

【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5月15日提出
【計算期間】 第21期（自 2022年2月16日 至 2023年2月15日）
【ファンド名】 D I A M外国株式インデックスファンド＜DC年金＞
【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 杉原 規之
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】 酒井 隆
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】 03-6774-5100
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

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

<ファンドの特色>

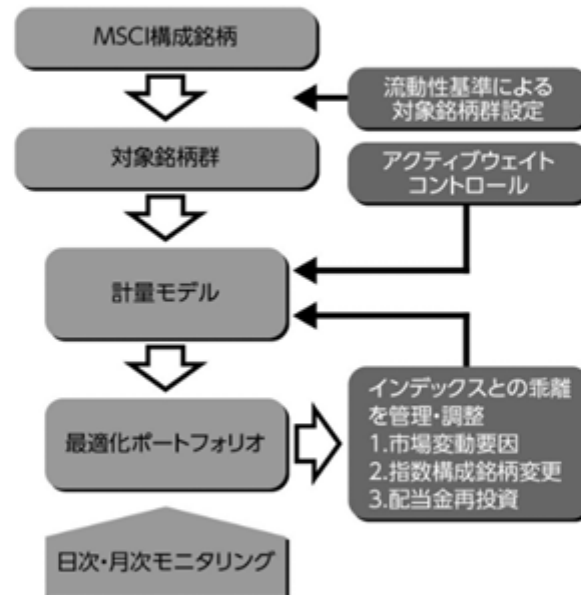
- 1 主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドに投資を行い、「MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
-

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

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

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

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



3 株式への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

4 実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

■ 分配方針

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

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

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

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

(注)当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル(日本を除く)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

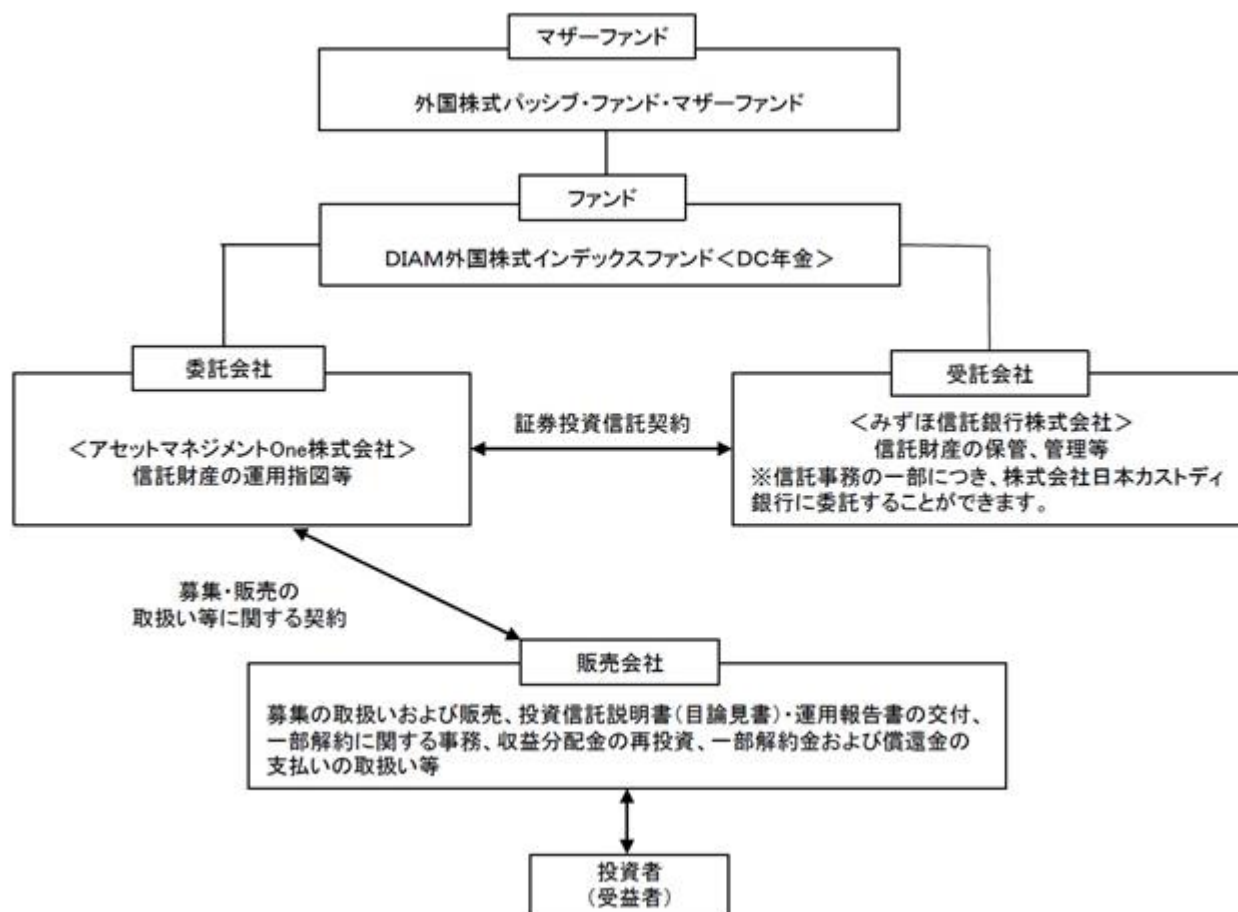
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2)【ファンドの沿革】

