, Inc	6,499	623,709	0.0
複合小売			

Canadian Tire Corp., Ltd- Class A	102	17,458	0.0
Dollar General Corp	2,556	518,968	0.0
Target Corp	4,167	945,576	0.1
Wesfarmers Ltd	2,011	86,087	0.0
		<u>1,568,089</u>	<u>0.1</u>
専門小売			
ABC-Mart, Inc	58	3,337	0.0
AutoZone, Inc	1,728	2,429,200	0.4
Best Buy Co., Inc	2,243	260,727	0.0
Home Depot, Inc(The)	13,054	4,163,051	0.3
O'Reilly Automotive, Inc	1,380	738,464	0.0
Ross Stores, Inc	7,716	975,224	0.0
TJX Cos., Inc(The)	59,488	4,017,820	0.3
Tractor Supply Co	2,625	476,963	0.0
USS Co., Ltd	388	6,857	0.0
		<u>13,071,643</u>	<u>1.0</u>
繊維、アパレル・高級品			
Deckers Outdoor Corp	5,008	1,680,219	0.1
NIKE, Inc- Class B	36,096	4,925,660	0.4
Pandora A/S	6,362	861,940	0.1
		<u>7,467,819</u>	<u>0.6</u>
		<u>61,775,351</u>	<u>4.7</u>
生活必需品			
飲料			
Asahi Group Holdings Ltd	809	39,259	0.0
Coca-Cola Co(The)	25,002	1,382,360	0.1
Coca-Cola HBC AG	355	12,943	0.0
Kirin Holdings Co., Ltd	1,459	29,463	0.0
PepsiCo, Inc	2,502	370,146	0.0
Treasury Wine Estates Ltd	1,279	11,575	0.0
		<u>1,845,746</u>	<u>0.1</u>
食品・生活必需品小売			
Etablissements Franz Colruyt NV	96	5,849	0.0
ICA Gruppen AB	178	8,731	0.0
Kesko Oyj - Class B	484	16,833	0.0
Koninklijke Ahold Delhaize NV	61,580	1,789,859	0.1
Seven & i Holdings Co., Ltd	1,336	58,982	0.0
Sysco Corp	925	74,925	0.0
Tesco PLC	13,714	43,449	0.0
Walmart, Inc	13,440	1,908,740	0.2
Wm Morrison Supermarkets PLC	4,274	10,727	0.0

Woolworths Group Ltd	2,244	72,500	0.0
		3,990,595	0.3
食品			
Bunge Ltd	7,914	687,093	0.1
Campbell Soup Co	357	17,375	0.0
Conagra Brands, Inc	885	33,719	0.0
Danone SA	1,157	82,481	0.0
General Mills, Inc	1,108	69,649	0.0
JM Smucker Co(The)	199	26,525	0.0
Kellogg Co	3,142	205,770	0.0
MEIJI Holdings Co., Ltd	216	13,451	0.0
Morinaga & Co., Ltd./Japan	15,400	479,520	0.0
Nestle SA	12,928	1,597,064	0.1
Orkla ASA	1,332	13,895	0.0
Salmar ASA	27,600	2,038,160	0.2
Tyson Foods, Inc- Class A	531	42,215	0.0
Wilmar International Ltd	3,407	12,340	0.0
		5,319,257	0.4
家庭用品			
Clorox Co.(The)	228	40,294	0.0
Essity AB - Class B	1,079	37,369	0.0
Henkel AG & CoKGaA	184	18,276	0.0
Kimberly-Clark Corp	614	80,207	0.0
Procter & Gamble Co(The)	16,352	2,205,067	0.2
Reckitt Benckiser Group PLC	1,264	114,230	0.0
		2,495,443	0.2
パーソナルケア製品			
Unilever PLC	4,663	279,689	0.0
タバコ			
Altria Group, Inc	43,191	2,125,861	0.2
British American Tobacco PLC	3,865	148,809	0.0
Imperial Brands PLC	77,659	1,763,356	0.1
Japan Tobacco, Inc	2,128	42,392	0.0
Philip Morris International, Inc	38,873	3,748,523	0.3
Swedish Match AB	216,752	2,009,808	0.2
		9,838,749	0.8
		23,769,479	1.8
エネルギー			
エネルギー 機器・サービス			
Baker Hughes Co.- Class A	1,321	32,233	0.0
オイル、ガス・消耗燃料			

Bonanza Creek Energy, Inc	313	13,446	0.0
Denbury, Inc	2,757	184,774	0.0
Enagas SA	441	10,363	0.0
Exxon Mobil Corp	21,178	1,236,160	0.1
Galp Energia SGPS SA	28,901	362,478	0.0
Gulfport Energy Corp	22,919	1,432,437	0.1
Idemitsu Kosan Co., Ltd	35,600	847,580	0.1
Lundin Energy AB	355	12,179	0.0
Marathon Petroleum Corp	1,180	72,924	0.0
ONEOK, Inc	3,780	199,357	0.0
Parkland Corp./Canada	5,499	180,212	0.0
Pembina Pipeline Corp	975	31,517	0.0
Repsol SA	83,356	1,114,474	0.1
Royal Dutch Shell PLC - Class B	82,672	1,505,935	0.1
TC Energy Corp	1,667	85,154	0.0
Valero Energy Corp	25,087	2,016,995	0.2
Whiting Petroleum Corp	1,263	57,833	0.0
		9,363,818	0.7
		9,396,051	0.7
金融			
銀行			
Bank Leumi Le-Israel BM	150,272	1,205,776	0.0
Bank of America Corp	12,496	529,620	0.0
BOC Hong Kong Holdings Ltd	6,563	24,186	0.0
Chiba Bank Ltd.(The)	940	6,119	0.0
Citigroup, Inc	17,656	1,389,704	0.1
Citizens Financial Group, Inc	770	38,423	0.0
Concordia Financial Group Ltd	1,930	7,327	0.0
Credit Agricole SA	63,292	949,486	0.1
DBS Group Holdings Ltd	47,198	1,085,286	0.1
Fifth Third Bancorp	46,825	1,973,206	0.2
Hang Seng Bank Ltd	1,356	28,864	0.0
Huntington Bancshares, Inc./OH	1,844	29,246	0.0
JPMorgan Chase & Co	8,612	1,414,272	0.0
KBC Group NV	8,712	713,628	0.0
KeyCorp	1,742	40,136	0.0
Lloyds Banking Group PLC	291,370	206,294	0.0
M&T Bank Corp	232	37,280	0.0
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc	122,400	703,520	0.0
National Bank of Canada	1,470	114,723	0.0
Nordea Bank Abp	168,897	1,835,379	0.2

Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd	65,954	623,384	0.1
PNC Financial Services Group, Inc(The)	769	149,709	0.0
Regions Financial Corp	1,742	40,780	0.0
Royal Bank of Canada	20,156	2,096,040	0.4
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc	35,500	1,301,575	0.1
Toronto-Dominion Bank (The)	11,652	839,672	0.0
Truist Financial Corp	2,443	150,929	0.0
United Overseas Bank Ltd	2,090	41,531	0.0
US Bancorp	18,391	1,117,805	0.1
		<u>18,693,900</u>	<u>1.4</u>
資本市場			
3i Group PLC	1,726	30,447	0.0
ASX Ltd	343	20,210	0.0
Bank of New York Mellon Corp.(The)	1,513	78,797	0.0
Charles Schwab Corp.(The)	75,652	5,586,900	0.4
CME Group, Inc- Class A	9,998	2,187,163	0.2
EQT AB	3,320	120,820	0.0
Franklin Resources, Inc	48,334	1,653,506	0.1
Goldman Sachs Group, Inc.(The)	5,897	2,193,802	0.2
Hargreaves Lansdown PLC	630	14,815	0.0
IGM Financial, Inc	50,842	1,871,565	0.2
Magellan Financial Group Ltd	244	9,085	0.0
Morgan Stanley	7,722	702,316	0.1
Northern Trust Corp	359	43,507	0.0
Partners Group Holding AG	1,173	1,773,519	0.1
S&P Global, Inc	3,772	1,430,600	0.0
Schroders PLC	220	11,105	0.0
Singapore Exchange Ltd	86,825	682,126	0.1
St.James 's Place PLC	954	18,920	0.0
State Street Corp	638	55,493	0.0
T.Rowe Price Group, Inc	7,333	1,403,170	0.1
		<u>19,887,866</u>	<u>1.5</u>
消費者金融			
Ally Financial, Inc	7,360	402,665	0.1
Capital One Financial Corp	1,520	244,386	0.0
Synchrony Financial	1,058	50,160	0.0
		<u>697,211</u>	<u>0.1</u>
総合金融サービス			
Industrivarden AB	9,180	374,534	0.0
Industrivarden AB - Class C	9,640	377,049	0.0
Kinnevik AB	31,578	870,623	0.1

M&G PLC	538,000	1,866,764	0.1
		3,488,970	0.2
保険			
Admiral Group PLC	342	14,264	0.0
Aflac, Inc	1,186	67,223	0.0
Allianz SE	3,289	873,345	0.1
Allstate Corp.(The)	549	74,999	0.0
American Financial Group, Inc./OH	133	17,697	0.0
Assicurazioni Generali SpA	1,956	40,180	0.0
Baloise Holding AG	82	13,665	0.0
CNP Assurances	80,176	1,474,870	0.1
Direct Line Insurance Group PLC	2,420	10,210	0.0
Fidelity National Financial, Inc	13,031	612,327	0.1
Gjensidige Forsikring ASA	354	7,973	0.0
Great-West Lifeco, Inc	2,753	84,638	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc.(The)	644	42,085	0.0
iA Financial Corp., Inc	15,252	877,585	0.1
Japan Post Holdings Co., Ltd	186,400	1,575,240	0.1
Legal & General Group PLC	317,041	1,279,147	0.1
Lincoln National Corp	330	23,031	0.0
Manulife Financial Corp	85,732	1,791,214	0.1
Medibank Pvt Ltd	31,454	75,896	0.0
MetLife, Inc	28,567	1,867,139	0.1
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc	789	24,259	0.0
NN Group NV	33,007	1,678,441	0.1
Power Corp.of Canada	993	32,386	0.0
Principal Financial Group, Inc	494	32,303	0.0
Progressive Corp.(The)	6,147	609,045	0.1
Prudential Financial, Inc	17,957	1,920,860	0.2
Reinsurance Group of America, Inc.- Class A	123	15,502	0.0
RenaissanceRe Holdings Ltd	97	14,950	0.0
Sampo Oyj - Class A	15,816	752,956	0.0
Sompo Holdings, Inc	562	22,672	0.0
Swiss Life Holding AG	57	29,752	0.0
Swiss Re AG	535	51,793	0.0
T&D Holdings, Inc	954	13,037	0.0
Tokio Marine Holdings, Inc	1,120	52,729	0.0
Travelers Cos., Inc.(The)	457	72,983	0.0
Tryg A/S	638	15,165	0.0
Zurich Insurance Group AG	1,637	689,196	0.1
		16,850,757	1.3

モーゲージ不動産投資信託

AGNC Investment Corp	96,255	1,784,568	0.2
Annaly Capital Management, Inc	190,371	1,764,739	0.1
		3,549,307	0.3
		63,168,011	4.8

フードビバレッジ・タバコ

農産物

Archer-Daniels-Midland Co	1,012	67,328	0.0
---------------------------	-------	--------	-----

ヘルスケア

バイオテクノロジー

AbbVie, Inc	24,405	2,762,646	0.2
Amgen, Inc	7,843	1,866,163	0.1
Gilead Sciences, Inc	3,010	198,991	0.0
		4,827,800	0.3

ヘルスケア機器・用品

Abbott Laboratories	51,430	5,999,310	0.5
Align Technology, Inc	278	164,062	0.0
Baxter International, Inc	20,679	1,698,159	0.1
Coloplast A/S - Class B	3,679	584,953	0.1
Medtronic PLC	14,753	1,867,582	0.1
		10,314,066	0.8

ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

Anthem, Inc	4,328	1,723,099	0.2
CVS Health Corp	2,378	205,554	0.0
Sonic Healthcare Ltd	805	21,608	0.0
UnitedHealth Group, Inc	10,695	4,405,484	0.3
		6,355,745	0.5

ヘルスケア テクノロジー

Veeva Systems, Inc.- Class A	1,640	477,798	0.0
ライフサイエンス・ツール/サービス			
Bio-Rad Laboratories, Inc.- Class A	1,353	815,007	0.1
IQVIA Holdings, Inc	30,938	7,430,070	0.6
Thermo Fisher Scientific, Inc	1,288	603,777	0.0
		8,848,854	0.7

医薬品

Astellas Pharma, Inc	3,302	52,926	0.0
AstraZeneca PLC	2,328	265,822	0.0
Bristol-Myers Squibb Co	14,391	945,776	0.1
Eisai Co., Ltd	420	28,278	0.0
Eli Lilly & Co	3,161	631,378	0.1
GlaxoSmithKline PLC	8,923	170,217	0.0

Johnson & Johnson	14,626	2,475,451	0.2
Merck & Co., Inc	20,007	1,518,331	0.1
Novartis AG (REG)	3,938	348,488	0.0
Novo Nordisk A/S - Class B	17,676	1,398,992	0.0
Orion Oyj - Class B	188	8,306	0.0
Otsuka Holdings Co., Ltd	692	29,019	0.0
Pfizer, Inc	10,114	391,715	0.0
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	185	10,330	0.0
Roche Holding AG	10,105	3,547,015	0.3
Sanofi	2,010	215,598	0.0
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd	53,200	1,823,142	0.2
Zoetis, Inc	27,272	4,818,417	0.4
		<hr/>	<hr/>
		18,679,201	1.4
		<hr/>	<hr/>
		49,503,464	3.7
		<hr/>	<hr/>
産業			
航空宇宙・防衛			
BAE Systems PLC	5,711	42,680	0.0
Huntington Ingalls Industries, Inc	533	115,240	0.0
L3Harris Technologies, Inc	4,236	923,484	0.1
Singapore Technologies Engineering Ltd	2,769	8,145	0.0
		<hr/>	<hr/>
		1,089,549	0.1
		<hr/>	<hr/>
航空貨物・物流サービス			
Deutsche Post AG	1,758	119,516	0.0
Kuehne & Nagel International AG	4,966	1,677,785	0.1
		<hr/>	<hr/>
		1,797,301	0.1
		<hr/>	<hr/>
建設資材			
AGC, Inc	342	15,040	0.0
Cie de Saint-Gobain	13,874	932,894	0.1
Lixil Corp	9,700	263,795	0.0
Masco Corp	12,822	773,295	0.1
Xinyi Glass Holdings Ltd	161,224	630,487	0.0
		<hr/>	<hr/>
		2,615,511	0.2
		<hr/>	<hr/>
商業サービス・用品			
Copart, Inc	3,414	440,440	0.0
Securitas AB - Class B	555	9,096	0.0
Stericycle, Inc	61,021	4,793,810	0.4
Toppan Printing Co., Ltd	465	8,158	0.0
		<hr/>	<hr/>
		5,251,504	0.4
		<hr/>	<hr/>
建設・土木			
Bouygues SA	405	16,491	0.0
Kajima Corp	113,897	1,586,583	0.1

Obayashi Corp	1,151	9,830	0.0
Taisei Corp	338	11,986	0.0
		<u>1,624,890</u>	<u>0.1</u>
電子部品			
ABB Ltd.(REG)	39,638	1,351,966	0.1
Eaton Corp.PLC	722	104,870	0.0
Emerson Electric Co	1,088	104,111	0.0
Generac Holdings, Inc	1,980	651,196	0.0
Mitsubishi Electric Corp	3,237	50,735	0.0
Regal Beloit Corp	6,024	856,792	0.1
Rockwell Automation, Inc	990	261,083	0.1
Schneider Electric SE	7,200	1,146,849	0.1
		<u>4,527,602</u>	<u>0.4</u>
産業コングロマリット			
3M Co	6,834	1,387,575	0.1
DCC PLC	175	14,871	0.0
Siemens AG (REG)	1,357	223,232	0.0
		<u>1,625,678</u>	<u>0.1</u>
機械			
Cummins, Inc	6,386	1,642,990	0.1
GEA Group AG	272	11,845	0.0
Kone Oyj - Class B	603	49,076	0.0
Mitsubishi Heavy Industries Ltd	52,000	1,606,373	0.1
PACCAR, Inc	14,869	1,361,406	0.1
SKF AB - Class B	55,223	1,496,261	0.1
Snap-on, Inc	7,084	1,803,728	0.2
Volvo AB	54,433	1,436,785	0.1
		<u>9,408,464</u>	<u>0.7</u>
海運			
Nippon Yusen KK	45,700	1,872,354	0.1
専門サービス			
Adecco Group AG	4,918	341,171	0.0
Booz Allen Hamilton Holding Corp	13,712	1,164,644	0.0
Randstad NV	212	16,520	0.0
RELX PLC	70,675	1,850,944	0.2
SGS SA	126	394,319	0.0
Verisk Analytics, Inc.- Class A	17,509	3,026,081	0.4
Wolters Kluwer NV	12,924	1,240,956	0.0
		<u>8,034,635</u>	<u>0.6</u>
陸運・鉄道			
Aurizon Holdings Ltd	3,289	9,254	0.0

Nippon Express Co., Ltd	136	11,033	0.0
		20,287	0.0
取引会社・販売代理店			
Bunzl PLC	597	19,359	0.0
Fastenal Co	25,327	1,343,344	0.1
Ferguson PLC	399	54,269	0.0
ITOCHU Corp	2,108	63,834	0.0
WW Grainger, Inc	3,750	1,733,100	0.2
		3,213,906	0.3
		41,081,681	3.1
情報テクノロジー			
通信機器			
Cisco Systems, Inc./Delaware	7,655	404,949	0.0
Juniper Networks, Inc	590	15,535	0.0
		420,484	0.0
電子機器、機器・コンポーネント			
Amphenol Corp.- Class A	68,454	4,604,216	0.3
Arrow Electronics, Inc	6,716	808,136	0.1
CDW Corp./DE	25,251	4,177,021	0.3
Hitachi Ltd	1,716	90,866	0.0
Venture Corp., Ltd	490	7,136	0.0
		9,687,375	0.7
情報技術サービス			
Accenture PLC - Class A	1,140	321,662	0.0
Amadeus IT Group SA - Class A	19,540	1,477,264	0.0
Automatic Data Processing, Inc	26,689	5,231,578	0.4
Broadridge Financial Solutions, Inc	9,415	1,501,504	0.1
Capgemini SE	8,676	1,624,740	0.4
Computershare Ltd	961	11,994	0.0
Fidelity National Information Services, Inc	7,900	1,176,940	0.0
Genpact Ltd	14,832	678,324	0.0
International Business Machines Corp	16,980	2,440,706	0.2
Mastercard, Inc.- Class A	23,415	8,442,981	0.7
Nomura Research Institute Ltd	18,000	575,228	0.0
Paychex, Inc	25,191	2,547,818	0.2
SCSK Corp	92	5,503	0.0
Visa, Inc.- Class A	5,580	1,268,332	0.0
Western Union Co.(The) - Class W	26,827	656,457	0.1
		27,961,031	2.1
半導体・半導体製造装置			
Applied Materials, Inc	5,692	786,236	0.1

ASM International NV	430	134,395	0.0
ASML Holding NV	684	460,676	0.1
Broadcom, Inc	1,204	567,740	0.0
Intel Corp	26,932	1,538,356	0.1
KLA Corp	7,669	2,430,230	0.2
QUALCOMM, Inc	13,365	1,798,127	0.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. (Sponsored ADR)	12,776	1,499,508	0.0
Texas Instruments, Inc	22,738	4,316,127	0.3
		<u>13,531,395</u>	<u>1.0</u>
ソフトウェア			
Adobe, Inc	5,540	2,795,373	0.2
Autodesk, Inc	1,321	377,621	0.0
Avaya Holdings Corp	457	13,107	0.0
Cadence Design Systems, Inc	12,281	1,559,564	0.1
Citrix Systems, Inc	13,656	1,569,780	0.0
Constellation Software, Inc./Canada	1,112	1,594,588	0.2
CrowdStrike Holdings, Inc.- Class A	3,592	797,963	0.1
Microsoft Corp	80,342	20,059,790	1.5
NortonLifeLock, Inc	23,660	654,436	0.0
Oracle Corp	32,988	2,597,476	0.4
Oracle Corp. Japan	6,600	599,098	0.0
Sage Group PLC (The)	1,944	18,114	0.0
ServiceNow, Inc	3,275	1,551,957	0.1
Trade Desk, Inc.(The) - Class A	97	57,049	0.0
Trend Micro, Inc./Japan	237	12,083	0.0
Zoom Video Communications, Inc.- Class A	586	194,276	0.0
		<u>34,452,275</u>	<u>2.6</u>
テクノロジー ハードウェア・コンピュータ記憶装置・周辺機器			
Apple, Inc	88,679	11,050,290	0.9
Brother Industries Ltd	418	8,959	0.0
HP, Inc	2,260	66,060	0.0
Logitech International SA	6,384	786,132	0.0
NetApp, Inc	18,657	1,443,492	0.1
Seagate Technology Holdings PLC	7,444	712,762	0.1
		<u>14,067,695</u>	<u>1.1</u>
		<u>100,120,255</u>	<u>7.5</u>
保険			
生命保険・健康保険			
Sun Life Financial, Inc	1,037	55,857	0.0