2002年9月5日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

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

- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

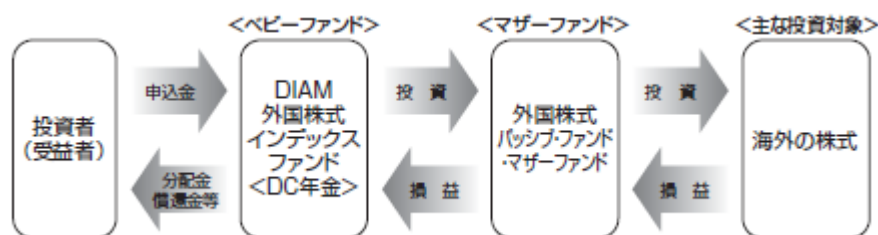
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2023年2月28日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2023年2月28日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

<投資対象>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

- 1)主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2)株式への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 3)実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

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

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

1) 株券

2) 国債証券

3) 地方債証券

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

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

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

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

4. 金融商品の指図範囲(約款第16条第3項)

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

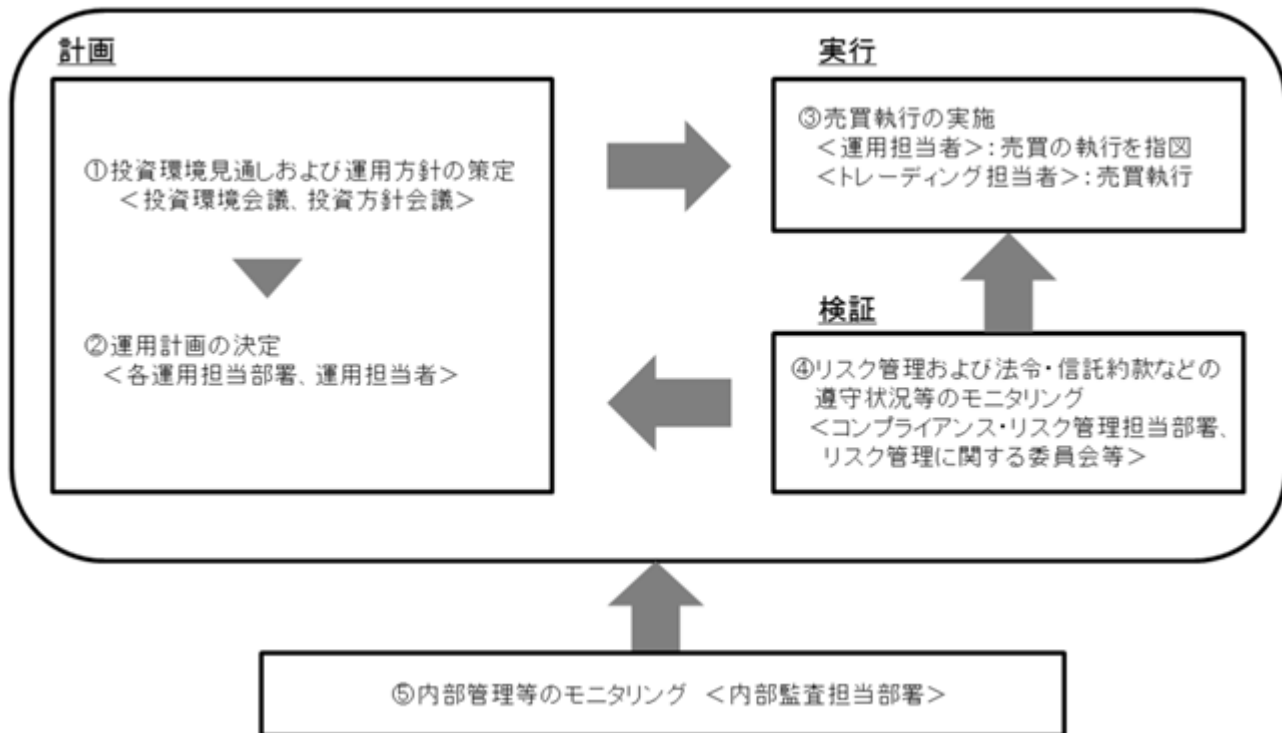
(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年2月15日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

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

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

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

(5) 【投資制限】

1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。

4) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

6) 投資する株式等の範囲(約款第18条)

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

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

7) 信用取引の指図範囲(約款第20条)

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

8) 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財

- 産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- b. 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに別に定める外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲内で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行なうことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象3.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ本項で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

9) スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- d. 上記c.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- e. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- f. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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

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

- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - c. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 - d. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 - e. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 - f. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 12) 有価証券の貸付けの指図および範囲(約款第24条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - b. 上記a. 1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- 13) 特別の場合の外貨建資産への投資制限(約款第25条)
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 14) 外貨為替予約の指図(約款第26条)
- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
 - b. 上記a.の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、原則として信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- c. 上記b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

15) 資金の借入れ(約款第33条)

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

信用リスク

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

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

流動性リスク

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

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

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

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

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

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

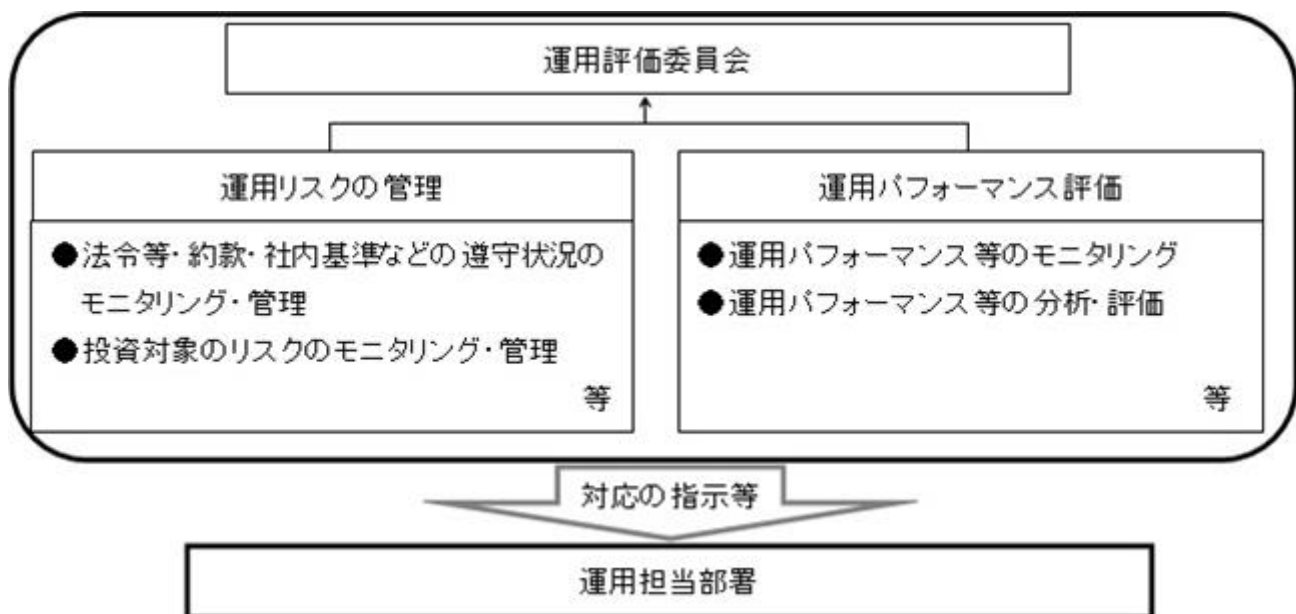
注意事項

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

<リスク管理体制>

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