素材

化学

Akzo Nobel NV	7,752	988,928	0.0
Arkema SA	109	14,455	0.0
Asahi Kasei Corp	2,225	25,140	0.0
Celanese Corp- Class A	8,285	1,370,753	0.1
Covestro AG	3,952	276,144	0.0
Dow, Inc	29,284	2,003,612	0.2
Eastman Chemical Co	246	30,848	0.0
EMS-Chemie Holding AG	13	12,212	0.0
Evonik Industries AG	10,975	394,411	0.1
Fuchs Petrolub Sf (Preference Shares)	123	6,321	0.0
International Flavors & Fragrances, Inc	27,162	3,848,040	0.3
Johnson Matthey PLC	20,180	872,328	0.0
JSR Corp	360	11,013	0.0
LyondellBasell Industries NV - Class A	8,382	943,981	0.1
Mitsubishi Chemical Holdings Corp	51,600	419,340	0.1
Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc	280	6,613	0.0
Mitsui Chemicals, Inc	48,926	1,665,983	0.1
Nitto Denko Corp	267	21,173	0.0
Nutrien Ltd	1,009	62,751	0.0
Sika AG	2,098	676,631	0.1
Tosoh Corp	461	8,248	0.0
Yara International ASA	309	16,479	0.0

13,675,404 1.1

建設資材

CRH PLC	1,392	72,907	0.0
Holcim Ltd	928	55,628	0.0
		128,535	0.0

容器包装

Amcor PLC	123,484	1,457,111	0.1
International Paper Co	677	42,719	0.0
Packaging Corp.of America	172	25,568	0.0
		1,525,398	0.1

多様金属・工業

Anglo American PLC	2,296	102,150	0.0
--------------------	-------	---------	-----

金属・鉱業

Antofagasta PLC	699	15,321	0.0
B2Gold Corp	1,865	9,541	0.0
BHP Billiton Ltd	59,908	2,224,177	0.2
Boliden AB	485	19,484	0.0

Evolution Mining Ltd	3,030	12,333	0.0
Evrz PLC	183,128	1,657,034	0.1
Fortescue Metals Group Ltd	107,946	1,840,728	0.1
Rio Tinto Ltd	2,998	284,318	0.0
Rio Tinto PLC	18,340	1,578,290	0.1
Steel Dynamics, Inc	32,593	2,034,781	0.2
		9,676,007	0.7
紙・林産物			
Mondi PLC	861	23,295	0.0
Oji Holdings Corp	1,439	8,647	0.0
UPM-Kymmene Oyj	946	36,142	0.0
		68,084	0.0
		25,175,578	1.9
不動産			
多様不動産活動			
Sun Hung Kai Properties Ltd	2,312	36,106	0.0
分散型不動産投資信託			
Armada Hoffer Properties, Inc	20,803	276,056	0.0
Daiwa House REIT Investment Corp	83	227,081	0.0
Essential Properties Realty Trust, Inc	7,570	193,792	0.0
Fibra Uno Administracion SA de CV	113,680	133,268	0.0
Growthpoint Properties Ltd	147,190	156,148	0.0
Hulic Reit, Inc	117	186,949	0.0
ICADE	6,810	612,869	0.1
Merlin Properties Socimi SA	43,640	503,537	0.0
NIPPON REIT Investment Corp	36	147,494	0.0
Nomura Real Estate Master Fund, Inc	60	94,505	0.0
One Liberty Properties, Inc	15,458	394,952	0.0
Stockland	323,763	1,163,084	0.2
		4,089,735	0.3
エクイティ不動産投資信託			
American Campus Communities, Inc	25,640	1,209,183	0.1
American Tower Corp	16,274	4,157,356	0.3
Iron Mountain, Inc	43,413	1,890,202	0.2
Nippon Building Fund, Inc	104	665,652	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc	66,825	2,447,132	0.2
Orix JREIT, Inc	839	1,543,024	0.1
VICI Properties, Inc	50,053	1,558,150	0.1
WP Carey, Inc	6,040	455,718	0.0
		13,926,417	1.0
ヘルスケア不動産投資信託			

Arena REIT	35,740	94,503	0.0
Assura PLC	246,500	260,266	0.0
Medical Properties Trust, Inc	36,730	777,574	0.1
New Senior Investment Group, Inc	50,460	334,550	0.0
Physicians Realty Trust	41,620	754,571	0.1
		2,221,464	0.2
ホテル・リゾート不動産投資信託			
Apple Hospitality REIT, Inc	49,770	789,850	0.1
産業不動産投資信託			
Ascendas Real Estate Investment Trust	122,500	269,546	0.0
Centuria Industrial REIT	57,160	159,514	0.0
Dream Industrial Real Estate Investment Trust	33,640	382,890	0.0
ESR-REIT	436,193	130,281	0.0
GLP J-Reit	61	103,689	0.0
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp	75	134,452	0.0
Industrial Logistics Properties Trust	31,090	779,115	0.1
LaSalle Logiport REIT	74	119,993	0.0
STAG Industrial, Inc	19,810	707,415	0.1
		2,786,895	0.2
オフィス不動産投資信託			
Befimmo SA	7,660	332,539	0.1
Japan Prime Realty Investment Corp	47	184,004	0.0
True North Commercial Real Estate Investment Trust	48,270	299,677	0.0
		816,220	0.1
不動産開発			
CK Asset Holdings Ltd	4,258	28,969	0.0
不動産管理・開発			
Daiwa House Industry Co., Ltd	1,004	29,406	0.0
Hang Lung Properties Ltd	3,590	9,275	0.0
Henderson Land Development Co., Ltd	2,576	12,414	0.0
Nomura Real Estate Holdings, Inc	205	5,396	0.0
Sino Land Co., Ltd	5,848	9,328	0.0
Vonovia SE	9,352	587,196	0.0
		653,015	0.0
不動産管理会社			
Swire Properties Ltd	2,075	6,256	0.0
Wharf Real Estate Investment Co., Ltd	2,962	17,938	0.0
		24,194	0.0
住宅不動産投資信託			
Bluerock Residential Growth REIT, Inc	41,633	404,256	0.0

Comforia Residential REIT, Inc	31	95,398	0.0
Daiwa Securities Living Investments Corp	62	62,940	0.0
Independence Realty Trust, Inc	21,170	361,584	0.0
Killam Apartment Real Estate Investment Trust	12,160	190,747	0.0
Sun Communities, Inc	2,510	420,224	0.1
UDR, Inc	15,740	749,696	0.1
		<u>2,284,845</u>	<u>0.2</u>
リテール不動産投資信託			
Aventus Group	42,420	95,489	0.0
Brixmor Property Group, Inc	34,703	788,105	0.1
Kenedix Retail REIT Corp	39	100,913	0.0
Klepierre SA	17,603	511,963	0.1
Mercialys SA	23,560	302,817	0.0
NewRiver REIT PLC	57,120	79,522	0.0
Shopping Centres Australasia Property Group	69,720	133,293	0.0
Simon Property Group, Inc	6,090	782,504	0.1
SITE Centers Corp	15,390	230,388	0.0
Vicinity Centres	293,391	356,226	0.0
		<u>3,381,220</u>	<u>0.3</u>
特化型不動産投資信託			
Digital Realty Trust, Inc	1,560	236,434	0.0
Gaming and Leisure Properties, Inc	17,535	812,922	0.1
MGM Growth Properties LLC - Class A	21,860	784,118	0.0
National Storage Affiliates Trust	4,510	207,911	0.0
		<u>2,041,385</u>	<u>0.1</u>
		<u>33,080,315</u>	<u>2.5</u>
公益事業			
電力			
Alliant Energy Corp	453	25,889	0.0
American Electric Power Co., Inc	900	77,400	0.0
AusNet Services Ltd	647,905	876,570	0.1
CK Infrastructure Holdings Ltd	1,175	7,479	0.0
CLP Holdings Ltd	2,912	30,036	0.0
Duke Energy Corp	1,394	139,707	0.0
Edison International	687	38,383	0.0
Endesa SA	43,577	1,256,760	0.1
Enel SpA	21,900	1,589,372	0.1
Evergy, Inc	27,034	1,675,838	0.1
Eversource Energy	622	50,500	0.0
Fortis, Inc./Canada	827	37,734	0.0
Fortum Oyj	14,953	432,156	0.1

Hydro One Ltd	583	14,835	0.0
Iberdrola SA	10,245	141,236	0.0
Mercury NZ Ltd	1,208	5,723	0.0
NextEra Energy, Inc	16,208	1,186,604	0.0
NRG Energy, Inc	11,600	372,940	0.0
Pinnacle West Capital Corp	204	17,254	0.0
Power Assets Holdings Ltd	2,460	15,436	0.0
PPL Corp	1,394	40,579	0.0
Red Electrica Corp.SA	32,048	641,709	0.1
Terna SPA	57,381	438,733	0.1
Xcel Energy, Inc	975	69,108	0.0
		<u>9,181,981</u>	<u>0.7</u>
ガス			
AltaGas Ltd	15,670	311,052	0.0
Atmos Energy Corp	232	23,007	0.0
Hong Kong & China Gas Co., Ltd	18,913	33,289	0.0
Osaka Gas Co., Ltd	665	12,745	0.0
Snam SpA	197,554	1,163,582	0.1
Tokyo Gas Co., Ltd	667	13,236	0.0
UGI Corp	24,682	1,136,606	0.1
		<u>2,693,517</u>	<u>0.2</u>
独立電力・再生可能エネルギー生産			
Uniper SE	20,852	766,145	0.1
総合公益事業			
AGL Energy Ltd	61,527	392,256	0.0
Algonquin Power & Utilities Corp	1,059	16,174	0.0
Ameren Corp	12,448	1,048,122	0.1
Atco Ltd./Canada - Class I	9,150	329,629	0.0
CMS Energy Corp	524	32,876	0.0
Consolidated Edison, Inc	621	47,966	0.0
Dominion Energy, Inc	10,215	777,770	0.1
DTE Energy Co	351	48,434	0.0
National Grid PLC	6,295	83,904	0.0
Public Service Enterprise Group, Inc	917	56,964	0.0
RWE AG	1,139	43,321	0.0
Sempra Energy	8,452	1,145,161	0.1
WEC Energy Group, Inc	572	53,716	0.0
		<u>4,076,293</u>	<u>0.3</u>
		<u>16,717,936</u>	<u>1.3</u>
		<u>461,344,499</u>	<u>34.8</u>

社債 - 非投資適格

金融機関

銀行

Alliance Data Systems Corp	4.75%	12/15/2024	USD	833	858,497	0.1
Alliance Data Systems Corp	7.00%	01/15/2026		305	327,494	0.0
Ally Financial, Inc., Series B(a)	4.70%	05/15/2026		551	566,026	0.0
Ally Financial, Inc., Series C(a)	4.70%	05/15/2028		164	165,435	0.0
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	05/24/2022	EUR	800	1,017,025	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(a)	6.50%	03/05/2025	USD	200	217,160	0.0
Banco Santander SA(a)	6.75%	04/25/2022	EUR	600	765,666	0.1
CaixaBank SA(a)	5.88%	10/09/2027		600	836,326	0.1
Citizens Financial Group, Inc., Series B(a)	6.00%	07/06/2023	USD	50	52,013	0.0
Credit Suisse Group AG(a)	7.25%	09/12/2025		1,000	1,117,111	0.1
Societe Generale SA(a)	8.00%	09/29/2025		791	928,989	0.0
UniCredit SpA(a)	9.25%	06/03/2022	EUR	230	302,277	0.0
					<u>7,154,019</u>	<u>0.5</u>

証券仲買会社

NFP Corp	7.00%	05/15/2025	USD	253	277,348	0.0
----------	-------	------------	-----	-----	---------	-----

ファイナンス

CNG Holdings, Inc	12.50%	06/15/2024		87	82,395	0.0
Compass Group Diversified Holdings LLC	5.25%	04/15/2029		451	465,144	0.1
Curo Group Holdings Corp	8.25%	09/01/2025		184	188,553	0.0
Enova International, Inc	8.50%	09/01/2024		11	11,268	0.0
Enova International, Inc	8.50%	09/15/2025		175	181,943	0.0
Hightower Holding LLC	6.75%	04/15/2029		1,495	1,516,966	0.1
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	100	123,482	0.0
Navient Corp	5.50%	01/25/2023	USD	219	229,722	0.0
Navient Corp	6.50%	06/15/2022		507	530,855	0.1
Navient Corp	7.25%	09/25/2023		12	13,166	0.0
SLM Corp	5.13%	04/05/2022		20	20,431	0.0
					<u>3,363,925</u>	<u>0.3</u>

保険

Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc	10.13%	08/01/2026		159	179,152	0.0
Ardonagh Midco 2 PLC(b)	11.50%	01/15/2027		890	957,470	0.1
AssuredPartners, Inc	5.63%	01/15/2029		1,042	1,038,996	0.1
					<u>2,175,618</u>	<u>0.2</u>

その他ファイナンス

Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR	662	817,531	0.1
Intrum AB	4.88%	08/15/2025		228	292,642	0.0
Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp	6.75%	06/01/2025	USD	516	525,190	0.0
					<u>1,635,363</u>	<u>0.1</u>

不動産投資信託

Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/

BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	1,582	1,661,109	0.1
Diversified Healthcare Trust	4.75%	02/15/2028	1,380	1,333,183	0.1
Diversified Healthcare Trust	6.75%	12/15/2021	50	50,080	0.0
Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	531	589,482	0.0
Iron Mountain, Inc	4.88%	09/15/2029	645	660,451	0.1
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/					
MGP Finance Co-Issuer, Inc	5.63%	05/01/2024	1,308	1,407,868	0.1
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/					
MGP Finance Co-Issuer, Inc	5.75%	02/01/2027	68	75,518	0.0
Park Intermediate Holdings LLC/					
PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	280	290,273	0.0
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp	9.38%	04/01/2027	1,805	2,010,256	0.2
				8,078,220	0.6
				22,684,493	1.7

資本財・サービス

ベーシック

Alcoa Nederland Holding BV	6.13%	05/15/2028	1,550	1,689,500	0.1	
Ashland LLC	6.88%	05/15/2043	40	50,506	0.0	
Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems						
Dutch Holding B BV	4.75%	06/15/2027	219	227,760	0.0	
Berry Global, Inc	4.50%	02/15/2026	286	292,880	0.0	
Berry Global, Inc	5.13%	07/15/2023	5	5,034	0.0	
CF Industries, Inc	3.45%	06/01/2023	500	520,199	0.0	
CF Industries, Inc	4.95%	06/01/2043	780	879,515	0.1	
CF Industries, Inc	5.38%	03/15/2044	USD	25	29,207	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc	4.63%	03/01/2029	154	158,225	0.0	
Cleveland-Cliffs, Inc	4.88%	03/01/2031	104	106,417	0.0	
Cleveland-Cliffs, Inc	6.75%	03/15/2026	61	65,897	0.0	
Cleveland-Cliffs, Inc	9.88%	10/17/2025	434	508,023	0.0	
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd	4.50%	09/15/2027	697	756,313	0.1	
Freeport-McMoRan, Inc	5.40%	11/14/2034	22	26,082	0.0	
Graham Packaging Co., Inc	7.13%	08/15/2028	159	169,495	0.0	
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd	7.38%	12/15/2023	441	450,330	0.0	
Hecla Mining Co	7.25%	02/15/2028	642	705,443	0.1	
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc	9.00%	07/01/2028	550	607,782	0.1	
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	EUR	101	125,732	0.0
INEOS Quattro Finance 2 PLC	3.38%	01/15/2026	USD	205	205,110	0.0
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(b)	9.00%	01/15/2026	300	307,048	0.0	

Intelligent Packaging Ltd.Finco, Inc./						
Intelligent Packaging Ltd.Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028		727	752,466	0.1
Joseph T Ryerson & Son, Inc	8.50%	08/01/2028		313	345,998	0.0
Mercer International, Inc	5.13%	02/01/2029		550	567,335	0.0
Novelis Corp	5.88%	09/30/2026		725	755,972	0.1
OCI NV	5.25%	11/01/2024		670	691,338	0.1
Peabody Energy Corp.(b)	8.50%	12/31/2024		5	3,162	0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp	10.00%	12/31/2024		5	4,837	0.0
SPCM SA	4.88%	09/15/2025		980	1,004,093	0.1
United States Steel Corp	6.25%	03/15/2026		309	315,400	0.0
Valvoline, Inc	4.25%	02/15/2030		962	983,101	0.1
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027		228	240,162	0.0
					13,550,362	1.0
資本財						
ARD Finance SA(b)	5.00%	06/30/2027	EUR	225	280,184	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc	5.25%	08/15/2027	USD	710	714,437	0.1
Bombardier, Inc	6.00%	10/15/2022		215	215,246	0.0
Bombardier, Inc	6.13%	01/15/2023		626	657,432	0.1
Bombardier, Inc	7.50%	12/01/2024		419	430,649	0.0
Bombardier, Inc	7.50%	03/15/2025		412	415,269	0.0
Bombardier, Inc	7.88%	04/15/2027		23	23,345	0.0
Clean Harbors, Inc	4.88%	07/15/2027		1,183	1,243,390	0.1
Cleaver-Brooks, Inc	7.88%	03/01/2023		349	349,668	0.0
Colfax Corp	6.38%	02/15/2026		12	12,661	0.0
EnerSys	4.38%	12/15/2027		260	269,802	0.0
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026		761	775,874	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp	6.25%	01/15/2026		1,694	1,778,700	0.1
GFL Environmental, Inc	5.13%	12/15/2026		710	746,136	0.1
GFL Environmental, Inc	8.50%	05/01/2027		433	474,862	0.0
Granite US Holdings Corp	11.00%	10/01/2027		690	770,646	0.1
JELD-WEN, Inc	4.63%	12/15/2025		5	5,092	0.0
RBS Global, Inc./Rexnord LLC	4.88%	12/15/2025		485	495,386	0.0
Signature Aviation US Holdings, Inc	4.00%	03/01/2028		710	712,535	0.1
SPX FLOW, Inc	5.88%	08/15/2026		512	530,077	0.0
Stevens Holding Co., Inc	6.13%	10/01/2026		205	219,155	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp	5.25%	01/15/2029		197	208,282	0.0
Tervita Corp	11.00%	12/01/2025		833	935,968	0.1
Triumph Group, Inc	6.25%	09/15/2024		826	842,093	0.1
Triumph Group, Inc	7.75%	08/15/2025		143	146,218	0.0

Triumph Group, Inc	8.88%	06/01/2024		324	358,650	0.0
Vertical Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028		227	244,934	0.0
					<u>13,856,691</u>	<u>1.0</u>
通信 - メディア						
Advantage Sales & Marketing, Inc	6.50%	11/15/2028		687	729,076	0.1
Altice Financing SA	7.50%	05/15/2026		986	1,026,574	0.1
AMC Networks, Inc	4.25%	02/15/2029		1,051	1,043,592	0.1
Arches Buyer, Inc	6.13%	12/01/2028		219	223,773	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp	5.50%	05/01/2026		250	258,400	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp	5.75%	02/15/2026		160	165,432	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc	5.13%	08/15/2027		159	160,418	0.0
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031		275	274,228	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028		440	481,784	0.0
DISH DBS Corp	5.00%	03/15/2023		61	63,452	0.0
DISH DBS Corp	5.88%	11/15/2024		90	95,814	0.0
DISH DBS Corp	6.75%	06/01/2021		40	40,000	0.0
DISH DBS Corp	7.38%	07/01/2028		725	778,057	0.1
DISH Network Corp	3.38%	08/15/2026		473	489,455	0.0
iHeartCommunications, Inc	4.75%	01/15/2028		240	244,597	0.0
iHeartCommunications, Inc	5.25%	08/15/2027		89	92,077	0.0
iHeartCommunications, Inc	6.38%	05/01/2026		468	500,146	0.0
iHeartCommunications, Inc	8.38%	05/01/2027		15	16,411	0.0
Lamar Media Corp	4.88%	01/15/2029		83	87,339	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	USD	958	1,025,177	0.1
Meredith Corp	6.88%	02/01/2026		1,759	1,837,848	0.2
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026		200	175,464	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028		128	122,192	0.0
Scripps Escrow II, Inc	5.38%	01/15/2031		236	236,700	0.0
Scripps Escrow, Inc	5.88%	07/15/2027		78	80,681	0.0
Sinclair Television Group, Inc	5.50%	03/01/2030		598	597,417	0.1
Sinclair Television Group, Inc	5.88%	03/15/2026		226	232,293	0.0
TEGNA, Inc	4.63%	03/15/2028		475	485,335	0.0
TEGNA, Inc	5.00%	09/15/2029		1,152	1,177,263	0.1
Univision Communications, Inc	4.50%	05/01/2029		519	525,288	0.1
Urban One, Inc	7.38%	02/01/2028		1,180	1,249,174	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026		975	1,011,641	0.1
Ziggo Bond Co.BV	5.13%	02/28/2030		206	209,638	0.0
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027		171	177,822	0.0
					<u>15,914,558</u>	<u>1.2</u>
通信 - 電気通信						
Altice France SA/France	5.13%	07/15/2029		945	937,086	0.1

Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026		421	437,816	0.0
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027		200	218,041	0.0
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026		644	668,111	0.1
Consolidated Communications, Inc	5.00%	10/01/2028		137	139,673	0.0
Consolidated Communications, Inc	6.50%	10/01/2028		649	701,617	0.1
DKT Finance ApS	9.38%	06/17/2023		1,150	1,175,854	0.1
Frontier Communications Holdings LLC	6.75%	05/01/2029		157	163,833	0.0
Hughes Satellite Systems Corp	6.63%	08/01/2026		450	499,761	0.0
Hughes Satellite Systems Corp	7.63%	06/15/2021		60	60,102	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	5.50%	08/01/2023		851	497,027	0.0
Level 3 Financing, Inc	5.25%	03/15/2026		480	494,437	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022		250	257,906	0.0
Lumen Technologies, Inc	5.13%	12/15/2026		290	300,633	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series G	6.88%	01/15/2028		115	127,936	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series S	6.45%	06/15/2021		230	230,414	0.0
Sprint Corp	7.25%	09/15/2021		5	5,086	0.0
T-Mobile USA, Inc	5.38%	04/15/2027		500	530,234	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038		3	3,930	0.0
Zayo Group Holdings, Inc	6.13%	03/01/2028		729	741,992	0.1
					8,191,489	0.6
景気連動型消費財 - 自動車						
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025		130	143,643	0.0
Allison Transmission, Inc	5.88%	06/01/2029		877	953,678	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc	6.88%	07/01/2028		624	677,144	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd	10.50%	11/30/2025		504	556,222	0.0
Aston Martin Capital Holdings Ltd.(b)	15.00%	11/30/2026		686	752,268	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co	6.25%	05/15/2026		1,157	1,235,433	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	5.75%	04/15/2025		5	5,163	0.0
Dana, Inc	5.38%	11/15/2027		61	64,929	0.0
Dana, Inc	5.63%	06/15/2028		91	98,164	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028		751	792,830	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co.(The)	5.00%	07/15/2029		162	165,364	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co.(The)	5.25%	07/15/2031		147	150,240	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025	EUR	100	124,261	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.38%	05/15/2029	USD	534	586,066	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	EUR	250	331,487	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	USD	603	614,185	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025		536	583,810	0.0
Meritor, Inc	4.50%	12/15/2028		826	830,130	0.1
Meritor, Inc	6.25%	06/01/2025		200	212,802	0.0
PM General Purchaser LLC	9.50%	10/01/2028		535	584,923	0.0

Real Hero Merger Sub 2, Inc	6.25%	02/01/2029		255	263,366	0.0
Tenneco, Inc	5.00%	07/15/2026		775	769,339	0.1
Tenneco, Inc	7.88%	01/15/2029		525	588,436	0.0
Titan International, Inc	7.00%	04/30/2028		595	619,815	0.1
					11,703,698	0.9
景気連動型消費財 - エンターテイメント						
Carnival Corp	5.75%	03/01/2027		467	496,187	0.1
Carnival Corp	7.63%	03/01/2026	EUR	304	410,195	0.0
Carnival Corp	9.88%	08/01/2027	USD	354	414,180	0.0
Carnival Corp	11.50%	04/01/2023		812	928,547	0.1
Carnival PLC	1.00%	10/28/2029	EUR	138	138,115	0.0
Cedar Fair LP/Canada 's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.38%	04/15/2027	USD	760	779,485	0.1
Cedar Fair LP/Canada 's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025		1,105	1,154,334	0.1
Mattel, Inc	5.88%	12/15/2027	USD	206	225,655	0.0
Mattel, Inc	6.75%	12/31/2025		15	15,782	0.0
NCL Corp., Ltd	3.63%	12/15/2024		1,200	1,147,710	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd	5.50%	04/01/2028		236	248,095	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd	10.88%	06/01/2023		738	846,855	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd	11.50%	06/01/2025		1,329	1,538,317	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc	8.75%	05/01/2025		479	518,288	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc	9.50%	08/01/2025		432	466,123	0.0
Silversea Cruise Finance Ltd	7.25%	02/01/2025		44	45,537	0.0
Six Flags Entertainment Corp	5.50%	04/15/2027		300	311,293	0.0
Six Flags Theme Parks, Inc	7.00%	07/01/2025		213	229,543	0.0
Vail Resorts, Inc	6.25%	05/15/2025		156	166,307	0.0
Viking Cruises Ltd	5.88%	09/15/2027		1,663	1,610,478	0.1
Viking Cruises Ltd	7.00%	02/15/2029		195	200,275	0.0
VOC Escrow Ltd	5.00%	02/15/2028		950	957,128	0.1
					12,848,429	1.0
景気連動型消費財 - その他						
Adams Homes, Inc	7.50%	02/15/2025		342	359,888	0.0
Bally 's Corp	6.75%	06/01/2027		446	474,182	0.0
Beazer Homes USA, Inc	6.75%	03/15/2025		17	17,607	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030		499	491,182	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027		460	485,402	0.0
Caesars Entertainment, Inc	6.25%	07/01/2025		600	632,668	0.1
CP Atlas Buyer, Inc	7.00%	12/01/2028		245	253,341	0.0

Empire Communities Corp	7.00%	12/15/2025		154	163,341	0.0
Five Point Operating Co.LP/Five Point Capital Corp	7.88%	11/15/2025		432	456,610	0.0
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp	6.50%	07/15/2025		158	170,281	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc	3.63%	02/15/2032		513	503,011	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc	5.38%	05/01/2025		154	161,990	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc	5.75%	05/01/2028		166	178,861	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029		375	379,006	0.0
Installed Building Products, Inc	5.75%	02/01/2028		33	34,733	0.0
K.Hovnanian Enterprises, Inc	10.00%	07/15/2022		13	13,081	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029		65	69,849	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc	6.13%	09/15/2025		164	174,399	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026		1,001	1,042,872	0.1
Mattamy Group Corp	4.63%	03/01/2030		410	409,084	0.0
Scientific Games International, Inc	5.00%	10/15/2025		980	1,009,677	0.1
Scientific Games International, Inc	7.00%	05/15/2028		25	27,043	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp	4.75%	02/15/2028		238	238,372	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp	4.75%	04/01/2029		484	483,377	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp	5.88%	05/15/2025		24	23,617	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc	5.75%	01/15/2028		129	143,440	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc	5.88%	04/15/2023		50	53,000	0.0
Travel + Leisure Co	6.00%	04/01/2027		651	720,233	0.1
Victors Merger Corp	6.38%	05/15/2029		816	810,092	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp	5.50%	03/01/2025		470	501,036	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp	5.13%	10/01/2029		137	142,713	0.0
					10,623,988	0.8
景気連動型消費財 - レストラン						
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc	5.75%	04/15/2025		297	314,711	0.0
IRB Holding Corp	6.75%	02/15/2026		379	392,265	0.1
					706,976	0.1
景気連動型消費財 - 小売						
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(b)	7.75%	04/01/2027		276	286,427	0.0
Burlington Coat Factory Warehouse Corp	6.25%	04/15/2025		71	76,616	0.0
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024	EUR	833	1,003,834	0.1
FirstCash, Inc	4.63%	09/01/2028	USD	132	136,517	0.0
Foundation Building Materials, Inc	6.00%	03/01/2029		132	129,422	0.0
L Brands, Inc	5.25%	02/01/2028		364	395,578	0.0
L Brands, Inc	6.63%	10/01/2030		178	203,497	0.0

L Brands, Inc	6.75%	07/01/2036		347	413,604	0.0
L Brands, Inc	7.50%	06/15/2029		117	135,035	0.0
L Brands, Inc	9.38%	07/01/2025		62	78,935	0.0
LBM Acquisition LLC	6.25%	01/15/2029		174	177,906	0.0
Magic Mergeco, Inc	7.88%	05/01/2029		793	808,678	0.1
Murphy Oil USA, Inc	4.75%	09/15/2029		460	480,422	0.1
Murphy Oil USA, Inc	5.63%	05/01/2027		4	4,223	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC	7.13%	04/01/2026		328	346,416	0.0
Penske Automotive Group, Inc	5.50%	05/15/2026	USD	1,087	1,118,895	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp	4.75%	02/15/2028		361	373,936	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp	7.75%	02/15/2029		816	898,696	0.1
Rite Aid Corp	7.50%	07/01/2025		733	761,387	0.1
Sonic Automotive, Inc	6.13%	03/15/2027		26	27,295	0.0
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp	6.38%	09/30/2026		1,021	1,064,497	0.1
SRS Distribution, Inc	6.13%	07/01/2029		157	160,140	0.0
Staples, Inc	7.50%	04/15/2026		154	159,769	0.0
Staples, Inc	10.75%	04/15/2027		827	846,514	0.1
TPro Acquisition Corp	11.00%	10/15/2024		70	76,949	0.0
White Cap Buyer LLC	6.88%	10/15/2028		843	889,018	0.1
White Cap Parent LLC(b)	8.25%	03/15/2026		175	180,712	0.0
William Carter Co.(The)	5.50%	05/15/2025		248	261,690	0.0
					11,496,608	0.9
生活必需品						
AdaptHealth LLC	4.63%	08/01/2029		691	678,262	0.1
AdaptHealth LLC	6.13%	08/01/2028		146	153,791	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027		347	359,185	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030		240	250,113	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC	5.75%	03/15/2025		8	8,215	0.0
Bausch Health Americas, Inc	8.50%	01/31/2027		211	226,440	0.0
Bausch Health Cos., Inc	4.88%	06/01/2028		728	733,199	0.1
Bausch Health Cos., Inc	6.13%	04/15/2025		44	44,939	0.0
Bausch Health Cos., Inc	6.25%	02/15/2029		30	29,330	0.0
Catalent Pharma Solutions, Inc	5.00%	07/15/2027		450	468,237	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc	6.75%	07/15/2025		40	42,700	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc	4.75%	02/15/2031		231	226,738	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc	6.88%	04/01/2028		308	295,407	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc	6.88%	04/15/2029		1,706	1,752,350	0.1

Emergent BioSolutions, Inc	3.88%	08/15/2028	69	67,752	0.0
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc	6.00%	06/30/2028	188	129,993	0.0
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc	9.50%	07/31/2027	461	469,067	0.0
Endo Luxembourg Finance Co.l Sarl/Endo US, Inc	6.13%	04/01/2029	122	120,163	0.0
Global Medical Response, Inc	6.50%	10/01/2025	795	818,391	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc	5.00%	12/31/2026	607	617,292	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc	7.00%	12/31/2027	777	790,019	0.1
Lamb Weston Holdings, Inc	4.63%	11/01/2024	14	14,492	0.0
Lamb Weston Holdings, Inc	4.88%	11/01/2026	13	13,456	0.0
Legacy LifePoint Health LLC	4.38%	02/15/2027	967	964,562	0.1
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c)	5.50%	04/15/2025	22	13,703	0.0
ModivCare, Inc	5.88%	11/15/2025	97	102,356	0.0
Organon Finance 1 LLC	5.13%	04/30/2031	431	443,072	0.0
Post Holdings, Inc	5.50%	12/15/2029	64	68,353	0.0
Post Holdings, Inc	5.63%	01/15/2028	27	28,508	0.0
RP Escrow Issuer LLC	5.25%	12/15/2025	203	210,107	0.0
Spectrum Brands, Inc	3.88%	03/15/2031	990	965,049	0.1
Tenet Healthcare Corp	4.88%	01/01/2026	577	595,828	0.1
Tenet Healthcare Corp	5.13%	05/01/2025	573	581,045	0.1
Tenet Healthcare Corp	6.25%	02/01/2027	425	443,823	0.0
Triton Water Holdings, Inc	6.25%	04/01/2029	352	352,928	0.0
US Acute Care Solutions LLC	6.38%	03/01/2026	96	99,351	0.0
US Foods, Inc	4.75%	02/15/2029	1,094	1,090,539	0.1
US Renal Care, Inc	10.63%	07/15/2027	1,228	1,282,796	0.1
Vizient, Inc	6.25%	05/15/2027	21	22,191	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc	5.75%	04/15/2026	132	137,500	0.0
				15,711,242	1.2
エネルギー					
Antero Resources Corp	5.00%	03/01/2025	430	440,734	0.0
Antero Resources Corp	8.38%	07/15/2026	327	368,865	0.0
Apache Corp	4.63%	11/15/2025	25	26,545	0.0
Apache Corp	4.88%	11/15/2027	46	48,295	0.0
Apache Corp	7.75%	12/15/2029	17	19,910	0.0
Berry Petroleum Co.LLC	7.00%	02/15/2026	279	276,037	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp	6.63%	07/15/2026	153	159,598	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp	7.63%	12/15/2025	234	253,098	0.0

Bonanza Creek Energy, Inc	7.50%	04/30/2026		3	3,370	0.0
Callon Petroleum, Co	6.25%	04/15/2023		15	14,207	0.0
Callon Petroleum, Co	8.25%	07/15/2025		10	9,474	0.0
Callon Petroleum, Co	9.00%	04/01/2025		887	929,647	0.1
Cheniere Energy Partners LP	4.50%	10/01/2029		176	186,433	0.0
Citgo Holding, Inc	9.25%	08/01/2024		69	70,731	0.0
CITGO Petroleum Corp	6.38%	06/15/2026		251	258,172	0.0
CITGO Petroleum Corp	7.00%	06/15/2025	USD	888	923,182	0.1
CNX Resources Corp	6.00%	01/15/2029		379	404,098	0.0
Comstock Resources, Inc	6.75%	03/01/2029		57	59,475	0.0
Comstock Resources, Inc	7.50%	05/15/2025		19	19,703	0.0
Comstock Resources, Inc	9.75%	08/15/2026		1,080	1,171,380	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028		697	697,342	0.1
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028		597	621,513	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024		37	38,397	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045		467	393,465	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047		321	281,254	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044		61	54,514	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp	5.63%	06/15/2024		18	18,021	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp	6.25%	05/15/2026		75	74,020	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp	6.50%	10/01/2025		493	496,742	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp	7.75%	02/01/2028		1,887	1,897,092	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp	6.88%	01/15/2029		220	237,643	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp	7.00%	08/01/2027		72	76,286	0.0
Gulfport Energy Corp	8.00%	05/17/2026		610	677,352	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co	5.75%	02/01/2029		157	161,110	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co	6.00%	02/01/2031		158	163,331	0.0
Independence Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026		564	571,680	0.1
Indigo Natural Resources LLC	5.38%	02/01/2029		407	409,087	0.0
Ithaca Energy North Sea PLC	9.38%	07/15/2024		1,930	1,948,141	0.2
Moss Creek Resources Holdings, Inc	7.50%	01/15/2026		543	481,727	0.0
Moss Creek Resources Holdings, Inc	10.50%	05/15/2027		330	312,657	0.0
Nabors Industries Ltd	7.25%	01/15/2026		152	135,245	0.0
Nabors Industries Ltd	7.50%	01/15/2028		679	576,948	0.1
Nabors Industries, Inc	5.75%	02/01/2025		600	497,751	0.1
Neptune Energy Bondco PLC	6.63%	05/15/2025		360	367,835	0.0
New Fortress Energy, Inc	6.75%	09/15/2025		924	938,285	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp	7.50%	02/01/2026		1,079	1,122,083	0.1
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp	7.50%	11/01/2023		531	517,284	0.1
Occidental Petroleum Corp	2.70%	02/15/2023		408	410,695	0.0

Occidental Petroleum Corp	2.90%	08/15/2024	232	231,738	0.0
Occidental Petroleum Corp	3.40%	04/15/2026	37	36,206	0.0
Occidental Petroleum Corp	3.50%	06/15/2025	188	188,232	0.0
Occidental Petroleum Corp	5.50%	12/01/2025	77	82,925	0.0
Occidental Petroleum Corp	5.88%	09/01/2025	130	140,819	0.0
Occidental Petroleum Corp	6.13%	01/01/2031	180	199,614	0.0
Occidental Petroleum Corp	6.95%	07/01/2024	70	77,809	0.0
Occidental Petroleum Corp	8.00%	07/15/2025	205	240,635	0.0
Occidental Petroleum Corp	8.50%	07/15/2027	103	125,344	0.0
Occidental Petroleum Corp	8.88%	07/15/2030	103	132,067	0.0
PBF Holding Co.LLC/PBF Finance Corp	9.25%	05/15/2025	900	926,080	0.1
PDC Energy, Inc	5.75%	05/15/2026	22	22,927	0.0
PDC Energy, Inc	6.13%	09/15/2024	51	52,167	0.0
Range Resources Corp	8.25%	01/15/2029	218	243,078	0.0
Renewable Energy Group, Inc	5.88%	06/01/2028	110	114,436	0.0
SM Energy Co	5.63%	06/01/2025	703	672,694	0.1
SM Energy Co	6.75%	09/15/2026	15	14,952	0.0
Southwestern Energy Co	8.38%	09/15/2028	229	253,683	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp	5.88%	03/15/2028	40	42,118	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp	6.00%	04/15/2027	3	3,132	0.0
Talos Production, Inc	12.00%	01/15/2026	815	831,300	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd	7.75%	10/15/2024	19	19,492	0.0
Transocean Poseidon Ltd	6.88%	02/01/2027	49	47,839	0.0
Transocean Sentry Ltd	5.38%	05/15/2023	747	716,365	0.1
Transocean, Inc	7.25%	11/01/2025	33	26,303	0.0
Transocean, Inc	7.50%	01/15/2026	19	14,913	0.0
Transocean, Inc	8.00%	02/01/2027	328	248,851	0.0
Transocean, Inc	11.50%	01/30/2027	334	332,115	0.0
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	137	142,398	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	156	159,555	0.0
Western Midstream Operating LP	4.35%	02/01/2025	320	334,897	0.0
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	207	219,604	0.0
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	167	179,499	0.0
Western Midstream Operating LP	5.30%	02/01/2030	278	306,447	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	104	107,742	0.0
				27,308,430	2.0
その他資本財・サービス					
Avient Corp	5.75%	05/15/2025	202	213,351	0.0
Interface, Inc	5.50%	12/01/2028	130	135,981	0.0
KAR Auction Services, Inc	5.13%	06/01/2025	637	650,692	0.1
Laureate Education, Inc	8.25%	05/01/2025	16	16,660	0.0

1,016,684

0.1

サービス

ADT Security Corp.(The)	4.88%	07/15/2032	USD	165	170,169	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp	6.63%	07/15/2026		1,166	1,238,053	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp	9.75%	07/15/2027		1,062	1,170,967	0.1
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028		1,227	1,204,297	0.1
Aptim Corp	7.75%	06/15/2025		295	256,830	0.0
APX Group, Inc	6.75%	02/15/2027		79	83,660	0.0
APX Group, Inc	7.63%	09/01/2023		85	87,478	0.0
APX Group, Inc	7.88%	12/01/2022		373	374,709	0.0
Carriage Services, Inc	6.63%	06/01/2026		35	36,739	0.0
Cars.com, Inc	6.38%	11/01/2028		421	447,166	0.0
Garda World Security Corp	6.00%	06/01/2029		1,299	1,287,324	0.1
Gartner, Inc	4.50%	07/01/2028		283	297,628	0.0
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028		275	279,011	0.0
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027		163	167,740	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028		1,377	1,369,956	0.1
Nielsen Co.Luxembourg SARL (The)	5.00%	02/01/2025		1,276	1,310,584	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc	6.25%	01/15/2028		1,002	1,035,391	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc	5.38%	01/15/2025		12	12,361	0.0
Sabre GBLB, Inc	9.25%	04/15/2025		364	426,141	0.0
Service Corp.International/US	3.38%	08/15/2030		597	579,644	0.1
TripAdvisor, Inc	7.00%	07/15/2025		205	220,867	0.0
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	EUR	508	638,096	0.1
Verscend Escrow Corp	9.75%	08/15/2026	USD	1,188	1,260,045	0.1
					13,954,856	1.0

テクノロジー

Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028		424	429,785	0.0
Austin BidCo, Inc	7.13%	12/15/2028		104	103,941	0.0
Avaya, Inc	6.13%	09/15/2028		1,402	1,487,278	0.1
Banff Merger Sub, Inc	9.75%	09/01/2026		1,691	1,790,921	0.1
Boxer Parent Co., Inc	7.13%	10/02/2025		204	218,610	0.0
Cablevision Lightpath LLC	5.63%	09/15/2028		560	564,677	0.1
CommScope, Inc	5.50%	03/01/2024		506	521,348	0.1
CommScope, Inc	6.00%	03/01/2026		31	32,597	0.0
Microchip Technology, Inc	4.25%	09/01/2025		341	357,892	0.0
NCR Corp	5.75%	09/01/2027		54	56,857	0.0
NCR Corp	6.13%	09/01/2029		908	985,894	0.1

NCR Corp	8.13%	04/15/2025		58	63,194	0.0
Presidio Holdings, Inc	4.88%	02/01/2027		199	204,462	0.0
Presidio Holdings, Inc	8.25%	02/01/2028		403	439,032	0.0
Science Applications International Corp	4.88%	04/01/2028		64	66,408	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029		116	116,961	0.0
Solera LLC/Solera Finance, Inc	10.50%	03/01/2024		60	61,599	0.0
TTM Technologies, Inc	4.00%	03/01/2029		502	497,464	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd	7.50%	09/01/2025		1,749	1,810,965	0.1
					<u>9,809,885</u>	<u>0.7</u>
輸送-航空						
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd	5.50%	04/20/2026		563	594,687	0.1
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd	5.75%	04/20/2029		494	528,558	0.0
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd	5.75%	01/20/2026		271	287,692	0.0
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd	8.00%	09/20/2025		535	607,112	0.1
United Airlines, Inc	4.63%	04/15/2029		162	167,774	0.0
					<u>2,185,823</u>	<u>0.2</u>
運輸 - サービス						
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045		860	917,248	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc	5.38%	03/01/2029		364	378,550	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc	5.75%	07/15/2027		488	513,222	0.0
Modulaire Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023		1,945	1,982,020	0.2
United Rentals North America, Inc	5.50%	05/15/2027		18	19,037	0.0
United Rentals North America, Inc	5.88%	09/15/2026		69	71,783	0.0
					<u>3,881,860</u>	<u>0.3</u>
					<u>172,761,579</u>	<u>13.0</u>
公益事業						
電力						
Calpine Corp	5.25%	06/01/2026		510	524,862	0.1
NRG Energy, Inc	6.63%	01/15/2027		3	3,113	0.0
NRG Energy, Inc	7.25%	05/15/2026		525	545,023	0.1
Talen Energy Supply LLC	6.50%	06/01/2025		205	172,603	0.0
Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027		371	379,208	0.0
Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026		322	293,020	0.0
Vistra Operations Co.LLC	5.63%	02/15/2027		48	49,891	0.0
					<u>1,967,720</u>	<u>0.2</u>
その他公益事業						
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	USD	183	191,698	0.0
					<u>2,159,418</u>	<u>0.2</u>