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



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

リスク管理体制は2023年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

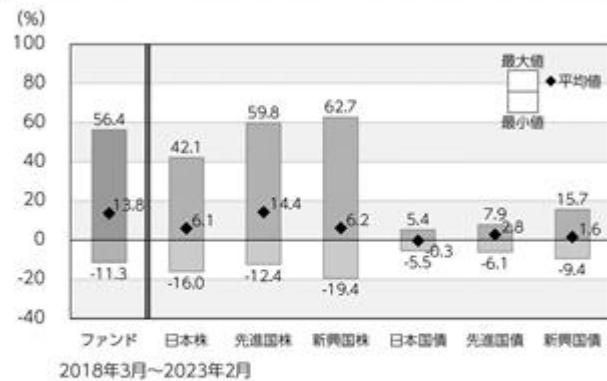
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数 (TOPIX)]は、日本の株式市場を広くに網羅し、投資対象としての機能を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIコクサイ・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIエマージング・マーケット・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	[NOMURA-BPI国債]は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社 (旧野村證券株式会社) が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	[FTSE世界国債インデックス (除く日本)]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.275%(税抜0.25%)

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎年8月15日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎年8月15日(休業日の場合は翌営業日とします。)および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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

上記は、2023年2月末現在のものであります。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2023年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	342,720,188,702	100.00
内 日本	342,720,188,702	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,689,886	0.00
純資産総額	342,727,878,588	100.00

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

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

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	812,332,545,775	95.31
内 アメリカ	560,669,483,976	65.78
内 イギリス	37,502,983,200	4.40
内 カナダ	30,950,443,987	3.63
内 フランス	29,062,662,633	3.41
内 スイス	27,942,217,118	3.28
内 ドイツ	21,501,854,092	2.52
内 オーストラリア	18,293,133,969	2.15
内 オランダ	16,646,112,261	1.95
内 アイルランド	15,410,593,381	1.81
内 スウェーデン	8,124,454,635	0.95
内 デンマーク	7,547,311,020	0.89
内 スペイン	6,747,123,237	0.79
内 香港	5,354,318,127	0.63
内 イタリア	4,650,488,041	0.55
内 ジャージー	3,299,377,426	0.39
内 フィンランド	3,217,095,186	0.38
内 シンガポール	2,802,779,058	0.33
内 ベルギー	2,116,776,004	0.25
内 ノルウェー	1,813,621,641	0.21
内 イスラエル	1,690,889,481	0.20
内 ケイマン諸島	1,579,389,754	0.19
内 バミューダ	1,330,697,354	0.16
内 オランダ領キュラソー	1,315,735,008	0.15
内 ルクセンブルグ	619,575,631	0.07
内 ニュージーランド	606,413,494	0.07
内 オーストリア	488,450,988	0.06
内 ポルトガル	417,313,507	0.05
内 リベリア	269,857,475	0.03
内 パナマ	195,321,562	0.02
内 マン島	166,072,529	0.02
投資信託受益証券	1,488,375,868	0.17
内 オーストラリア	1,061,197,424	0.12
内 シンガポール	427,178,444	0.05
投資証券	17,325,357,751	2.03

内	アメリカ	16,168,758,841	1.90
内	イギリス	398,069,141	0.05
内	フランス	328,077,053	0.04
内	香港	242,726,493	0.03
内	ベルギー	112,834,567	0.01
内	カナダ	74,891,656	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		21,163,967,405	2.48
純資産総額		852,310,246,799	100.00

その他資産の投資状況

2023年2月28日現在

資産の種類		時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		22,979,246,725	2.70
内	アメリカ	16,636,731,624	1.95
内	ドイツ	3,581,136,501	0.42
内	イギリス	1,080,894,541	0.13
内	カナダ	857,174,934	0.10
内	オーストラリア	823,309,125	0.10