197,605,490

14.9

国債

コロンビア

Colombian TES, Series B	6.25%	11/26/2025	COP	6,765,500	1,877,043	0.1
-------------------------	-------	------------	-----	-----------	-----------	-----

エジプト

Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	06/29/2021	EGP	28,125	1,777,478	0.1
-----------------------------------	-------	------------	-----	--------	-----------	-----

インドネシア

Indonesia Treasury Bond, Series FR70	8.38%	03/15/2024	IDR	2,113,000	160,712	0.0
--------------------------------------	-------	------------	-----	-----------	---------	-----

Indonesia Treasury Bond, Series FR71	9.00%	03/15/2029		31,042,000	2,510,958	0.2
--------------------------------------	-------	------------	--	------------	-----------	-----

					2,671,670	0.2
--	--	--	--	--	-----------	-----

メキシコ

Mexican Bonos, Series M	6.50%	06/10/2021	MXN	2,100	105,496	0.0
-------------------------	-------	------------	-----	-------	---------	-----

Mexican Bonos, Series M	8.00%	09/05/2024		132,187	7,074,163	0.5
-------------------------	-------	------------	--	---------	-----------	-----

Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047		9,444	493,851	0.1
-------------------------	-------	------------	--	-------	---------	-----

Mexican Bonos, Series M 20	7.50%	06/03/2027		31,868	1,691,957	0.1
----------------------------	-------	------------	--	--------	-----------	-----

Mexican Bonos, Series M 20	10.00%	12/05/2024		37,077	2,107,547	0.2
----------------------------	--------	------------	--	--------	-----------	-----

					11,473,014	0.9
--	--	--	--	--	------------	-----

ロシア

Russian Federal Bond - OFZ, Series 6209	7.60%	07/20/2022	RUB	1,155	16,064	0.0
---	-------	------------	-----	-------	--------	-----

Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212	7.05%	01/19/2028		20,100	278,452	0.0
---	-------	------------	--	--------	---------	-----

Russian Federal Bond - OFZ, Series 6215	7.00%	08/16/2023		132,181	1,839,125	0.2
---	-------	------------	--	---------	-----------	-----

					2,133,641	0.2
--	--	--	--	--	-----------	-----

米国

U.S.Treasury Bonds	1.25%	05/15/2050	USD	2,333	1,813,752	0.1
--------------------	-------	------------	-----	-------	-----------	-----

U.S.Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030		250	350,859	0.0
--------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

U.S.Treasury Notes(d)	0.63%	08/15/2030		22,438	20,663,719	1.6
-----------------------	-------	------------	--	--------	------------	-----

U.S.Treasury Notes(d)	0.88%	11/15/2030		21,912	20,590,433	1.6
-----------------------	-------	------------	--	--------	------------	-----

U.S.Treasury Notes	1.63%	08/15/2029		31,987	32,486,695	2.5
--------------------	-------	------------	--	--------	------------	-----

U.S.Treasury Notes	2.13%	03/31/2024		3,000	3,157,032	0.2
--------------------	-------	------------	--	-------	-----------	-----

U.S.Treasury Notes	2.25%	02/15/2027		1,400	1,499,313	0.1
--------------------	-------	------------	--	-------	-----------	-----

U.S.Treasury Notes	2.63%	02/15/2029		7,402	8,087,841	0.6
--------------------	-------	------------	--	-------	-----------	-----

U.S.Treasury Notes	3.13%	11/15/2028		920	1,037,875	0.1
--------------------	-------	------------	--	-----	-----------	-----

					89,687,519	6.8
--	--	--	--	--	------------	-----

					109,620,365	8.3
--	--	--	--	--	-------------	-----

新興市場 - ソブリン債

アンゴラ

Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029		1,936	1,968,428	0.2
---------------------------------------	-------	------------	--	-------	-----------	-----

Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049		1,856	1,888,828	0.1
---------------------------------------	-------	------------	--	-------	-----------	-----

Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048		202	209,045	0.0
---------------------------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025		400	439,450	0.0
---------------------------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

					4,505,751	0.3
--	--	--	--	--	-----------	-----

アルゼンチン

Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2030	3,994	1,469,748	0.1
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2035	8,186	2,692,626	0.2
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	01/09/2038	26	10,396	0.0
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2041	153	56,860	0.0
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	678	263,118	0.0
				4,492,748	0.3

バーレーン

Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	490	491,929	0.0
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	400	437,200	0.0
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	4,347	4,861,848	0.4
CBB International Sukuk Programme CoWLL	6.25%	11/14/2024	588	646,543	0.1
				6,437,520	0.5

コスタリカ

Costa Rica Government International Bond	4.38%	04/30/2025	400	416,325	0.1
Costa Rica Government International Bond	6.13%	02/19/2031	2,376	2,531,628	0.2
Costa Rica Government International Bond	7.16%	03/12/2045	249	261,964	0.0
				3,209,917	0.3

ドミニカ共和国

Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	954	977,433	0.1
Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060	275	270,531	0.0
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	1,503	1,696,042	0.1
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	150	170,578	0.0
Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049	2,696	2,887,753	0.2
Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	1,794	2,085,861	0.2
Dominican Republic International Bond	7.45%	04/30/2044	USD 200	240,537	0.0
				8,328,735	0.6

エクアドル

Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	261	146,796	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2030	1,118	967,195	0.1
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2035	2,727	1,905,230	0.1
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	1,172	741,615	0.1
				3,760,836	0.3

エジプト

Egypt Government International Bond	7.60%	03/01/2029	1,100	1,224,300	0.1
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	613	663,687	0.1
Egypt Government International Bond	8.15%	11/20/2059	280	284,952	0.0
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	1,056	1,119,888	0.1
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	3,160	3,397,593	0.2
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	1,210	1,328,202	0.1
				8,018,622	0.6

エルサルバドル

El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025		24	23,250	0.0
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027		2,786	2,726,797	0.2
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050		1,358	1,278,217	0.1
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035		15	15,038	0.0
El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023		11	11,206	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029		190	203,063	0.0
					<u>4,257,571</u>	<u>0.3</u>

ガボン

Gabon Government International Bond	6.38%	12/12/2024		397	418,704	0.0
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031		2,216	2,211,568	0.2
					<u>2,630,272</u>	<u>0.2</u>

ガーナ

Ghana Government International Bond	6.38%	02/11/2027		2,809	2,827,083	0.2
Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029		536	554,090	0.1
Ghana Government International Bond	8.13%	01/18/2026		466	501,183	0.0
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032		710	727,439	0.1
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049		201	195,950	0.0
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051		527	524,464	0.0
Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030		370	469,160	0.0
					<u>5,799,369</u>	<u>0.4</u>

グアテマラ

Guatemala Government Bond	4.90%	06/01/2030		1,198	1,339,738	0.1
---------------------------	-------	------------	--	-------	-----------	-----

ホンジュラス

Honduras Government International Bond	5.63%	06/24/2030		183	192,070	0.0
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027		2,936	3,214,553	0.3
					<u>3,406,623</u>	<u>0.3</u>

イラク

Iraq International Bond	5.80%	01/15/2028		236	227,213	0.0
Iraq International Bond	6.75%	03/09/2023		200	204,975	0.0
					<u>432,188</u>	<u>0.0</u>

コートジボワール

Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR	473	583,758	0.0
Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024	USD	3,167	3,414,026	0.3
Ivory Coast Government International Bond	5.88%	10/17/2031	EUR	645	855,270	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD	2,315	2,463,015	0.2
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028		518	576,048	0.0
					<u>7,892,117</u>	<u>0.6</u>

ジャマイカ

Jamaica Government International Bond	6.75%	04/28/2028		1,253	1,483,082	0.1
Jamaica Government International Bond	7.63%	07/09/2025		200	232,788	0.0

Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045		749	1,037,131	0.1
					2,753,001	0.2
ケニア						
Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024		1,694	1,880,658	0.2
Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027		257	282,828	0.0
Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028		1,783	1,977,793	0.1
					4,141,279	0.3
レバノン						
Lebanon Government International Bond(c)	6.65%	04/22/2024		25	3,278	0.0
Lebanon Government International Bond(c)	6.85%	03/23/2027		69	9,005	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G (c)	1.00%	11/27/2026		817	107,639	0.0
					119,922	0.0
モンゴル						
Mongolia Government International Bond	5.13%	12/05/2022	USD	1,126	1,170,196	0.1
ナミビア						
Namibia International Bonds	5.25%	10/29/2025		200	213,288	0.0
ナイジェリア						
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027		763	811,546	0.1
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030		500	532,281	0.0
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/21/2025		650	738,684	0.1
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047		1,568	1,580,054	0.1
Nigeria Government International Bond	8.75%	01/21/2031		1,940	2,214,389	0.2
					5,876,954	0.5
オマーン						
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025		828	865,415	0.1
Oman Government International Bond	5.38%	03/08/2027		1,340	1,390,920	0.1
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031		878	928,485	0.1
					3,184,820	0.3
パキスタン						
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027		225	235,167	0.0
セネガル						
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR	150	191,355	0.0
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD	1,417	1,496,086	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048		3,207	3,263,724	0.3
					4,951,165	0.4
南アフリカ						
Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029		2,392	2,530,736	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049		1,907	1,918,680	0.1

				4,449,416	0.3
ウクライナ					
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	3,778	4,008,930	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2022	390	410,548	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2023	700	756,481	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	100	109,988	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	310	343,693	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	2,352	2,613,366	0.3
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	352	421,256	0.0
				8,664,262	0.7
ベネズエラ					
Venezuela Government International Bond(c)	9.00%	05/07/2023	4	350	0.0
Venezuela Government International Bond(c)	9.25%	09/15/2027	219	21,900	0.0
				22,250	0.0
				100,293,727	7.6
優先株式					
金融機関					
分散型不動産投資信託					
Armada Hoffler Properties, Inc.Series A	6.75%		124,440	3,440,766	0.3
Colony Capital, Inc.Series G	7.50%		37,877	954,500	0.1
Colony Capital, Inc.Series H	7.13%		75,081	1,873,271	0.1
Colony Capital, Inc.Series I	7.15%		74,401	1,856,305	0.1
Colony Capital, Inc.Series J	7.13%		96,084	2,397,296	0.2
Gladstone Commercial Corp.Series D	7.00%		3,437	86,200	0.0
Gladstone Commercial Corp.Series E	6.63%		44,750	1,170,212	0.1
Global Net Lease, Inc.Series A	7.25%		72,050	1,900,679	0.1
Global Net Lease, Inc.Series B	6.88%		36,703	987,586	0.1
PS Business Parks, Inc.Series X	5.25%		17,650	470,549	0.0
PS Business Parks, Inc.Series Y	5.20%		42,613	1,133,506	0.1
PS Business Parks, Inc.Series Z	4.88%		73,300	1,986,430	0.2
Vornado Realty Trust Series L	5.40%		24,093	614,372	0.0
				18,871,672	1.4
ヘルスケア不動産投資信託					
Global Medical REIT, Inc.Series A	7.50%		16,474	437,385	0.0
ホテル・リゾート不動産投資信託					
DiamondRock Hospitality Co	8.25%		105,507	3,064,978	0.2
Hersha Hospitality Trust Series C	6.88%		37,190	909,295	0.1
Hersha Hospitality Trust Series D	6.50%		29,342	693,645	0.1
Hersha Hospitality Trust Series E	6.50%		14,874	353,406	0.0
Pebblebrook Hotel Trust Series C(a)	6.50%		28,825	735,902	0.1
Pebblebrook Hotel Trust Series D	6.38%		80,196	2,032,969	0.1

Pebblebrook Hotel Trust Series E	6.38%	40,482	1,028,648	0.1
Pebblebrook Hotel Trust Series F	6.30%	4,053	104,041	0.0
Summit Hotel Properties, Inc.Series D	6.45%	18,109	461,598	0.0
Summit Hotel Properties, Inc.Series E	6.25%	64,647	1,723,489	0.1
Sunstone Hotel Investors, Inc.Series E	6.95%	26,808	677,438	0.1
Sunstone Hotel Investors, Inc.Series F	6.45%	47,398	1,208,649	0.1
			<u>12,994,058</u>	<u>1.0</u>
産業不動産投資信託				
Monmouth Real Estate Investment Corp.Series C	6.13%	109,396	2,754,591	0.2
Plymouth Industrial REIT, Inc.Series A	7.50%	6,338	167,741	0.0
Rexford Industrial Realty, Inc.Series A	5.88%	53,947	1,370,793	0.1
Rexford Industrial Realty, Inc.Series B	5.88%	58,870	1,554,168	0.1
Rexford Industrial Realty, Inc.Series C	5.63%	29,222	810,326	0.1
			<u>6,657,619</u>	<u>0.5</u>
オフィス不動産投資信託				
City Office REIT, Inc.Series A	6.63%	66,510	1,703,986	0.1
SL Green Realty Corp.Series I	6.50%	12,450	322,330	0.0
Vornado Realty Trust Series M	5.25%	124,358	3,293,000	0.3
Vornado Realty Trust Series N	5.25%	7,072	188,257	0.0
			<u>5,507,573</u>	<u>0.4</u>
オイル、ガス・消耗燃料				
Gulfport Energy Corp	0.00%	56	266,000	0.0
不動産開発				
American Finance Trust, Inc.Series C	7.38%	117,300	3,015,783	0.2
Pebblebrook Hotel Trust Series G	6.38%	80,481	2,079,629	0.2
Sunstone Hotel Investors, Inc.Series H	6.13%	68,575	1,833,696	0.1
			<u>6,929,108</u>	<u>0.5</u>
不動産管理会社				
Brookfield Property Partners LP Series A	5.75%	8,864	217,080	0.0
Brookfield Property Partners LP Series A2	6.38%	34,597	918,550	0.1
			<u>1,135,630</u>	<u>0.1</u>
住宅不動産投資信託				
American Homes 4 Rent Series D	6.50%	110,764	2,801,222	0.2
American Homes 4 Rent Series E	6.35%	25,387	643,814	0.1
American Homes 4 Rent Series F	5.88%	40,244	1,050,771	0.1
American Homes 4 Rent Series G	5.88%	48,129	1,274,456	0.1
American Homes 4 Rent Series H	6.25%	13,501	371,547	0.0
Bluerock Residential Growth REIT, Inc.Series C	7.63%	24,474	623,952	0.0
Bluerock Residential Growth REIT, Inc.Series D	7.13%	36,139	914,317	0.1
UMH Properties, Inc.Series C	6.75%	12,275	317,800	0.0
UMH Properties, Inc.Series D	6.38%	155,645	4,032,762	0.3

12,030,641

0.9

リテール不動産投資信託

American Finance Trust, Inc.Series A	7.50%	12,673	328,611	0.0
Brookfield Property REIT, Inc.Series A	6.38%	82,506	2,087,402	0.1
Cedar Realty Trust, Inc.Series C	6.50%	45,026	1,134,655	0.1
Federal Realty Investment Trust Series C	5.00%	12,671	331,853	0.0
Kimco Realty Corp.Series L	5.13%	191	5,035	0.0
Kimco Realty Corp.Series M	5.25%	325	8,518	0.0
National Retail Properties, Inc.Series F	5.20%	12,168	309,797	0.0
Saul Centers, Inc.Series D	6.13%	33,900	897,333	0.1
Saul Centers, Inc.Series E	6.00%	56,093	1,493,196	0.1
Seritage Growth Properties Series A	7.00%	38,147	923,539	0.1
SITE Centers Corp.Series A	6.38%	114,056	2,944,926	0.2
Spirit Realty Capital, Inc.Series A	6.00%	79,684	2,157,046	0.2
Urstadt Biddle Properties, Inc.Series H	6.25%	80,452	2,123,128	0.2
Urstadt Biddle Properties, Inc.Series K	5.88%	34,529	890,848	0.1
			15,635,887	1.2

特化型不動産投資信託

Digital Realty Trust, Inc.Series K	5.85%	39,392	1,115,188	0.1
Digital Realty Trust, Inc.Series L	5.20%	148,716	4,128,356	0.3
EPR Properties Series G	5.75%	18,353	472,957	0.0
National Storage Affiliates Trust Series A	6.00%	121,499	3,250,098	0.3
Public Storage Series G	5.05%	16,257	429,835	0.0
Public Storage Series H	5.60%	12,649	354,046	0.0
Public Storage Series K	4.75%	34,642	960,276	0.1
Public Storage Series L	4.63%	4,600	124,062	0.0
Public Storage Series M	4.13%	80,348	2,089,048	0.2
QTS Realty Trust, Inc.Series A	7.13%	97,229	2,649,490	0.2
			15,573,356	1.2
			96,038,929	7.2

産業

住宅不動産投資信託

Centerspace Series C	6.63%	29,361	777,480	0.1
			96,816,409	7.3

社債 - 投資適格

金融機関

銀行

Ally Financial, Inc	8.00%	11/01/2031	USD	649	917,664	0.1
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple						
Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025		511	579,123	0.0

Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025		600	687,814	0.1
Bank of America Corp., Series DD(a)	6.30%	03/10/2026		144	166,911	0.0
Bank of America Corp., Series JJ(a)	5.13%	06/20/2024		1,274	1,360,736	0.1
Bank of America Corp., Series X(a)	6.25%	09/05/2024		140	155,398	0.0
Bank of America Corp., Series Z(a)	6.50%	10/23/2024		445	506,053	0.0
Barclays PLC(a)	7.88%	03/15/2022		207	216,169	0.0
BNP Paribas SA(a)	6.75%	03/14/2022		200	207,281	0.0
Citigroup, Inc.(a)	3.88%	02/18/2026		666	671,187	0.1
Citigroup, Inc.(a)	5.95%	01/30/2023		67	70,520	0.0
Citigroup, Inc., Series T(a)	6.25%	08/15/2026		99	115,149	0.0
Citigroup, Inc., Series U(a)	5.00%	09/12/2024		945	988,176	0.1
Citigroup, Inc., Series V(a)	4.70%	01/30/2025		143	146,872	0.0
Citigroup, Inc., Series W(a)	4.00%	12/10/2025		665	678,107	0.1
Credit Agricole SA(a)	8.13%	12/23/2025		1,045	1,267,392	0.1
DNB Bank ASA(a)	6.50%	03/26/2022		1,085	1,127,752	0.1
Erste Group Bank AG(a)	6.50%	04/15/2024	EUR	400	547,533	0.0
Goldman Sachs Group, Inc.(The), Series O(a)	5.30%	11/10/2026	USD	9	9,925	0.0
Goldman Sachs Group, Inc.(The), Series P(a)	5.00%	11/10/2022		792	796,371	0.1
HSBC Holdings PLC(a)	6.00%	05/22/2027		1,078	1,188,404	0.1
HSBC Holdings PLC(a)	6.38%	03/30/2025		980	1,085,350	0.1
ING Groep NV(a)	5.75%	11/16/2026		420	462,409	0.0
ING Groep NV(a)	6.75%	04/16/2024		200	219,990	0.0
ING Groep NV(a)	6.88%	04/16/2022		303	315,652	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series V(a) (e)	3.52%	07/01/2021		17	16,934	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series X(a)	6.10%	10/01/2024		750	813,935	0.1
KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	EUR	1,000	1,289,432	0.1
Lloyds Banking Group PLC(a)	6.66%	05/21/2037	USD	76	104,466	0.0
Lloyds Banking Group PLC(a)	7.50%	06/27/2024		434	490,152	0.0
Natwest Group PLC	2.00%	03/04/2025	EUR	115	147,564	0.0
PNC Financial Services Group, Inc.(The), Series R (a)	4.85%	06/01/2023	USD	120	125,700	0.0
Standard Chartered PLC(a)	7.50%	04/02/2022		1,215	1,269,456	0.1
Standard Chartered PLC(a)	7.75%	04/02/2023		730	795,959	0.1
Swedbank AB(a)	6.00%	03/17/2022		400	412,550	0.0
Swedbank AB, Series NC5(a)	5.63%	09/17/2024		200	216,486	0.0
UBS Group AG(a)	7.00%	02/19/2025		1,862	2,144,065	0.2
					<u>22,314,637</u>	<u>1.7</u>
証券仲買会社						
Charles Schwab Corp.(The), Series G(a)	5.38%	06/01/2025		743	821,910	0.1
ファイナンス						

AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023		238	247,043	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025		212	247,677	0.0
Aircastle Ltd	2.85%	01/26/2028		124	121,944	0.0
Aircastle Ltd	4.13%	05/01/2024		66	70,275	0.0
Aircastle Ltd	4.25%	06/15/2026		15	16,246	0.0
Aircastle Ltd	4.40%	09/25/2023		162	173,635	0.0
Aircastle Ltd	5.00%	04/01/2023		14	14,995	0.0
Aircastle Ltd	5.25%	08/11/2025		1,123	1,251,180	0.1
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026		39	38,813	0.0
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022		513	518,679	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027		145	151,818	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023		354	370,999	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025		222	238,750	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024		135	144,994	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025		166	183,351	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024		380	428,560	0.1
Huarong Finance 2017 Co., Ltd	3.75%	04/27/2022		347	261,985	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd	4.63%	06/03/2026		213	141,645	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd	5.50%	01/16/2025		500	346,250	0.0
Synchrony Financial	4.25%	08/15/2024		142	155,653	0.0
Synchrony Financial	4.38%	03/19/2024		212	232,284	0.0
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025		247	277,063	0.0
					5,633,839	0.4
保険						
Allstate Corp.(The)	6.50%	05/15/2057	USD	80	103,254	0.0
Centene Corp	5.38%	08/15/2026		37	38,708	0.0
Liberty Mutual Group, Inc	3.63%	05/23/2059	EUR	290	363,846	0.1
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	USD	100	138,122	0.0
MetLife, Inc	10.75%	08/01/2039		60	101,699	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co	9.38%	08/15/2039		30	50,603	0.0
Prudential Financial, Inc	5.20%	03/15/2044		28	30,081	0.0
Prudential Financial, Inc	5.63%	06/15/2043		81	87,556	0.0
Transatlantic Holdings, Inc	8.00%	11/30/2039		20	30,441	0.0
					944,310	0.1
その他ファイナンス						
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026		243	266,531	0.0
不動産投資信託						
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc	5.25%	06/01/2025		46	51,969	0.0

GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc	5.38%	04/15/2026	35	40,002	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp	4.63%	08/01/2029	376	400,701	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp	5.00%	10/15/2027	471	496,497	0.0
Sabra Health Care LP	4.80%	06/01/2024	74	81,150	0.0
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	795	876,140	0.1
Weyerhaeuser Co	7.38%	03/15/2032	20	28,716	0.0
				1,975,175	0.1
				31,956,402	2.4
資本財・サービス					
ベーシック					
Glencore Finance Canada Ltd	6.00%	11/15/2041	9	11,594	0.0
Glencore Funding LLC	4.63%	04/29/2024	11	12,132	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd	5.13%	05/15/2024	250	272,312	0.0
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	200	216,939	0.0
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	282	329,993	0.1
International Paper Co	3.80%	01/15/2026	34	38,034	0.0
MEGlobal Canada ULC	5.00%	05/18/2025	238	268,231	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	1,106	1,149,947	0.1
Vale Overseas Ltd	3.75%	07/08/2030	104	110,409	0.0
WestRock MWV LLC	8.20%	01/15/2030	10	14,036	0.0
				2,423,627	0.2
資本財					
General Electric Co., Series D(a) (e)	3.51%	09/15/2021	266	254,964	0.0
通信 - メディア					
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	509	537,822	0.1
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	234	220,959	0.0
TCI Communications, Inc	7.88%	02/15/2026	60	77,964	0.0
				836,745	0.1
通信 - 電気通信					
Hughes Satellite Systems Corp	5.25%	08/01/2026	41	45,616	0.0
Qwest Corp	6.75%	12/01/2021	460	472,651	0.0
				518,267	0.0
景気連動型消費財 - 自動車					
General Motors Co	4.88%	10/02/2023	255	278,949	0.0
General Motors Co	6.13%	10/01/2025	86	102,295	0.0
General Motors Co	6.80%	10/01/2027	121	152,819	0.0
General Motors Financial Co., Inc	3.25%	01/05/2023	105	109,247	0.0
General Motors Financial Co., Inc	3.50%	11/07/2024	57	61,535	0.0
General Motors Financial Co., Inc	3.70%	05/09/2023	168	176,941	0.0
General Motors Financial Co., Inc	3.95%	04/13/2024	105	113,688	0.0
General Motors Financial Co., Inc	4.15%	06/19/2023	65	69,345	0.0

General Motors Financial Co., Inc	4.25%	05/15/2023		14	14,955	0.0
General Motors Financial Co., Inc	4.30%	07/13/2025		119	132,148	0.0
General Motors Financial Co., Inc	5.10%	01/17/2024		182	201,480	0.0
General Motors Financial Co., Inc	5.20%	03/20/2023		110	118,920	0.0
General Motors Financial Co., Inc	5.25%	03/01/2026		69	79,943	0.0
General Motors Financial Co., Inc	5.65%	01/17/2029		423	511,282	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc	3.35%	06/08/2025		489	522,592	0.1
Lear Corp	3.50%	05/30/2030		199	211,962	0.0
Lear Corp	3.80%	09/15/2027		213	234,937	0.0
Lear Corp	4.25%	05/15/2029		149	166,792	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp	2.60%	09/28/2022		31	31,721	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp	2.80%	01/13/2022		27	27,352	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp	3.45%	03/15/2023		42	43,898	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp	3.88%	09/21/2023		145	154,565	0.0
Nissan Motor Co., Ltd	4.35%	09/17/2027		544	594,365	0.1
					4,111,731	0.3
景気運動型消費財 - その他						
Lennar Corp	4.75%	11/29/2027	USD	3	3,470	0.0
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025		176	204,293	0.0
MDC Holdings, Inc	6.00%	01/15/2043		2,054	2,610,562	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036		12	16,855	0.0
PulteGroup, Inc	6.38%	05/15/2033		16	20,853	0.0
PulteGroup, Inc	7.88%	06/15/2032		30	42,575	0.0
					2,898,608	0.2
生活必需品						
Sysco Corp	5.95%	04/01/2030		61	77,821	0.0
エネルギー						
Cenovus Energy, Inc	6.75%	11/15/2039		3	3,954	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031		487	571,235	0.1
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045		62	64,015	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030		537	634,331	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027		382	390,264	0.0
Enable Midstream Partners LP	4.40%	03/15/2027		781	863,608	0.1
Enable Midstream Partners LP	4.95%	05/15/2028		129	146,297	0.0
Energy Transfer LP	3.90%	07/15/2026		60	65,643	0.0
Energy Transfer LP	4.75%	01/15/2026		650	730,668	0.1
Energy Transfer Partners LP/Regency Energy Finance Corp	4.50%	11/01/2023		94	101,121	0.0
Hunt Oil Co.of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028		251	251,000	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.80%	08/01/2031		80	112,308	0.0
Marathon Petroleum Corp	4.50%	05/01/2023		451	482,766	0.0

Marathon Petroleum Corp	4.70%	05/01/2025	391	443,342	0.0
Marathon Petroleum Corp	4.75%	12/15/2023	62	67,957	0.0
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	515	531,583	0.0
ONEOK, Inc	2.20%	09/15/2025	213	219,514	0.0
ONEOK, Inc	2.75%	09/01/2024	753	796,208	0.1
ONEOK, Inc	5.85%	01/15/2026	427	507,417	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp	4.50%	12/15/2026	206	230,848	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp	4.65%	10/15/2025	566	632,833	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	244	275,488	0.0
				8,122,400	0.6
サービス					
Expedia Group, Inc	6.25%	05/01/2025	88	102,616	0.0
Verisk Analytics, Inc	5.50%	06/15/2045	19	24,917	0.0
				127,533	0.0
テクノロジー					
CDW LLC/CDW Finance Corp	4.13%	05/01/2025	382	399,306	0.1
Dell International LLC/EMC Corp	5.85%	07/15/2025	224	262,962	0.0
Dell International LLC/EMC Corp	6.02%	06/15/2026	89	106,200	0.0
Dell International LLC/EMC Corp	8.35%	07/15/2046	9	14,142	0.0
Nokia Oyj	6.63%	05/15/2039	40	51,850	0.0
				834,460	0.1
運輸 - 航空					
Delta Air Lines, Inc	7.00%	05/01/2025	719	836,486	0.1
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd	4.75%	10/20/2028	475	518,762	0.0
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus					
Intellectual Property Assets Ltd	6.50%	06/20/2027	1,646	1,806,708	0.1
				3,161,956	0.2
運輸 - 鉄道					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd	4.35%	04/05/2036	200	204,500	0.0
				23,572,612	1.7
公益事業					
電力					
Colbun SA	3.15%	03/06/2030	404	411,777	0.1
Consortio Transmantaro SA	4.38%	05/07/2023	200	210,184	0.0
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024	70	74,694	0.0
				696,655	0.1
				56,225,669	4.2
新興市場 - 社債					
金融機関					
銀行					
Absa Group Ltd.(a)	6.38%	05/27/2026	237	241,666	0.0

保険

Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands

Holdings Bond

Co-Issuer, Inc.(b)	7.63%	10/15/2025		348	369,241	0.1
					610,907	0.1

資本財・サービス

ベーシック

Braskem Finance Ltd	6.45%	02/03/2024	USD	602	681,228	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029		778	819,818	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030		441	457,538	0.0
Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026		205	205,922	0.0
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025		2,265	2,281,843	0.2
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028		252	277,193	0.0
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023		469	486,969	0.0
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026		1,220	1,311,347	0.1
Eldorado Gold Corp	9.50%	06/01/2024		387	421,818	0.0
First Quantum Minerals Ltd	6.88%	10/15/2027		645	705,134	0.1
First Quantum Minerals Ltd	7.25%	04/01/2023		2,080	2,121,600	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd	8.25%	10/22/2025		776	828,040	0.1
OCP SA	5.63%	04/25/2024		290	316,154	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024		947	1,044,270	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026		119	116,159	0.0
					12,075,033	0.9

資本財

Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027		424	478,405	0.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027		509	540,976	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028		410	466,546	0.0
Klabn Austria GmbH	7.00%	04/03/2049		822	1,021,675	0.1
					2,507,602	0.2

通信 - メディア

Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030		695	707,293	0.1
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028		212	224,063	0.0
					931,356	0.1

通信 - 電気通信

C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027		426	453,713	0.0
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026		440	463,351	0.1
Digicel International Finance Ltd./						
Digicel international Holdings Ltd	8.75%	05/25/2024		97	100,347	0.0
MTN Mauritius Investments Ltd	5.37%	02/13/2022		200	204,913	0.0
Sable International Finance Ltd	5.75%	09/07/2027		1,106	1,164,532	0.1
VTR Comunicaciones SpA	5.13%	01/15/2028		212	218,413	0.0

					2,605,269	0.2
景気運動型消費財 - その他						
MGM China Holdings Ltd	5.25%	06/18/2025		261	271,667	0.0
Studio City Finance Ltd	5.00%	01/15/2029		767	778,696	0.1
Wynn Macau Ltd	5.50%	10/01/2027		470	491,150	0.0
					1,541,513	0.1
生活必需品						
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026		412	430,537	0.0
BRF SA	4.88%	01/24/2030		1,148	1,192,700	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.13%	01/31/2025		260	283,892	0.0
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025		232	250,459	0.0
					2,157,588	0.1
エネルギー						
Cosan Ltd	5.50%	09/20/2029		225	240,581	0.0
Gran Tierra Energy, Inc	7.75%	05/23/2027		245	209,782	0.0
Investment Energy Resources Ltd	6.25%	04/26/2029		357	384,937	0.0
Kosmos Energy Ltd	7.50%	03/01/2028		266	255,359	0.0
Leviathan Bond Ltd	6.13%	06/30/2025		203	222,937	0.0
Leviathan Bond Ltd	6.50%	06/30/2027		371	412,106	0.1
Medco Oak Tree Pte Ltd	7.38%	05/14/2026		200	218,287	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034		189	202,986	0.0
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030		964	757,523	0.1
Petrobras Global Finance BV	5.60%	01/03/2031		393	433,663	0.1
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049		220	255,831	0.0
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026		25	32,009	0.0
SEPLAT Petroleum Development CoPLC	7.75%	04/01/2026		288	296,640	0.0
					3,922,641	0.3
					25,741,002	1.9
公益事業						
電力						
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079		210	222,604	0.0
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	12/05/2024		1,417	1,633,801	0.2
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023		429	445,302	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd	6.75%	04/24/2033		177	201,647	0.0
					2,503,354	0.2
					28,855,263	2.2
不動産抵当証券担保債券						
エージェンシー変動金利						
Federal Home Loan Mortgage Corp.REMICs						
Series 3346, Class SC(e) (f)	6.45%	10/15/2033	USD	9,279	1,902,404	0.1
Series 4954, Class SL(e) (f)	5.96%	02/25/2050		11,739	2,212,495	0.2

4,114,899

0.3

リスクシェア変動金利

Bellemeade Re Ltd

Series 2019-1A, Class M2(e)	2.79%	03/25/2029	235	235,731	0.0
Series 2019-2A, Class M1C(e)	2.09%	04/25/2029	205	206,189	0.0
Series 2019-3A, Class M1C(e)	2.04%	07/25/2029	208	208,000	0.0

Connecticut Avenue Securities Trust

Series 2018-R07, Class 1B1(e)	4.44%	04/25/2031	24	24,707	0.0
Series 2018-R07, Class 1M2(e)	2.49%	04/25/2031	274	275,333	0.0
Series 2019-R02, Class 1M2(e)	2.39%	08/25/2031	70	70,889	0.0
Series 2019-R07, Class 1M2(e)	2.19%	10/25/2039	596	599,153	0.1
Series 2020-SBT1, Class 1M2(e)	3.74%	02/25/2040	598	610,691	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(e)	3.74%	02/25/2040	237	243,761	0.0

Federal Home Loan Mortgage CorpStructured

Agency Credit Risk

Debt Notes

Series 2015-DNA3, Class B(e)	9.44%	04/25/2028	246	290,486	0.0
Series 2016-DNA3, Class B(e)	11.34%	12/25/2028	247	291,323	0.0
Series 2017-DNA1, Class B1(e)	5.04%	07/25/2029	250	268,228	0.0
Series 2017-DNA3, Class M2(e)	2.59%	03/25/2030	250	255,401	0.0
Series 2017-HQA1, Class M2(e)	3.64%	08/25/2029	210	216,705	0.0
Series 2017-HQA3, Class M2(e)	2.44%	04/25/2030	180	183,866	0.0
Series 2018-DNA1, Class B1(e)	3.24%	07/25/2030	110	110,481	0.0
Series 2018-DNA1, Class M2(e)	1.89%	07/25/2030	213	214,262	0.0
Series 2018-HQA2, Class B1(e)	4.34%	10/25/2048	2,000	2,082,307	0.2
Series 2019-DNA1, Class M2(e)	2.74%	01/25/2049	182	185,024	0.0
Series 2019-DNA3, Class B1(e)	3.34%	07/25/2049	3,000	3,033,795	0.2
Series 2019-DNA3, Class M2(e)	2.14%	07/25/2049	19	19,529	0.0
Series 2019-HQA3, Class M2(e)	1.94%	09/25/2049	511	513,756	0.1
Series 2020-DNA1, Class M2(e)	1.79%	01/25/2050	979	983,055	0.1

Federal National Mortgage Association Connecticut

Avenue

Securities

Series 2014-C02, Class 1M2(e)	2.69%	05/25/2024	32	31,706	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(e)	4.99%	11/25/2024	13	12,969	0.0
Series 2015-C02, Class 1M2(e)	4.09%	05/25/2025	17	17,121	0.0
Series 2015-C02, Class 2M2(e)	4.09%	05/25/2025	6	6,504	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(e)	5.64%	04/25/2028	82	86,950	0.0
Series 2016-C02, Class 1B(e)	12.34%	09/25/2028	20	24,786	0.0
Series 2016-C03, Class 2M2(e)	5.99%	10/25/2028	46	48,440	0.0
Series 2016-C05, Class 2B(e)	10.84%	01/25/2029	1,377	1,629,061	0.1

Series 2016-C05, Class 2M2(e)	4.54%	01/25/2029		24	25,399	0.0
Series 2016-C06, Class 1B(e)	9.34%	04/25/2029		38	42,884	0.0
Series 2016-C06, Class 1M2(e)	4.34%	04/25/2029		146	152,557	0.0
Series 2016-C07, Class 2B(e)	9.59%	05/25/2029		41	46,255	0.0
Series 2016-C07, Class 2M2(e)	4.44%	05/25/2029		69	71,779	0.0
Series 2017-C01, Class 1B1(e)	5.84%	07/25/2029		3,173	3,482,497	0.3
Series 2017-C02, Class 2M2(e)	3.74%	09/25/2029		370	383,431	0.0
Series 2017-C03, Class 1B1(e)	4.94%	10/25/2029		423	451,884	0.1
Series 2017-C05, Class 1B1(e)	3.69%	01/25/2030		229	238,587	0.0
Series 2017-C06, Class 1B1(e)	4.24%	02/25/2030		921	949,689	0.1
Series 2017-C06, Class 2M2(e)	2.89%	02/25/2030		153	156,423	0.0
Series 2017-C07, Class 1M2(e)	2.49%	05/25/2030		173	175,988	0.0
Series 2017-C07, Class 2M2(e)	2.59%	05/25/2030		271	275,410	0.0
Series 2018-C01, Class 1B1(e)	3.64%	07/25/2030		248	253,769	0.0
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M2(e)	3.09%	10/25/2028		150	151,698	0.0
Mortgage Insurance-Linked Notes, Series 2019-1, Class M2(e)	2.99%	11/26/2029		850	850,000	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2020-1, Class M1B(e)	1.54%	01/25/2030		397	396,763	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M2(e)	5.69%	10/25/2030		230	237,704	0.0
					21,322,926	1.6
					25,437,825	1.9
投資会社						
ファンド・投資信託						
iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF				20,841	2,319,395	0.2
iShares S&P 500 Energy Sector UCITS ETF				1,837,710	8,453,466	0.6
iShares S&P 500 Financials Sector UCITS ETF USD ACC				785,900	8,173,360	0.6
iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF				642,010	5,356,771	0.4
					24,302,992	1.8
準ソブリン						
準ソブリン債						
パーレーン						
Oil and Gas Holding Co.BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	USD	433	485,988	0.1
Oil and Gas Holding Co.BSCC (The)	8.38%	11/07/2028		200	233,725	0.0
					719,713	0.1
インドネシア						
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030		269	310,157	0.0
メキシコ						
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031		2,760	2,684,100	0.2
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027		855	912,841	0.1

Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029		346	353,698	0.0
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047		1,518	1,341,457	0.1
Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030		712	736,130	0.0
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060		516	453,306	0.0
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050		2,207	2,125,341	0.2
					8,606,873	0.6
南アフリカ						
Eskom Holdings SOC Ltd	7.13%	02/11/2025		345	365,484	0.0
トリニダードトバゴ						
Trinidad Generation UnLtd	5.25%	11/04/2027		260	266,468	0.0
ウクライナ						
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026		520	526,597	0.1
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025		183	196,883	0.0
					723,480	0.1
アラブ首長国連邦						
DP World Crescent Ltd	3.88%	07/18/2029		209	223,638	0.0
DP World PLC	5.63%	09/25/2048		249	303,904	0.0
DP World Salaam(a)	6.00%	10/01/2025		311	342,100	0.1
					869,642	0.1
ベネズエラ						
Petroleos de Venezuela SA(c)	5.38%	04/12/2027		110	4,950	0.0
					11,866,767	0.9
新興市場-国債						
ブラジル						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	BRL	4,364	875,458	0.1
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2025		5,785	1,177,556	0.1
					2,053,014	0.2
ドミニカ共和国						
Dominican Republic International Bond	15.95%	06/04/2021	DOP	6,500	114,859	0.0
南アフリカ						
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030	ZAR	34,207	2,345,098	0.2
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032		48,792	3,205,758	0.2
					5,550,856	0.4
					7,718,729	0.6
貸付債権担保証券						
CLO - FLOATING RATE						
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(e)	0.00%	04/15/2034	USD	250	247,500	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class D(e)	7.20%	01/20/2034		250	250,486	0.0

Invesco CLO 2021-1 Ltd., Series 2021-1A, Class E (e)	6.63%	04/15/2034		400	397,623	0.1
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D (e)	6.21%	07/14/2031		250	239,737	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(e)	6.09%	07/16/2035		250	250,000	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class E(e)	7.39%	01/20/2032		250	250,443	0.0
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(e)	6.13%	07/15/2031		250	237,539	0.0
					<u>1,873,328</u>	<u>0.1</u>
政府 - ソブリン債						
イスラエル						
Israel Government International Bond	2.75%	07/03/2030		494	522,371	0.0
メキシコ						
Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032		297	337,522	0.1
Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051		276	308,482	0.0
					<u>646,004</u>	<u>0.1</u>
フィリピン						
Philippine Government International Bond	9.50%	02/02/2030		20	31,591	0.0
					<u>1,199,966</u>	<u>0.1</u>
商業不動産担保証券						
ノン・エージェンシー固定金利商業不動産担保証券						
GS Mortgage Securities Trust, Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	USD	493	300,687	0.1
UBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(g)	1.52%	06/15/2050		1,978	137,078	0.0
					<u>437,765</u>	<u>0.1</u>
ノン・エージェンシー変動金利商業不動産担保証券						
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E (e)	3.12%	12/19/2030		100	99,377	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(e)	4.85%	05/15/2036		34	21,781	0.0
					<u>121,158</u>	<u>0.0</u>
					<u>558,923</u>	<u>0.1</u>
資産担保証券						
OTHER ABS - FIXED RATE						
Taco Bell Funding LLC, Series 2016-1A, Class A23	4.97%	05/25/2046		38	41,696	0.0
ワラント						
情報テクノロジー						
インターネットソフトウェア・サービス						
Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/2022				1,190	9,520	0.0

1,123,771,168	84.8
---------------	------

その他の取引可能な証券**不動産担当証券担保債券**

リスクシェア変動金利

Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020-

DNA2,

Class B2(e)	4.89%	02/25/2050	USD	4,000	3,799,750	0.3
-------------	-------	------------	-----	-------	-----------	-----

PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R,

Class A(e)	2.44%	02/27/2023		477	477,068	0.0
------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

4,276,818	0.3
-----------	-----

社債 - 投資適格**金融機関**

銀行

Lloyds Banking Group PLC(a)	6.00%	06/07/2032		33	44,260	0.0
-----------------------------	-------	------------	--	----	--------	-----

Natwest Group PLC(a)	8.63%	08/15/2021		1,908	1,934,490	0.1
----------------------	-------	------------	--	-------	-----------	-----

1,978,750	0.1
-----------	-----

資本財・サービス

ベーシック

Smurfit Kappa Treasury Funding DAC	7.50%	11/20/2025		30	37,180	0.0
------------------------------------	-------	------------	--	----	--------	-----

景気連動型消費財 - その他

Standard Industries, Inc./NJ	4.38%	07/15/2030		257	260,045	0.0
------------------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

運輸 - 航空

Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd	4.50%	10/20/2025		409	440,372	0.1
---------------------------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

737,597	0.1
---------	-----

2,716,347	0.2
-----------	-----

社債 - 非投資適格**資本財・サービス**

ベーシック

Kleopatra Finco SARL	4.25%	03/01/2026	EUR	567	691,780	0.1
----------------------	-------	------------	-----	-----	---------	-----

資本財

Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025		214	270,844	0.0
---------------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

通信 - メディア

Banjay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025		156	191,711	0.0
---------------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026		306	389,122	0.1
-------------------------	-------	------------	--	-----	---------	-----

580,833	0.1
---------	-----

エネルギー

Gulfport Energy Corp.(h)	6.00%	10/15/2024	USD	58	0	0.0
--------------------------	-------	------------	-----	----	---	-----

Gulfport Energy Corp.(h)	6.38%	05/15/2025		1,401	0	0.0
--------------------------	-------	------------	--	-------	---	-----

Gulfport Energy Corp.(h)	6.38%	01/15/2026		571	0	0.0
--------------------------	-------	------------	--	-----	---	-----

Gulfport Energy Corp.(h)	6.63%	05/01/2023		57	0	0.0
--------------------------	-------	------------	--	----	---	-----

Vantage Drilling International(h)	7.50%	11/01/2019		40	0	0.0
-----------------------------------	-------	------------	--	----	---	-----

					0	0.0
サービス						
Monitronics International, Inc.(h) (i)	9.13%	04/01/2020		40	0	0.0
テクノロジー						
Sensata Technologies, Inc	3.75%	02/15/2031		590	577,077	0.0
					2,120,534	0.2
新興市場 - 社債						
資本財・サービス						
通信 - 電気通信						
Digicel Group Holdings Ltd.(b)	10.00%	04/01/2024	USD	1,303	1,280,396	0.1
公益事業						
電力						
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026		117	120,546	0.0
					1,400,942	0.1
普通株						
一般消費財						
自動車部品						
ATD New Holdings, Inc.(h)				1,384	66,432	0.0
生活必需品						
食品・生活必需品小売						
Southeastern Grocers, Inc.(h)				4,735	66,290	0.0
エネルギー						
エネルギー 機器・サービス						
Diamond Offshore Drilling, Inc.(h)				12,711	65,568	0.0
オイル、ガス・消耗燃料						
Battalion Oil Corp				1	13	0.0
Keyera Corp				45,264	1,122,561	0.1
Paragon Offshore Ltd.- Class A (h)				152	15	0.0
Paragon Offshore Ltd.- Class B (h)				228	2,280	0.0
Vantage Drilling International				213	479	0.0
					1,125,348	0.1
					1,190,916	0.1
産業						
建設・土木						
Willscot Corp				556	16,124	0.0
情報テクノロジー						
ソフトウェア						
Monitronics International, Inc				1,489	12,731	0.0
素材						
金属・鉱業						
BIS Industries Holdings Ltd.(h)				8,912	0	0.0

1,352,493 0.1

優先株式**金融機関**

不動産投資信託

Cedar Realty Trust, Inc.Series B 7.25% 35,391 898,224 0.1

貸付債権担保証券

ローン担保証券 - 変動金利

Bardot CLO Ltd., Series 2019-2A, Class C(e) 2.93% 10/22/2032 USD 250 250,860 0.0

CIFC Funding Ltd., Series 2019-3A, Class B(e) 2.83% 07/16/2032 250 250,163 0.0

501,023 0.0

国債

国債

Russian Federal Bond - OFZ, Series 6217 7.50% 08/18/2021 RUB 11,226 154,000 0.0

商業不動産担保証券

ノン・エージェンシー固定金利商業不動産担保証券

JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,

Series 2012-LC9, Class G 4.42% 12/15/2047 USD 171 119,145 0.0

ワラント**建設・土木**

産業

Willscot Corp., expiring 11/29/2022 (h) 861 12,073 0.0

オイル、ガス・消耗燃料

エネルギー

Battalion Oil Corp., expiring 10/08/2022(h) 21 0 0.0

12,073 0.0

13,551,599 1.0

投資合計(簿価\$1,036,571,254)

\$ 1,137,322,767 85.8%

純資産に**占める割**

合

(%)

定期預金**利率****評価額**

(USD)

ANZ, London(j)	(0.13)%	\$	91,801	0.0 %
BNP Paribas Bank(j)	(0.53)%		27,323	0.0
BNP Paribas Bank(j)	0.01%		21,857	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	0.00%		35,660	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	2.99%		416,426	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(j)	(1.44)%		40,014	0.0

Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(j)	0.00%	707,589	0.1
Nordea Bank Abp, Oslo(j)	(0.78)%	4,432,507	0.3
Nordea Bank Abp, Oslo(j)	(0.13)%	31,697	0.0
Royal Bank of Canada, Toronto(j)	0.01%	51,671	0.0
SEB, Stockholm(j)	(0.28)%	337,575	0.0
Sumitomo, London(j)	(0.29)%	855,284	0.1
Sumitomo, London(j)	0.01%	23,604,407	1.8
Sumitomo, Tokyo(j)	0.01%	132,419,380	10.0
定期預金合計		<u>163,073,191</u>	<u>12.3</u>
負債控除後のその他の資産		<u>25,184,938</u>	<u>1.9</u>
純資産		<u>\$ 1,325,580,896</u>	<u>100.0 %</u>

先物取引

	投資資産の明細	満期日	枚数	簿価	市場価値	評価益/(損)	
買い	10 Yr Australian Bond Futures	06/15/2021	125	\$ 13,388,127	\$ 13,507,495	\$ 119,368	
	BIST 30 Futures	06/30/2021	2,129	3,812,654	3,800,920	(11,734)	
	Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2021	39	4,644,129	4,656,885	12,756	
	Euro STOXX 50 Index Futures	06/18/2021	92	4,486,637	4,561,621	74,984	
	FTSE 100 Index Futures	06/18/2021	4	399,696	398,696	(1,000)	
	FTSE KLCI Futures	06/30/2021	427	8,143,005	8,220,279	77,274	
	Hang Seng Index Futures	06/29/2021	29	5,369,017	5,415,570	46,553	
	MSCI Singapore IX ETS Futures	06/29/2021	75	2,028,960	2,050,095	21,135	
	SPI 200 Index Futures	06/17/2021	17	2,321,438	2,350,763	29,325	
	TOPIX Index Futures	06/10/2021	10	1,753,357	1,773,569	20,212	
	U.S Long Bond (CBT) Futures	09/21/2021	11	1,727,258	1,721,844	(5,414)	
	U.ST-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	57	7,047,492	7,059,539	12,047	
	U.S Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2021	41	7,618,219	7,595,250	(22,969)	
	WIG 20 Index Futures	06/18/2021	259	2,840,977	3,147,591	306,614	
	売り	Euro-Bund Futures	06/08/2021	102	21,171,749	21,137,800	33,949
		FTSE China A50 Futures	06/29/2021	36	653,545	656,424	(2,879)
FTSE/JSE Top 40 Futures		06/17/2021	11	491,021	491,076	(55)	
Japan 10 Yr Bond (OSE) Futures		06/14/2021	24	33,038,239	33,088,906	(50,667)	
Long Gilt Futures		09/28/2021	59	10,640,389	10,654,623	(14,234)	
Mexican Bolsa Index Futures		06/18/2021	85	2,082,704	2,142,923	(60,219)	

OMXS 30 Index Futures	06/18/2021	64	1,728,309	1,741,781	(13,472)
S&P 500 E-Mini Futures	06/18/2021	202	41,043,768	42,445,250	(1,401,482)
S&P/TSX 60 Index Futures	06/17/2021	7	1,348,408	1,376,532	(28,124)
SGX Nifty 50 Futures	06/24/2021	304	9,329,929	9,419,440	(89,511)
U.ST-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	586	77,325,641	77,315,375	10,266
				\$	(937,277)
				評価益合計	\$ 764,483
				評価損合計	\$ (1,701,760)

外国為替先渡取引

取引相手	買契約金額		売契約金額		決済日	評価益/(損)
	(000)		(000)			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd	AUD	977	USD	756	06/16/2021	\$ 2,931
Bank of America, NA	JPY	115,559	USD	1,094	06/16/2021	42,079
Bank of America, NA	USD	1,740	JPY	189,955	06/16/2021	(10,821)
Bank of America, NA	GBP	1,456	USD	2,022	06/17/2021	(44,206)
Bank of America, NA	USD	2,020	ZAR	28,671	06/17/2021	56,262
Bank of America, NA	ZAR	49,575	USD	3,381	06/17/2021	(209,541)
Bank of America, NA	DKK	10,786	USD	1,733	07/15/2021	(36,710)
Bank of America, NA	SEK	13,747	USD	1,634	07/15/2021	(21,687)
Bank of America, NA	RUB	494,094	USD	6,650	07/28/2021	(40,072)
Bank of America, NA	USD	15,711	RUB	1,167,289	07/28/2021	94,671
Barclays Bank PLC	GBP	4,669	USD	6,575	06/15/2021	(51,459)
Barclays Bank PLC	EUR	2,933	USD	3,586	06/16/2021	8,411
Barclays Bank PLC	NZD	6,227	USD	4,470	06/16/2021	(40,725)
Barclays Bank PLC	USD	5,360	MXN	108,267	06/18/2021	65,511
Barclays Bank PLC	KRW	3,998,869	USD	3,583	07/22/2021	(6,818)
Barclays Bank PLC	USD	6,794	PHP	333,817	07/22/2021	168,590
Barclays Bank PLC	MYR	29,314	USD	7,082	09/23/2021	10,221
Barclays Bank PLC	USD	3,739	MYR	15,555	09/23/2021	13,546
Barclays Bank PLC	USD	4,558	MYR	18,821	09/23/2021	(18,455)
BNP Paribas SA	AUD	546	USD	424	06/04/2021	3,162
BNP Paribas SA	CHF	6,339	USD	7,030	06/16/2021	(19,461)
BNP Paribas SA	USD	7,852	EUR	6,463	06/16/2021	31,114
BNP Paribas SA	USD	9,900	SEK	82,660	06/16/2021	55,530
BNP Paribas SA	USD	700	ZAR	9,776	06/17/2021	7,529
BNP Paribas SA	CZK	147,427	USD	6,863	06/24/2021	(197,755)

BNP Paribas SA	SEK	26,751	USD	3,139	07/15/2021	(83,683)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	5,207	USD	3,964	06/04/2021	(49,973)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	346	AUD	447	06/04/2021	(1,537)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	122	USD	96	06/15/2021	2,123
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	674	USD	558	06/15/2021	573
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	876	USD	724	06/15/2021	(1,194)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	97	USD	117	06/15/2021	(1,110)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	229	USD	322	06/15/2021	(2,362)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	2,497	USD	125	06/15/2021	183
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD	528	USD	396	06/15/2021	(3,166)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	60	EUR	49	06/15/2021	253
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	25	SGD	33	06/15/2021	254
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	1,702	USD	120	06/15/2021	(3,330)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	463	USD	359	06/16/2021	1,691
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	1,045	USD	822	06/16/2021	(42,618)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	530	USD	597	06/16/2021	8,009
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK	4,211	USD	688	06/16/2021	(2,244)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,316	USD	1,599	06/16/2021	(6,570)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	475	USD	651	06/16/2021	(22,682)
Brown Brothers Harriman & Co.	HKD	3,830	USD	494	06/16/2021	560
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	64,321	USD	614	06/16/2021	28,724
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	9,925	USD	1,184	06/16/2021	(11,679)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	682	DKK	4,211	06/16/2021	8,614
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	4	GBP	3	06/16/2021	70
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	247	HKD	1,914	06/16/2021	(68)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	281	SEK	2,343	06/16/2021	1,114
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	122	SEK	1,013	06/16/2021	(164)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	3,764	USD	5,187	06/17/2021	(155,124)
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	399	USD	27	06/17/2021	(1,615)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK	4,762	USD	573	07/15/2021	3,824
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	1,009	USD	120	07/15/2021	(1,603)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB	79,858	USD	2,543	07/15/2021	(12,243)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	738	DKK	4,551	07/15/2021	9,238
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	6,818	THB	212,491	07/15/2021	(19,091)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	5,335	USD	4,263	07/16/2021	(153,099)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	474	USD	529	08/05/2021	873
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,887	CNH	44,692	06/07/2021	128,852
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	31,405	GBP	22,494	06/07/2021	518,067
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	51,603	AUD	66,697	06/21/2021	(182,096)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14,020	EUR	11,475	06/21/2021	(21,814)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	31,404	GBP	22,184	06/21/2021	79,187

Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	685	SGD	913	06/21/2021	5,431
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,645	ZAR	150,019	06/21/2021	213,489
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	60,193	AUD	77,583	06/30/2021	(376,586)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	23,386	CAD	28,331	06/30/2021	65,091
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	36	CHF	32	06/30/2021	(109)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13,667	EUR	11,178	06/30/2021	(28,947)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	46,158	JPY	5,027,154	06/30/2021	(378,041)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	19,258	NZD	26,387	06/30/2021	(144,088)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	769	SGD	1,019	06/30/2021	1,250
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	12,158	ZAR	168,749	06/30/2021	41,390
Citibank, NA	AUD	12,257	USD	9,498	06/16/2021	48,149
Citibank, NA	EUR	427	USD	509	06/16/2021	(11,967)
Citibank, NA	GBP	3,189	USD	4,496	06/16/2021	(30,694)
Citibank, NA	JPY	54,820	USD	522	06/16/2021	23,326
Citibank, NA	NZD	1,314	USD	946	06/16/2021	(5,960)
Citibank, NA	COP	61,749,436	USD	16,437	07/15/2021	(173,223)
Citibank, NA	PEN	29,030	USD	7,942	07/15/2021	307,222
Citibank, NA	USD	5,856	COP	21,893,500	07/15/2021	33,045
Citibank, NA	NZD	1,031	USD	746	07/29/2021	(511)
Credit Suisse International	HUF	167,868	USD	541	06/24/2021	(46,886)
Credit Suisse International	USD	7,315	CNH	47,830	06/24/2021	194,884
Credit Suisse International	USD	2,536	PLN	10,070	06/24/2021	203,465
Deutsche Bank AG	NOK	14,588	USD	1,760	06/15/2021	15,819
Deutsche Bank AG	SEK	12,687	USD	1,517	06/15/2021	(10,518)
Deutsche Bank AG	AUD	2,906	USD	2,251	06/16/2021	10,178
Deutsche Bank AG	CAD	4,078	USD	3,372	06/16/2021	(3,312)
Deutsche Bank AG	GBP	3,595	USD	5,041	06/16/2021	(61,250)
Deutsche Bank AG	USD	8,587	CAD	10,400	06/16/2021	21,516
Deutsche Bank AG	USD	549	SEK	4,585	06/16/2021	2,882
Deutsche Bank AG	HUF	2,177,706	USD	7,075	06/24/2021	(548,906)
Deutsche Bank AG	USD	8,572	INR	637,953	07/15/2021	172,348
Deutsche Bank AG	USD	3,348	PEN	12,231	07/15/2021	(131,273)
Deutsche Bank AG	USD	1,136	RUB	84,206	07/28/2021	4,138
Goldman Sachs International	BRL	38,570	USD	7,261	06/02/2021	(139,738)
Goldman Sachs International	USD	4,046	BRL	21,740	06/02/2021	125,453
Goldman Sachs International	SGD	2,246	USD	1,684	06/15/2021	(14,322)
Goldman Sachs International	CHF	3,703	USD	4,059	06/16/2021	(59,635)
Goldman Sachs International	GBP	1,524	USD	2,156	06/16/2021	(7,032)
Goldman Sachs International	JPY	59,384	USD	547	06/16/2021	5,838
Goldman Sachs International	USD	3,221	EUR	2,663	06/16/2021	27,742
Goldman Sachs International	USD	1,392	JPY	151,099	06/16/2021	(15,836)

Goldman Sachs International	USD	4,447	NOK	36,770	06/16/2021	(50,418)
Goldman Sachs International	USD	1,223	SEK	10,198	06/16/2021	4,827
Goldman Sachs International	GBP	410	USD	572	06/17/2021	(9,587)
Goldman Sachs International	HUF	555,676	USD	1,856	06/24/2021	(89,692)
Goldman Sachs International	USD	2,291	CNH	14,891	06/24/2021	46,656
Goldman Sachs International	USD	7,241	BRL	38,570	07/02/2021	138,395
Goldman Sachs International	USD	1,261	IDR	18,483,142	07/15/2021	25,574
Goldman Sachs International	TWD	38,402	USD	1,369	07/22/2021	(26,607)
HSBC Bank USA	CAD	4,753	USD	3,931	06/15/2021	(3,280)
HSBC Bank USA	DKK	7,551	USD	1,231	06/15/2021	(7,023)
HSBC Bank USA	ILS	2,866	USD	875	06/15/2021	(7,233)
HSBC Bank USA	SEK	10,913	USD	1,314	06/16/2021	(72)
HSBC Bank USA	ZAR	104,721	USD	7,134	06/17/2021	(449,334)
HSBC Bank USA	USD	2,528	IDR	37,378,910	07/15/2021	74,314
HSBC Bank USA	EUR	10,467	USD	12,840	08/03/2021	60,457
JPMorgan Chase Bank, NA	CHF	5,826	USD	6,454	06/15/2021	(24,762)
JPMorgan Chase Bank, NA	AUD	782	USD	605	06/16/2021	2,482
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	377	USD	524	06/16/2021	(11,570)
JPMorgan Chase Bank, NA	JPY	158,029	USD	1,512	06/16/2021	73,281
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR	9,542,233	USD	646	07/15/2021	(18,578)
JPMorgan Chase Bank, NA	TWD	396,611	USD	14,328	07/22/2021	(87,238)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	92,035	USD	843	06/15/2021	4,792
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	482	USD	581	06/16/2021	(6,575)
Morgan Stanley Capital Services LLC	MXN	191,653	USD	9,481	06/18/2021	(122,866)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CLP	5,260,129	USD	7,402	07/15/2021	144,234
Morgan Stanley Capital Services LLC	SEK	5,936	USD	712	07/15/2021	(2,939)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF	2,920	USD	3,208	08/05/2021	(43,749)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	1,136,788	USD	10,446	08/19/2021	89,725
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR	15,908	USD	3,873	09/23/2021	35,016
Royal Bank of Scotland PLC	CAD	642	USD	505	06/16/2021	(26,810)
Royal Bank of Scotland PLC	CHF	9,012	USD	9,997	06/16/2021	(25,305)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR	1,615	USD	1,964	06/16/2021	(5,515)
Royal Bank of Scotland PLC	JPY	332,213	USD	3,176	06/16/2021	151,291
Royal Bank of Scotland PLC	USD	735	GBP	527	06/16/2021	13,389
Royal Bank of Scotland PLC	PLN	23,654	USD	6,241	06/24/2021	(193,460)
Standard Chartered Bank	CLP	1,317,923	USD	1,872	07/15/2021	53,682
Standard Chartered Bank	IDR	28,297,128	USD	1,966	07/15/2021	(3,737)
Standard Chartered Bank	USD	1,986	COP	7,336,800	07/15/2021	(12,567)
Standard Chartered Bank	USD	11,337	INR	853,391	07/15/2021	361,147
Standard Chartered Bank	KRW	2,930,529	USD	2,600	07/22/2021	(30,691)
Standard Chartered Bank	TWD	138,592	USD	4,937	07/22/2021	(99,808)

Standard Chartered Bank	USD	3,062	PHP	149,544	07/22/2021	57,579
UBS AG	USD	3,183	BRL	16,830	06/02/2021	45,905
UBS AG	AUD	3,325	USD	2,581	06/15/2021	18,008
UBS AG	EUR	11,902	USD	14,426	06/15/2021	(91,248)
UBS AG	JPY	781,249	USD	7,149	06/15/2021	34,881
UBS AG	NZD	2,412	USD	1,733	06/16/2021	(13,973)
UBS AG	USD	4,283	SEK	35,969	06/16/2021	48,509
UBS AG	HUF	434,074	USD	1,481	06/24/2021	(38,744)
UBS AG	USD	2,798	PLN	10,445	06/24/2021	43,289
UBS AG	CAD	657	USD	535	07/16/2021	(8,974)
UBS AG	USD	191	TWD	5,306	07/22/2021	1,463
UBS AG	EUR	9,106	USD	11,166	08/03/2021	47,708
						\$ (726,938)
						評価益合計 \$ 4,451,026
						評価損合計 \$ (5,177,964)

コール・オプション買建玉

取引明細	行使価格	満期日	想定元本	受取プレミアム	評価額
FTSE 100 Index (k)	GBP 7,200	06/18/2021	500	\$ 28,239	\$ (8,363)
Nikkei 225 Index (k)	JPY 29,750	06/11/2021	31,000	32,027	(37,898)
S&P 500 Index (k)	EUR 4,150	06/18/2021	2,280	41,536	(38,925)
S&P 500 Index (k)	USD 4,295	06/18/2021	17,500	315,000	(175,984)
				\$ 416,802	\$ (261,170)