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2023年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	55,264,079,449	6.2396 344,830,735,758	6.2015 342,720,188,702	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年2月28日現在

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

1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,000,134	20,885.75 41,774,310,691	20,165.93 40,334,569,435	- -	4.73
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	881,904	37,104.93 32,722,991,566	34,104.31 30,076,729,875	- -	3.53
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	1,141,595	13,592.10 15,516,674,541	12,782.30 14,592,210,681	- -	1.71
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	310,242	31,316.36 9,715,651,493	32,038.91 9,939,816,540	- -	1.17
5	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	331,953	28,527.05 9,469,640,658	28,306.19 9,396,327,311	- -	1.10
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	744,329	12,907.72 9,607,593,594	12,251.97 9,119,501,862	- -	1.07
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	691,660	12,944.53 8,953,216,040	12,283.33 8,495,890,102	- -	1.00
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	519,382	15,871.53 8,243,391,461	15,071.28 7,827,752,328	- -	0.92
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイ ダー/ヘル スケ ア・サー ビス	116,509	67,187.51 7,827,950,056	65,891.01 7,676,896,336	- -	0.90
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	365,043	19,522.45 7,126,535,905	19,380.67 7,074,778,940	- -	0.83
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	327,095	22,090.91 7,225,827,253	21,217.03 6,939,987,011	- -	0.81

12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	161,951	42,370.00 6,861,863,983	41,534.29 6,726,521,063	- -	0.79
13	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	284,533	24,468.50 6,962,098,100	23,113.38 6,576,521,684	- -	0.77
14	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	203,526	31,272.73 6,364,815,416	30,040.31 6,113,985,252	- -	0.72
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	296,779	18,988.04 5,635,252,235	18,968.95 5,629,587,852	- -	0.66
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	341,882	16,214.18 5,543,337,654	15,826.67 5,410,855,370	- -	0.63
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	107,466	50,436.64 5,420,224,685	48,462.58 5,208,080,524	- -	0.61
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	127,583	43,411.56 5,538,577,301	40,355.04 5,148,617,489	- -	0.60
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	231,639	23,492.38 5,441,752,707	22,197.25 5,141,748,931	- -	0.60
20	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	315,672	14,824.52 4,679,687,203	14,909.04 4,706,369,252	- -	0.55
21	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノー ジー	220,198	20,802.59 4,580,689,747	21,032.99 4,631,422,860	- -	0.54
22	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	50,605	89,817.27 4,545,202,998	86,115.25 4,357,862,479	- -	0.51
23	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	100,641	47,382.85 4,768,657,889	43,164.80 4,344,149,099	- -	0.51
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	900,868	4,856.07 4,374,682,212	4,663.84 4,201,512,591	- -	0.49
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	510,854	8,123.90 4,150,129,211	8,155.26 4,166,147,498	- -	0.49
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	171,495	23,962.72 4,109,487,369	23,981.81 4,112,760,557	- -	0.48
27	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	206,349	19,313.41 3,985,304,903	19,632.07 4,051,058,425	- -	0.48

28	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	50,259	82,112.92 4,126,913,361	79,814.39 4,011,391,854	- -	0.47
29	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・ア パレル・ 贅沢品	34,454	117,206.40 4,038,229,477	114,936.02 3,960,005,908	- -	0.46
30	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	698,945	5,960.34 4,165,955,153	5,559.53 3,885,810,868	- -	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年2月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.31
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.03
合計	97.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	6.64
銀行		6.21
石油・ガス・消耗燃料		5.21
医薬品		5.18
コンピュータ・周辺機器		4.95
半導体・半導体製造装置		4.75
情報技術サービス		3.63
保険		3.31
資本市場		3.29
インタラクティブ・メディアおよびサービス		2.96
ヘルスケア機器・用品		2.33
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.28
インターネット販売・通信販売		2.09
化学		2.07
バイオテクノロジー		2.02
ホテル・レストラン・レジャー		1.94
機械		1.83
自動車		1.80
電力		1.80
飲料		1.79
航空宇宙・防衛		1.74
食品		1.69
専門小売り		1.64
金属・鉱業		1.61
食品・生活必需品小売り		1.49
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.46