プット・オプション売建玉

取引明細	行使価格	満期日	想定元本	受取プレミアム	評価額
FTSE 100 Index (k)	GBP 6,800	06/18/2021	500	\$ 49,418	\$ (19,868)
Nikkei 225 Index (k)	JPY 27,125	06/11/2021	31,000	103,451	(10,675)
S&P 500 Index (k)	EUR 3,750	06/18/2021	2,280	74,765	(19,462)
S&P 500 Index (k)	USD 4,000	06/18/2021	17,500	687,750	(212,146)
				\$ 915,384	\$ (262,151)

中央清算クレジット・デフォルト・スワップ

取引相手(取引所)	参照債権	満期日	想定元本 (000)	評価額	評価益 /(損)
-----------	------	-----	---------------	-----	-------------

Buy Contracts

Morgan Stanley & CoLLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026	USD	47,550	\$	(4,598,243)	\$	(46,000)
-----------------------------------	----------------------------------	------------	-----	--------	----	-------------	----	----------

Sale Contracts

Morgan Stanley & CoLLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025		6,993		669,041		572,580
-----------------------------------	----------------------------------	------------	--	-------	--	---------	--	---------

Morgan Stanley & CoLLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025		6,479		629,587		299,621
-----------------------------------	----------------------------------	------------	--	-------	--	---------	--	---------

Morgan Stanley & CoLLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026		50,973		4,929,258		219,102
-----------------------------------	----------------------------------	------------	--	--------	--	-----------	--	---------

Morgan Stanley & CoLLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 33, 5 Year Index	06/20/2026	EUR	14,720		2,121,981		202,132
-----------------------------------	--------------------------------------	------------	-----	--------	--	-----------	--	---------

Total						\$	3,751,624	\$	1,247,435
-------	--	--	--	--	--	----	-----------	----	-----------

評価益合						\$	1,293,435
計							

評価損合						\$	(46,000)
計							

中央清算金利スワップ

取引相手(取引所)	想定元		満期日	支払対象	支払受取利率	評価益 /(損)
	本	(000)				
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CNY	10,900	02/17/2025	China 7-Day	2.547%	\$ (8,009)
				Reverse Repo Rate		
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		32,439	02/20/2025	China 7-Day	2.598%	(14,799)
				Reverse Repo Rate		
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		32,921	02/21/2025	China 7-Day	2.620%	(10,907)
				Reverse Repo Rate		
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		65,190	02/26/2025	China 7-Day	2.496%	(67,615)
				Reverse Repo Rate		
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	97,690	01/07/2030	6 Month LIBOR	0.132%	3,336
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	AUD	750	02/19/2030	6 Month BBSW	1.169%	(18,313)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		2,070	06/09/2030	6 Month BBSW	1.116%	(64,902)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	GBP	2,930	06/10/2030	6 Month LIBOR	0.487%	(179,727)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	AUD	2,860	06/11/2030	6 Month BBSW	0.992%	(113,329)

Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	603,380	06/12/2030	6 Month LIBOR	0.038%	(30,877)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	GBP	860	08/03/2030	6 Month LIBOR	0.294%	(75,584)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	342,850	08/05/2030	6 Month LIBOR	0.010%	(26,881)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	GBP	1,780	10/20/2030	6 Month LIBOR	0.363%	(146,805)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	AUD	8,730	10/21/2030	6 Month BBSW	0.718%	(549,844)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	857,330	10/22/2030	6 Month LIBOR	0.031%	(57,754)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CAD	50	11/09/2030	3 Month CDOR	1.230%	(2,405)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	GBP	1,680	11/10/2030	6 Month LIBOR	0.567%	(95,111)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	NOK	28,920	11/11/2030	6 Month NIBOR	1.031%	(217,296)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	AUD	8,120	11/11/2030	6 Month BBSW	0.900%	(415,284)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	869,960	11/12/2030	6 Month LIBOR	0.058%	(40,516)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	EUR	2,430	11/12/2030	6 Month EURIBOR	(0.169)%	(71,960)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	NZD	2,150	11/23/2030	3 Month BKBM	0.841%	(154,359)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		2,410	01/05/2031	3 Month BKBM	0.978%	(155,570)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		1,690	01/11/2031	3 Month BKBM	1.058%	(100,662)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	USD	24,720	01/13/2031	3 Month LIBOR	1.150%	(867,034)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	NOK	15,510	01/21/2031	6 Month NIBOR	1.348%	(68,512)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		20,280	02/19/2031	6 Month NIBOR	1.634%	(28,866)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	NZD	4,320	02/19/2031	3 Month BKBM	1.616%	(105,505)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CHF	1,720	02/19/2031	(0.054)%	6 Month LIBOR	14,256
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CAD	5,240	02/26/2031	3 Month CDOR	1.908%	431

Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	AUD	6,020	03/01/2031	6 Month BBSW	1.831%	70,863
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CHF	2,620	03/01/2031	0.068%	6 Month LIBOR	(12,706)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		1,550	04/06/2031	0.026%	6 Month LIBOR	696
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	2,306,840	04/16/2031	6 Month LIBOR	0.130%	13,027
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	EUR	10,240	04/16/2031	6 Month EURIBOR	0.058%	(70,533)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	SEK	150	04/21/2031	3 Month STIBOR	0.786%	(47)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	NOK	68,210	05/03/2031	6 Month NIBOR	1.786%	11,224
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	NZD	4,740	05/03/2031	3 Month BKBM	1.843%	(52,795)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CHF	4,480	05/03/2031	0.084%	6 Month LIBOR	(24,243)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	NZD	9,660	05/18/2031	3 Month BKBM	1.985%	(18,292)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CHF	3,520	05/18/2031	0.079%	6 Month LIBOR	(16,339)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	AUD	2,340	05/26/2031	6 Month BBSW	1.685%	(812)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	USD	1,270	05/26/2031	3 Month LIBOR	1.576%	1,420
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	302,090	05/27/2031	6 Month LIBOR	0.119%	(2,151)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	EUR	1,420	05/27/2031	6 Month EURIBOR	0.144%	3,932
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	JPY	397,010	03/10/2040	6 Month LIBOR	0.015%	(234,571)
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	CAD	20	11/14/2048	3 Month CDOR	2.971%	1,938
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		360	02/04/2049	3 Month CDOR	2.696%	17,625
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)		270	03/15/2049	3 Month CDOR	2.482%	3,051
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	AUD	240	03/19/2049	6 Month BBSW	2.535%	12,822
Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	EUR	180	03/10/2050	6 Month EURIBOR	0.012%	(31,037)

Morgan Stanley & CoLLC/(LCH Group)	10,640	07/16/2050	6 Month EURIBOR	(0.001)%	(1,895,645)
					\$ (5,892,976)
				評価益合計	\$ 154,621
				評価損合計	\$ (6,047,597)

クレジット・デフォルト・スワップ

取引相手	参照債権	満期日	想定元本	評価額	前払プレミアム 支払/(受取)	評価益 /(損)
Buy Contracts						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 17,090	\$ 4,807,417	\$ 4,176,597	\$ 630,820
Markets, Inc.						
Sale Contracts						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	158	(75,326)	(77,373)	2,047
Markets, Inc						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	43	(20,333)	(7,990)	(12,343)
Markets, Inc.						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(16,106)	(24,561)
Markets, Inc.						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(16,030)	(24,637)
Markets, Inc.						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(15,702)	(24,965)
Markets, Inc.						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	128	(61,000)	(24,803)	(36,197)
Markets, Inc.						
Citigroup						
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	292	(138,637)	(66,612)	(72,025)
Markets, Inc.						

Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	257	(122,000)	(49,446)	(72,554)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	321	(152,500)	(62,736)	(89,764)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	749	(355,834)	(105,116)	(250,718)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	972	(462,123)	(134,981)	(327,142)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,167	(554,547)	(163,381)	(391,166)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,945	(924,245)	(292,822)	(631,423)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,383	(1,132,662)	(330,011)	(802,651)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,780	(2,271,794)	(657,520)	(1,614,274)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	250	(70,325)	(30,456)	(39,869)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	400	(112,520)	(52,996)	(59,524)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	900	(253,170)	(139,259)	(113,911)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,800	(506,340)	(112,231)	(394,109)	
Markets, Inc.							
Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,300	(646,990)	(141,116)	(505,874)	
Markets, Inc.							

Citigroup							
Global	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,000	(1,969,100)	(350,194)	(1,618,906)	
Markets, Inc.							
Credit Suisse							
International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	850	(239,105)	(100,961)	(138,144)	
Credit Suisse							
International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,200	(337,560)	(165,337)	(172,223)	
Goldman							
Sachs	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	30	2,826	987	1,839	
International							
Goldman							
Sachs	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	20	1,884	1,030	854	
International							
Goldman							
Sachs	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	32	(15,250)	(15,644)	394	
International							
Goldman							
Sachs	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	32	(15,250)	(15,644)	394	
International							
Goldman							
Sachs	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(16,285)	(24,382)	
International							
Goldman							
Sachs	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	486	(231,061)	(129,020)	(102,041)	
International							
Goldman							
Sachs	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	200	(56,260)	(23,455)	(32,805)	
International							
Goldman							
Sachs	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	450	(126,585)	(42,731)	(83,854)	
International							
Goldman							
Sachs	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	830	(233,479)	(112,038)	(121,441)	
International							
JPMorgan							
Securities,	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	35	(16,636)	(6,657)	(9,979)	
LLC							
JPMorgan							
Securities,	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	53	(24,955)	(9,922)	(15,033)	
LLC							

JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	85	(40,205)	(15,848)	(24,357)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	85	(40,205)	(15,785)	(24,420)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	250	(118,766)	(47,785)	(70,981)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	328	(155,735)	(60,635)	(95,100)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	338	(160,819)	(62,201)	(98,618)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	486	(231,061)	(114,842)	(116,219)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,328	(1,106,321)	(323,394)	(782,927)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	150	(42,195)	(12,330)	(29,865)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	300	(84,390)	(33,318)	(51,072)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	460	(129,398)	(53,541)	(75,857)
Morgan Stanley & Co.International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	64	(30,500)	(30,622)	122
Morgan Stanley & Co.International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(89,326)	(4,947)
Morgan Stanley & Co.International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(82,546)	(11,727)

Morgan Stanley & Co.International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(82,063)	(12,210)
Morgan Stanley & Co.International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(81,580)	(12,693)
Morgan Stanley & Co.International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	197	(93,811)	(80,700)	(13,111)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	972	(462,123)	(198,556)	(263,567)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,945	(924,245)	(318,084)	(606,161)
Total				<u>\$ (10,472,994)</u>	<u>\$ (1,009,117)</u>	<u>\$ (9,463,877)</u>
					評価益合計	\$ 636,470
					評価損合計	\$ (10,100,347)

インフレーションスワップ

取引相手	0	想定元本 (000)	満期日	受取利率	支払対象	評価益 /(損)
Bank of America, NA	USD	6,510	01/05/2023	2.163%	CPI#	\$ 102,329

#消費者物価指数(CPI)によって決められたインフレーション率に基づいた変動金利

トータル・リターン・スワップ

取引相手 & 参照債務	株数/ 受益証券数	支払/受取利率	想定元本 (000)	満期日	評価益 /(損)
-------------	--------------	---------	---------------	-----	-------------

トータル・リターンの支払契約

Morgan Stanley Capital Services

LLC

IBOVESPA Futures	51	0.00%	BRL	6,134	06/16/2021	\$	(52,765)
KOSPI 200 Futures	4,250,000	0.00%	KRW	1,822,922	06/10/2021		9,804
KOSPI 200 Futures	8,500,000	0.00%		3,544,615	06/10/2021		(71,156)

トータル・リターンの受取契約

Goldman Sachs International

IBXXC1D1	1,000,000	3 Month LIBOR	USD	1,000	06/20/2021		24,798
IBXXC2D1	1,510,000	3 Month EURIBOR	EUR	1,510	06/20/2021		47,467

Morgan Stanley Capital Services

LLC

RTS Futures	24	0.00%	USD	3,535	06/17/2021		292,610
RTS Futures	8	0.00%		1,269	06/17/2021		75,918

合計	\$	326,676
----	----	---------

評価益合計	\$	450,597
-------	----	---------

評価損合計	\$	(123,921)
-------	----	-----------

スワップ合計	\$	(13,680,413)
--------	----	--------------

(a) 永久債であり、既定の満期日がありません。表示されている期日は、該当する場合は、次回の契約上の償還日を反映しております。

(b) Pay-In-Kind Payments (PIK)-利息相当を期限まで繰り延べて、現物払いする負債

(c) 債務不履行

(d) 債務担保証券とは分けてポジション管理されています。

(e) 変動利付債。利率は2021年5月31日時点に記載しております。

(f) インバース利息証券

(g) IO - 利息のみ

(h) 公正な市場価格は運用会社の評議委員会の監督のもと決められております。

(i) 債務不履行の満期保有目的有価証券

(j) 翌日物預金

(k) 1契約につき1口

通貨の略称

AUD	豪ドル	ILS	イスラエル・シケル
BRL	ブラジル・レアル	INR	インド・ルピー
CAD	カナダ・ドル	JPY	日本・円
CHF	スイス・フラン	MXN	メキシコ・ペソ

CLP	チリ・ペソ	MYR	マレーシア・リンギット
CNH	中国・人民元(オフショア)	NOK	ノルウェー・クローネ
CNY	中国・人民元	NZD	ニュージーランド・ドル
COP	コロンビア・ペソ	PEN	ペルー・ソル
CZK	チェコ・クローネ	PHP	フィリピン・ペソ
DKK	デンマーク・クローネ	PLN	ポーランド・ズロチ
DOP	ドミニカ・ペソ	RUB	ロシア・ルーブル
EGP	エジプト・ポンド	SEK	スウェーデン・クローネ
EUR	ユーロ	SGD	シンガポール・ドル
GBP	英ポンド	THB	タイ・バーツ
HKD	香港ドル	TWD	台湾ドル
HUF	ハンガリー・フォリント	USD	米ドル
IDR	インドネシア・ルピア	ZAR	南アフリカ・ランド

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	48,051,076,946	43,880,774,430
流動資産合計	48,051,076,946	43,880,774,430
資産合計	48,051,076,946	43,880,774,430
負債の部		
流動負債		
未払解約金	349,342,000	-
流動負債合計	349,342,000	-
負債合計	349,342,000	-
純資産の部		
元本等		
元本	1 47,605,306,164	43,802,085,529
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	96,428,782	78,688,901
元本等合計	47,701,734,946	43,880,774,430
純資産合計	47,701,734,946	43,880,774,430

負債純資産合計	48,051,076,946	43,880,774,430
---------	----------------	----------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

自 2022年5月13日
至 2022年11月14日
該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
1. 1 期首	2021年11月13日	2022年5月13日
期首元本額	92,110,973,294円	47,605,306,164円
期中追加設定元本額	43,333,674,149円	55,506,109,137円
期中一部解約元本額	87,839,341,279円	59,309,329,772円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ米ドル・ブルファンド (適格機関投資家専用)	40,361,764円	4,710,519,494円
ダイワ米ドル・ベアファンド (適格機関投資家専用)	8,138,963,217円	8,194,604,018円
ダイワ・マネーポートフォリオ (FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,089,639円	1,089,639円
ダイワJリートベア・ファン ド(適格機関投資家専用)	1,065,586,281円	2,083,616,103円
米国国債プラス日本株式ファ ンド2021-01(部分為替ヘッ ジあり/適格機関投資家専 用)	21,505円	1,518,511円
米国国債プラス日本株式ファ ンド2021-07(部分為替ヘッ ジあり/適格機関投資家専 用)	290円	9,980,330円
米国国債プラス日本株式ファ ンド2022-01(部分為替ヘッ ジあり/適格機関投資家専 用)	720,959,502円	1,203,013円

ダイワ/バリュー・パート ナース チャイナ・ヘルスケア・フォーカス	9,976円	9,976円
通貨選択型 米国リート・ クワトロ(毎月分配型)	159,141円	159,141円
通貨選択型アメリカン・エク イティ・クワトロ(毎月分 配型)	159,141円	159,141円
オール・マーケット・インカ ム戦略(資産成長重視コー ス)	9,963円	9,963円
オール・マーケット・インカ ム戦略(奇数月定額分配コー ス)	9,963円	9,963円
オール・マーケット・インカ ム戦略(奇数月定率分配コー ス)	9,963円	9,963円
オール・マーケット・インカ ム戦略(予想分配金提示型 コース)	9,963円	9,963円
NYダウ・トリプル・レバレッ ジ	1,506,712,234円	1,486,750,161円
世界セレクトティブ株式オーブ ン(為替ヘッジあり/年1回 決算型)	998円	998円
世界セレクトティブ株式オーブ ン(為替ヘッジあり/年2回 決算型)	998円	998円
FANG+ブルベア・マネーポー トフォリオ	992,420円	992,420円
ポーレン米国グロース株式 ファンド(資産成長型)	998円	998円
ポーレン米国グロース株式 ファンド(予想分配金提示 型)	998円	998円
トレンド・キャッチ戦略ファ ンド	9,977円	9,977円
AHLターゲットリスク・ライ ト戦略ファンド(適格機関投 資家専用)	8,853,908,475円	8,364,886,518円

ダイワユーロペア・ファンド 2(2倍、非リバランス型) (適格機関投資家専用)	4,711,692,994円	-円
ダイワユーロペア・ファンド (2倍、非リバランス型) (適格機関投資家専用)	17,331,987,251円	-円
ダイワJGBペア・ファンド (適格機関投資家専用)	5,229,047,377円	18,942,942,107円
ダイワ/ロジャーズ国際コモ ディティ™・ファンド	2,417,017円	2,417,017円
ダイワ/フィデリティ・アジ ア・ハイ・イールド債券ファ ンド(通貨選択型)日本円・ コース(毎月分配型)	998円	998円
ダイワ/フィデリティ・アジ ア・ハイ・イールド債券ファ ンド(通貨選択型)ブラジ ル・リアル・コース(毎月分 配型)	998円	998円
ダイワ/フィデリティ・アジ ア・ハイ・イールド債券ファ ンド(通貨選択型)アジア通 貨・コース(毎月分配型)	998円	998円
ダイワ豪ドル建て高利回り証 券(毎月分配型)	9,949円	9,949円
ダイワ米国国債7-10年ラ ダー型ファンド・マネーポー トフォリオ - USトリア ングル -	997,374円	997,374円
ダイワ豪ドル建て高利回り証 券ファンド - 予想分配金提 示型 -	173,802円	173,802円
計	47,605,306,164円	43,802,085,529円
2. 期末日における受益権の総数	47,605,306,164口	43,802,085,529口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
----	-------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月14日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
1口当たり純資産額	1.0020円	1.0018円
(1万口当たり純資産額)	(10,020円)	(10,018円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定額分配コース)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2022年5月13日から2022年11月14日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定額分配コース)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,325,659	3,748,756
投資証券	483,838,552	415,616,469
親投資信託受益証券	9,982	9,980
未収入金	-	4,999,999
流動資産合計	493,174,193	424,375,204
資産合計	493,174,193	424,375,204
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,429,497	3,203,880
未払解約金	910,647	-
未払受託者報酬	23,119	19,926
未払委託者報酬	740,249	638,107
その他未払費用	22,731	18,899
流動負債合計	5,126,243	3,880,812
負債合計	5,126,243	3,880,812
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 571,582,834	¹ 533,980,120
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	² 83,534,884	² 113,485,728
(分配準備積立金)	52,703,211	55,310,167
元本等合計	488,047,950	420,494,392
純資産合計	488,047,950	420,494,392
負債純資産合計	493,174,193	424,375,204

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 2021年11月13日 至 2022年5月12日		自 2022年5月13日 至 2022年11月14日	
営業収益				
受取配当金		26,616,509		19,128,292
有価証券売買等損益		97,615,882		43,350,378
営業収益合計		70,999,373		24,222,086
営業費用				
支払利息		891		832
受託者報酬		76,045		63,271
委託者報酬		2,434,839		2,026,230
その他費用		22,731		18,899
営業費用合計		2,534,506		2,109,232
営業損失（ ）		73,533,879		26,331,318
経常損失（ ）		73,533,879		26,331,318
当期純損失（ ）		73,533,879		26,331,318
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（ ）		720,048		6,593
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,007,867		83,534,884
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,911,822		7,766,372
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,911,822		7,766,372
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,169,654		1,609,543
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,169,654		1,609,543
分配金		1 10,455,354		1 9,769,762
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		83,534,884		113,485,728

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2022年5月13日	至 2022年11月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>2022年11月12日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を2022年11月14日としております。このため、当特定期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
1. 1 期首元本額	617,627,057円	571,582,834円
期中追加設定元本額	37,352,376円	8,754,320円
期中一部解約元本額	83,396,599円	46,357,034円

2.	特定期間末日における受益権の総数	571,582,834口	533,980,120口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は83,534,884円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は113,485,728円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 2021年11月13日 至 2022年5月12日	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1 分配金の計算過程	<p>(自2021年11月13日 至2022年1月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,990,139円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(32,112,726円)及び分配準備積立金(42,419,211円)より分配対象額は82,522,076円(1万口当たり1,403.54円)であり、うち3,527,748円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年5月13日 至2022年7月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(6,636,834円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(32,311,583円)及び分配準備積立金(51,201,936円)より分配対象額は90,150,353円(1万口当たり1,616.98円)であり、うち3,345,142円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>

<p>(自2022年1月13日 至2022年3月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,981,350円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(33,299,861円)及び分配準備積立金(45,112,411円)より分配対象額は86,393,622円(1万口当たり1,481.83円)であり、うち3,498,109円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年7月13日 至2022年9月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(5,684,571円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(31,332,975円)及び分配準備積立金(52,248,702円)より分配対象額は89,266,248円(1万口当たり1,662.96円)であり、うち3,220,740円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2022年3月15日 至2022年5月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,758,079円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(32,913,253円)及び分配準備積立金(48,374,629円)より分配対象額は89,045,961円(1万口当たり1,557.88円)であり、うち3,429,497円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年9月13日 至2022年11月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,511,448円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(31,606,789円)及び分配準備積立金(54,002,599円)より分配対象額は90,120,836円(1万口当たり1,687.72円)であり、うち3,203,880円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期
	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	2022年11月14日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	前 期	当 期
	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在

種 類	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	31,523,511	20,849,416
親投資信託受益証券	0	1
合計	31,523,511	20,849,417

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
該当事項はありません。	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）

当 期 自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8539円 (8,539円)	0.7875円 (7,875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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	60,815.989	415,616,469	
投資証券 合計			415,616,469	
親投資信託受益 証券	ダイワ・マネーポートフォリオ・マ ザーファンド	9,963	9,980	
親投資信託受益証券 合計			9,980	
合計			415,626,449	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、ルクセンブルク籍の外国投資法人「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ(クラスS1D)」の投資証券(円建)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、すべて同ファンドの投資証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーポートフォリオ・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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ(クラスS1D)」の状況

前記「オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の状況

前記「オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)」に記載のとおりであります。

【オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定率分配コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2022年5月13日から2022年11月14日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定率分配コース）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,068,233	10,282,400
投資証券	1,787,259,783	1,594,507,711
親投資信託受益証券	9,982	9,980
未収入金	-	13,000,000
流動資産合計	1,823,337,998	1,617,800,091
資産合計	1,823,337,998	1,617,800,091
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,321,954	7,906,980
未払解約金	98,793	-
未払受託者報酬	84,938	77,550
未払委託者報酬	2,718,323	2,482,090
その他未払費用	81,851	72,450
流動負債合計	12,305,859	10,539,070
負債合計	12,305,859	10,539,070
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 2,071,545,549	¹ 1,976,745,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 260,513,410	² 369,484,109
（分配準備積立金）	233,136,305	259,004,644
元本等合計	1,811,032,139	1,607,261,021
純資産合計	1,811,032,139	1,607,261,021
負債純資産合計	1,823,337,998	1,617,800,091

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 2021年11月13日 至 2022年5月12日		自 2022年5月13日 至 2022年11月14日	
営業収益				
受取配当金		95,345,413		73,120,685
有価証券売買等損益		352,166,426		166,872,759
営業収益合計		256,821,013		93,752,074
営業費用				
支払利息		3,550		3,768
受託者報酬		273,107		241,738
委託者報酬		8,740,557		7,737,158
その他費用		81,851		72,450
営業費用合計		9,099,065		8,055,114
営業損失()		265,920,078		101,807,188
経常損失()		265,920,078		101,807,188
当期純損失()		265,920,078		101,807,188
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		1,962,064		3,269,007
期首剰余金又は期首欠損金()		37,065,617		260,513,410
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		17,168,797
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		17,168,797
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,747,080		3,366,960
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,804,654		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,942,426		3,366,960
分配金		1 28,873,933		1 24,234,355
期末剰余金又は期末欠損金()		260,513,410		369,484,109

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2022年5月13日	至 2022年11月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>2022年11月12日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を2022年11月14日としております。このため、当特定期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
1. 1 期首元本額	2,159,840,143円	2,071,545,549円
期中追加設定元本額	102,939,865円	23,348,116円
期中一部解約元本額	191,234,459円	118,148,535円

2.	特定期間末日における受益権の総数	2,071,545,549口	1,976,745,130口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は260,513,410円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は369,484,109円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 2021年11月13日 至 2022年5月12日	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1 分配金の計算過程	<p>(自2021年11月13日 至2022年1月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(28,442,483円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(142,529,625円)及び分配準備積立金(181,544,133円)より分配対象額は352,516,241円(1万口当たり1,714.51円)であり、うち10,280,386円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年5月13日 至2022年7月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(25,002,599円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(149,973,389円)及び分配準備積立金(229,379,896円)より分配対象額は404,355,884円(1万口当たり1,975.01円)であり、うち8,189,430円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

<p>(自2022年1月13日 至2022年3月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(28,725,724円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(147,846,947円)及び分配準備積立金(195,278,917円)より分配対象額は371,851,588円(1万口当たり1,804.79円)であり、うち9,271,593円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年7月13日 至2022年9月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(22,159,297円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(149,829,607円)及び分配準備積立金(243,866,579円)より分配対象額は415,855,483円(1万口当たり2,044.03円)であり、うち8,137,945円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2022年3月15日 至2022年5月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(28,511,922円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(150,688,147円)及び分配準備積立金(213,946,337円)より分配対象額は393,146,406円(1万口当たり1,897.84円)であり、うち9,321,954円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年9月13日 至2022年11月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(17,269,045円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(146,514,161円)及び分配準備積立金(249,642,579円)より分配対象額は413,425,785円(1万口当たり2,091.45円)であり、うち7,906,980円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期
	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	2022年11月14日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	116,445,251	79,988,543
親投資信託受益証券	0	1
合計	116,445,251	79,988,544

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
該当事項はありません。	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）

当 期 自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
1口当たり純資産額	0.8742円	0.8131円
（1万口当たり純資産額）	(8,742円)	(8,131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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 （円）	備考
投資証券	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	233,319.829	1,594,507,711	
投資証券 合計			1,594,507,711	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーポートフォリオ・マ ザーファンド	9,963	9,980	
親投資信託受益証券 合計			9,980	
合計			1,594,517,691	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、ルクセンブルク籍の外国投資法人「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」の投資証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、すべて同ファンドの投資証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーポートフォリオ・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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ（クラスS1D）」の状況

前記「オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の状況

前記「オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）」に記載のとおりであります。

【オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2022年5月13日から2022年11月14日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	844,752	503,216
投資証券	68,505,407	49,857,091
親投資信託受益証券	9,982	9,980
流動資産合計	69,360,141	50,370,287
資産合計	69,360,141	50,370,287
負債の部		
流動負債		
未払解約金	89,363	-
未払受託者報酬	1,616	1,288
未払委託者報酬	51,970	41,390
その他未払費用	3,140	2,492
流動負債合計	146,089	45,170
負債合計	146,089	45,170
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 78,856,001	¹ 60,788,563
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 9,641,949	² 10,463,446
（分配準備積立金）	11,267,351	10,630,740
元本等合計	69,214,052	50,325,117
純資産合計	69,214,052	50,325,117
負債純資産合計	69,360,141	50,370,287

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 2021年11月13日 至 2022年5月12日		自 2022年5月13日 至 2022年11月14日	
営業収益				
受取配当金		3,733,335		2,581,360
有価証券売買等損益		13,530,625		6,229,678
営業収益合計		9,797,290		3,648,318
営業費用				
支払利息		145		74
受託者報酬		10,747		8,519
委託者報酬		345,335		274,111
その他費用		3,140		2,492
営業費用合計		359,367		285,196
営業損失()		10,156,657		3,933,514
経常損失()		10,156,657		3,933,514
当期純損失()		10,156,657		3,933,514
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()		87,912		91,237
期首剰余金又は期首欠損金()		474,263		9,641,949
剰余金増加額又は欠損金減少額		256,168		3,099,356
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		256,168		3,099,356
剰余金減少額又は欠損金増加額		127,811		78,576
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		127,811		78,576
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		9,641,949		10,463,446

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2022年5月13日	至 2022年11月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>2022年11月12日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を2022年11月14日としております。このため、当特定期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
1. 1 期首元本額	89,011,965円	78,856,001円
期中追加設定元本額	2,373,968円	514,700円
期中一部解約元本額	12,529,932円	18,582,138円

2.	特定期間末日における受益権の総数	78,856,001口	60,788,563口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,641,949円でありませ	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は10,463,446円でありませ

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 2021年11月13日 至 2022年5月12日	自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1 分配金の計算過程	<p>(自2021年11月13日 至2021年12月13日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(599,567円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,145,527円)及び分配準備積立金(9,253,013円)より分配対象額は12,998,107円(1万口当たり1,473.94円)であり、分配を行っておりませ</p>	<p>(自2022年5月13日 至2022年6月13日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(501,494円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,102,859円)及び分配準備積立金(11,267,351円)より分配対象額は14,871,704円(1万口当たり1,884.19円)であり、分配を行っておりませ</p>

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(555,722円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,932,656円)及び分配準備積立金(9,071,053円)より分配対象額は12,559,431円(1万口当たり1,542.20円)であり、分配を行っておりません。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(550,381円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,891,594円)及び分配準備積立金(9,453,389円)より分配対象額は12,895,364円(1万口当たり1,610.98円)であり、分配を行っておりません。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(466,363円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,115,913円)及び分配準備積立金(11,761,917円)より分配対象額は15,344,193円(1万口当たり1,943.25円)であり、分配を行っておりません。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(417,933円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,754,499円)及び分配準備積立金(10,746,374円)より分配対象額は13,918,806円(1万口当たり2,003.42円)であり、分配を行っておりません。

(自2022年2月15日 至2022年3月14日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(568,750円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,918,453円)及び分配準備積立金(10,002,249円)より分配対象額は13,489,452円(1万口当たり1,681.99円)であり、分配を行っておりません。

(自2022年3月15日 至2022年4月12日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(563,590円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,080,989円)及び分配準備積立金(10,187,985円)より分配対象額は13,832,564円(1万口当たり1,753.46円)であり、分配を行っておりません。

(自2022年8月13日 至2022年9月12日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(380,590円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,769,189円)及び分配準備積立金(11,164,307円)より分配対象額は14,314,086円(1万口当たり2,058.15円)であり、分配を行っておりません。

(自2022年9月13日 至2022年10月12日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(346,140円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,716,394円)及び分配準備積立金(11,219,920円)より分配対象額は14,282,454円(1万口当たり2,109.28円)であり、分配を行っておりません。

	<p>(自2022年4月13日 至2022年5月12日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(529,621円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,089,505円)及び分配準備積立金(10,737,730円)より分配対象額は14,356,856円(1万口当たり1,820.64円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>(自2022年10月13日 至2022年11月14日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(259,647円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,450,976円)及び分配準備積立金(10,371,093円)より分配対象額は13,081,716円(1万口当たり2,152.00円)であり、分配を行っておりません。</p>
--	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 2022年5月13日 至 2022年11月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	2022年11月14日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	4,344,727	1,222,388
親投資信託受益証券	0	1
合計	4,344,727	1,222,387

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
2022年5月12日現在	2022年11月14日現在
該当事項はありません。	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）

当 期
自 2022年5月13日
至 2022年11月14日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前 期 2022年5月12日現在	当 期 2022年11月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8777円 (8,777円)	0.8279円 (8,279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

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	AB SICAV I ALL MARKET INCOME PORTFOLIO S1D JPY H	7,295.448	49,857,091	
投資証券 合計			49,857,091	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーポートフォリオ・マ ザーファンド	9,963	9,980	
親投資信託受益証券 合計			9,980	
合計			49,867,071	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、ルクセンブルク籍の外国投資法人「AB SICAV I」が発行する「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ(クラスS1D)」の投資証券(円建)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は、すべて同ファンドの投資証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーポートフォリオ・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、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「オール・マーケット・インカム・ポートフォリオ(クラスS1D)」の状況

前記「オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド」の状況

前記「オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)」に記載のとおりであります。

2【ファンドの現況】

オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)

【純資産額計算書】

2022年11月30日

資産総額	1,260,733,760円
負債総額	510,797円
純資産総額(-)	1,260,222,963円
発行済数量	1,380,446,295口
1単位当たり純資産額(/)	0.9129円

(参考) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	45,616,339,474円
負債総額	680,837,000円
純資産総額(-)	44,935,502,474円
発行済数量	44,856,363,828口
1単位当たり純資産額(/)	1.0018円

オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定額分配コース)

純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	418,307,386円
負債総額	167,806円
純資産総額(-)	418,139,580円
発行済数量	527,015,632口
1単位当たり純資産額(/)	0.7934円

(参考) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)」の記載と同じ。

オール・マーケット・インカム戦略(奇数月定率分配コース)

純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	1,612,613,932円
負債総額	646,013円
純資産総額(-)	1,611,967,919円
発行済数量	1,967,640,528口
1単位当たり純資産額(/)	0.8192円

(参考) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)」の記載と同じ。

オール・マーケット・インカム戦略(予想分配金提示型コース)

純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	48,551,176円
負債総額	19,633円
純資産総額(-)	48,531,543円
発行済数量	58,179,767口
1単位当たり純資産額(/)	0.8342円

(参考) ダイワ・マネーポートフォリオ・マザーファンド

前記「オール・マーケット・インカム戦略(資産成長重視コース)」の記載と同じ。

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡

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な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。

(6) 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。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、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。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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け、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扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2022年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

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、株主総会において選任され、その任期は選任後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ときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、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、執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

ロ. 商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ. リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「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として、証券投資信託の設定を行なうとともに「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）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2022年11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	277,536
追加型株式投資信託	770	21,155,993
株式投資信託 合計	851	21,433,528
単位型公社債投資信託	79	159,741
追加型公社債投資信託	14	1,428,018
公社債投資信託 合計	93	1,587,759
総合計	944	23,021,287

3【委託会社等の経理状況】

1．当社の財務諸表は、「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。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第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）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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）に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第63期事業年度（2021年4月1日から2022年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第64期事業年度に係る中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,860	3,168
有価証券	333	486
前払費用	237	332
未収委託者報酬	13,150	13,811
未収収益	49	52
関係会社短期貸付金	18,700	24,900
その他	207	45
流動資産計	37,539	42,799
固定資産		
有形固定資産	1	203
建物	6	4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	68	65
未払金	8,405	9,856
未払収益分配金	13	26
未払償還金	39	12
未払手数料	4,734	4,917
その他未払金	2	4,900
未払費用	3,777	4,246
未払法人税等	804	980
未払消費税等	631	1,016
賞与引当金	950	866
その他	88	2
流動負債計	14,725	17,033
固定負債		
退職給付引当金	2,452	2,399
役員退職慰労引当金	74	13
その他	3	1
固定負債計	2,530	2,415
負債合計	17,256	19,449
純資産の部		

株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,564	△ 10,564	△ 10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 1,175	△ 1,175	△ 1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	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	△ 363	△ 363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

	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	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	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	947	947	38,566
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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）を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 10～18年

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。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年間）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

当社は証券投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）を適用する予定であります。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「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。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

- ・「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 2021年6月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
未払金	3,473百万円	4,694百万円

3 保証債務

前事業年度（2021年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2022年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 3月31日	2020年 6月24日

(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22日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月23日

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年 3月31日	2021年 6月23日

(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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,737百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,883円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月24日

(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、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが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

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

2. 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

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年7月4日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「2019年適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下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。

前事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	85	-	-	85
資産合計	85	-	-	85

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、コマーシャル・ペーパー、未払金及び未払費用は、短期間(1年以内)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、記載を省略しております。

当事業年度(2022年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	66	-	-	66
資産合計	66	-	-	66

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券486百万円、投資有価証券10,022百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（１年以内）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、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。なお、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付していません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであり、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の投資有価証券には含めておりません。

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2021年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載していません。

当事業年度（2022年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載していません。

２．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	85	55	30
（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(2022年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1)株式	66	55	11
(2)その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	454
小計	3,753	4,208	454
合計	10,575	9,180	1,395

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1)株式	-	-	-
(2)その他 証券投資信託	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1)株式	-	-	-
(2)その他 証券投資信託	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

(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、非積立型の確定給付制度(退職一時金制度であります)及び確定拠出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

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	2,574	百万円	2,452	百万円
勤務費用	155		152	
退職給付の支払額	378		303	
その他	101		98	
退職給付債務の期末残高	2,452		2,399	

(2) 退職給付債務及び年金資産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

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	2,452	百万円	2,399	百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	
退職給付引当金	2,452		2,399	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452		2,399	

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	155	百万円	152	百万円
その他	108		67	
確定給付制度に係る退職給付費用	263		219	

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186百万円、当事業年度189百万円であります。

(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内訳

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(2021年3月31日)		(2022年3月31日)	
繰延税金資産				
退職給付引当金	750		734	
賞与引当金	243		227	

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	254	356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	453	562
繰延税金負債合計	612	722
繰延税金資産の純額	973	885

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2021年3月31日）

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。

当事業年度（2022年3月31日）

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。

（収益認識関係）

（1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が74,402百万円、その他545百万円であります。

（2）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（3）顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事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。

[関連情報]

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、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、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取(注)	19,300 0	関係会社短期貸付金	18,700 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取(注)	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,727	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,900	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	14,917	未払手数料	3,321
							不動産の賃借料(注4)	527	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	株大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	-----------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2) 不動産の賃借料(注3)	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注4) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,784.79円	1株当たり純資産額	16,078.50円
1株当たり当期純利益	3,599.54円	1株当たり当期純利益	4,883.43円

(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、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益(百万円)	9,389	12,738
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	1	196
無形固定資産		
ソフトウェア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2022年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		5,646

未払費用	4,193
未払法人税等	1,623
賞与引当金	486
その他	2 655
流動負債合計	12,605
固定負債	
退職給付引当金	2,344
役員退職慰労引当金	33
その他	1
固定負債合計	2,379
負債合計	14,984
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,692
利益剰余金合計	7,067
株主資本合計	33,737
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	394
評価・換算差額等合計	394
純資産合計	34,131
負債・純資産合計	49,116

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間
	(自 2022年4月1日
	至 2022年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281

営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	1	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	2	579
営業外費用	3	274
経常利益		8,686
特別利益		-
特別損失	4	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金 資本準備金	利益剰余金 利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
				その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,737	12,737	12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
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	-	-	-	7,232	7,232	7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	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	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	576	576	576
当中間期変動額合計	576	576	7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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）を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

定額法によっております。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年間）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。

当社は証券投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

(会計方針の変更)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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。この変更による当中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

(連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用)

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。)に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2022年9月30日現在)
有形固定資産	326百万円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

3 保証債務

当中間会計期間（2022年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券売却損	244百万円

4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年3月31日	2022年6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2022年9月30日)

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

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下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。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	57	7,306	-	7,364
資産合計	57	7,306	-	7,364

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）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、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであり、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の投資有価証券には含めておりません。

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,454百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	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			
（1）株式	57	55	2
（2）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,692	3,171	478
小計	2,692	3,171	478
合計	7,364	6,797	567

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

（１）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

（２）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３）顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

当社は、資産運用に関する事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。

[関連情報]

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1.サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2.地域ごとの情報

（１）営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間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

営業収益のうち、中間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、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,084.78円
1株当たり中間純利益	2,110.46円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。）。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

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

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、若しくは取引の公正を害し、又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】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

- ・ 監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが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】

	名 称	資本金の額 (2022年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	(注6)	
再信託受託会社	日本マスタートラスト信託銀行株式会社	10,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	野村證券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	浜銀TT証券株式会社	3,307百万円	(注1)	
	株式会社足利銀行	135,000百万円	(注3)	
	株式会社愛媛銀行	21,367百万円	(注3)	
	株式会社大分銀行	19,598百万円	(注3)	
	株式会社高知銀行	19,544百万円	(注3)	
	株式会社佐賀銀行	16,062百万円	(注3)	
	株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	(注3)	
	信金中央金庫	690,998百万円	(注4)	(*1)
	株式会社常陽銀行	85,113百万円	(注3)	
	株式会社大東銀行	14,743百万円	(注3)	
	株式会社鳥取銀行	9,061百万円	(注3)	
	株式会社富山銀行	6,730百万円	(注3)	
	株式会社福島銀行	18,682百万円	(注3)	
	三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	(注6)	

(注1) 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います。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(*1) 出資金を記載しています。

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行いません。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
2022年5月26日	臨時報告書
2022年7月27日	臨時報告書
2022年8月5日	有価証券届出書、有価証券報告書
2022年8月26日	臨時報告書
2022年9月28日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2022年5月23日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬	友未
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井	康治

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」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63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、大和アセットマネジメント株式会社の2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1月6日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**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」に掲げられているオール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）の2022年5月13日から2022年11月14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、オール・マーケット・インカム戦略（資産成長重視コース）の2022年11月14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、大和アセットマネジメント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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

大和アセットマネジメント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が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1月6日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**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」に掲げられているオール・マーケット・インカム戦略（奇数月定額分配コース）の2022年5月13日から2022年11月14日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定額分配コース）の2022年11月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

大和アセットマネジメント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が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1月6日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知明
--------------------	-------	-------

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」に掲げられているオール・マーケット・インカム戦略（奇数月定率分配コース）の2022年5月13日から2022年11月14日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、オール・マーケット・インカム戦略（奇数月定率分配コース）の2022年11月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

大和アセットマネジメント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が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1月6日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**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」に掲げられているオール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）の2022年5月13日から2022年11月14日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、オール・マーケット・インカム戦略（予想分配金提示型コース）の2022年11月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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

大和アセットマネジメント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が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月28日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員	公認会計士	間瀬 友未
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	深井 康治
業務執行社員		

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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、大和アセットマネジメント株式会社の2022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（2022年4月1日から2022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並びに監査役及び監査役会の責任

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、継続企業的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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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。

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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。