繊維・アパレル・贅沢品	1.38
各種電気通信サービス	1.14
娯楽	1.13
家庭用品	1.11
各種金融サービス	1.07
陸運・鉄道	1.05
コングロマリット	0.91
電気設備	0.87
総合公益事業	0.80
メディア	0.79
専門サービス	0.70
タバコ	0.68
通信機器	0.68
パーソナル用品	0.63
建設関連製品	0.59
航空貨物・物流サービス	0.58
電子装置・機器・部品	0.54
商業サービス・用品	0.49
複合小売り	0.46
消費者金融	0.41
商社・流通業	0.40
不動産管理・開発	0.34
エネルギー設備・サービス	0.30
家庭用耐久財	0.29
建設・土木	0.29
無線通信サービス	0.29
建設資材	0.27
容器・包装	0.25
自動車部品	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
ガス	0.14
運送インフラ	0.12
販売	0.11
水道	0.11
紙製品・林産品	0.10
海運業	0.07
旅客航空輸送業	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.02
合計	95.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Mar23	買建	612	17,202,743,109	16,636,731,624	1.95
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar23	買建	582	3,582,667,920	3,581,136,501	0.42
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar23	買建	83	1,082,096,597	1,080,894,541	0.13
	モントルオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar23	買建	35	874,827,760	857,174,934	0.10
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar23	買建	50	844,462,207	823,309,125	0.10

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2023年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第12計算期間末 (2014年2月17日)	75,426	75,426	2.3012	2.3012
第13計算期間末 (2015年2月16日)	98,769	98,769	2.9168	2.9168
第14計算期間末 (2016年2月15日)	82,214	82,214	2.4126	2.4126
第15計算期間末 (2017年2月15日)	107,765	107,765	3.0461	3.0461
第16計算期間末 (2018年2月15日)	123,694	123,694	3.3421	3.3421
第17計算期間末 (2019年2月15日)	139,504	139,504	3.4447	3.4447
第18計算期間末 (2020年2月17日)	177,764	177,764	4.1731	4.1731
第19計算期間末 (2021年2月15日)	219,795	219,795	4.6863	4.6863
第20計算期間末 (2022年2月15日)	290,585	290,585	5.6398	5.6398
第21計算期間末 (2023年2月15日)	345,133	345,133	6.1762	6.1762

2022年2月末日	287,449	-	5.5927	-
3月末日	323,179	-	6.1853	-
4月末日	312,337	-	5.9189	-
5月末日	315,768	-	5.9009	-
6月末日	311,816	-	5.7612	-
7月末日	325,672	-	5.9869	-
8月末日	328,965	-	6.0264	-
9月末日	315,460	-	5.7290	-
10月末日	347,633	-	6.2767	-
11月末日	337,782	-	6.0902	-
12月末日	319,447	-	5.7155	-
2023年1月末日	332,751	-	5.9308	-
2月末日	342,727	-	6.1378	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第12計算期間	30.8
第13計算期間	26.8
第14計算期間	17.3
第15計算期間	26.3
第16計算期間	9.7
第17計算期間	3.1
第18計算期間	21.1
第19計算期間	12.3
第20計算期間	20.3
第21計算期間	9.5

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第12計算期間	8,496,275,034	9,870,472,114
第13計算期間	8,954,460,215	7,869,839,615
第14計算期間	7,855,082,565	7,640,340,280
第15計算期間	7,253,514,984	5,952,570,108
第16計算期間	8,373,163,615	6,739,828,907
第17計算期間	9,162,101,369	5,674,741,976

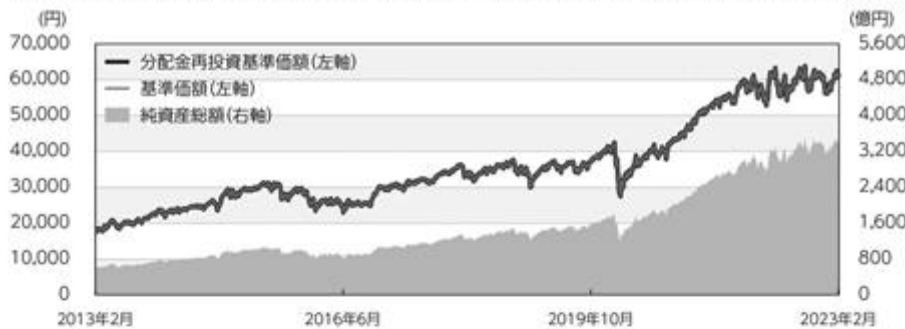
第18計算期間	10,301,449,476	8,202,787,502
第19計算期間	17,622,141,763	13,317,487,000
第20計算期間	16,069,850,899	11,447,537,038
第21計算期間	15,077,926,286	10,721,402,985

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2023年2月28日

基準価額・純資産の推移 (2013年2月28日～2023年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2002年9月5日)

分配の推移(税引前)

2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	95.31
内 アメリカ	65.78
内 イギリス	4.40
内 カナダ	3.63
内 フランス	3.41
内 スイス	3.28
内 その他	14.81
投資信託受益証券	0.17
内 オーストラリア	0.12
内 シンガポール	0.05
投資証券	2.03
内 アメリカ	1.90
内 イギリス	0.05
内 フランス	0.04
内 香港	0.03
内 ベルギー	0.01
内 カナダ	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.48
合計(純資産総額)	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.73
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.53
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.71
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.17
5	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.10
6	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.07
7	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.00
8	EXXON MOBIL CORP	株式	アメリカ	石油・ガス・消耗燃料	0.92
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	アメリカ	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケアサービス	0.90
10	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.83

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.70

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	ソフトウェア	6.64
2	銀行	6.21
3	石油・ガス・消耗燃料	5.21
4	医薬品	5.18
5	コンピュータ・周辺機器	4.95

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度による取得のみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
なお、ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所の休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）は、お申込みの受付を行いません。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

お申込価額（発行価格）

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

- ・基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま

す。
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

お申込手数料

ありません。

払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込方法

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

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は2002年9月5日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年2月16日から翌年2月15日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

イ. 償還規定

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

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

- j. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記 d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

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

八. 関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年2月15日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間(2022年2月16日から2023年2月15日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 2022年2月15日現在	第21期 2023年2月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	857,055,381	1,094,729,510
親投資信託受益証券	290,580,216,195	345,125,873,103
未収入金	-	204,964,000
流動資産合計	291,437,271,576	346,425,566,613
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	453,454,392	830,458,694
未払受託者報酬	47,552,925	55,141,698
未払委託者報酬	348,721,701	404,372,755
その他未払費用	1,941,264	1,951,872
流動負債合計	851,670,282	1,291,925,019
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	51,524,346,743	55,880,870,044
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	239,061,254,551	289,252,771,550
（分配準備積立金）	94,827,598,703	104,198,919,021
元本等合計	290,585,601,294	345,133,641,594
純資産合計		
負債純資産合計	291,437,271,576	346,425,566,613

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第20期		第21期	
	自	2021年2月16日 2022年2月15日	自	2022年2月16日 2023年2月15日
営業収益				
受取利息		3,501		7,678
有価証券売買等損益		46,264,863,454		29,940,986,908
営業収益合計		46,264,866,955		29,940,994,586
営業費用				
支払利息		203,447		363,013
受託者報酬		88,258,800		105,673,099
委託者報酬		647,231,773		774,936,641
その他費用		3,871,920		3,871,920
営業費用合計		739,565,940		884,844,673
営業利益又は営業損失()		45,525,301,015		29,056,149,913
経常利益又は経常損失()		45,525,301,015		29,056,149,913
当期純利益又は当期純損失()		45,525,301,015		29,056,149,913
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()		7,199,536,931		2,598,331,061
期首剰余金又は期首欠損金()		172,893,645,263		239,061,254,551
剰余金増加額又は欠損金減少額		70,914,499,235		73,789,932,192
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		70,914,499,235		73,789,932,192
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,072,654,031		50,056,234,045
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		43,072,654,031		50,056,234,045
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		239,061,254,551		289,252,771,550

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第21期	
	自 2022年2月16日	至 2023年2月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期
	2022年2月15日現在	2023年2月15日現在
1. 期首元本額	46,902,032,882円	51,524,346,743円
期中追加設定元本額	16,069,850,899円	15,077,926,286円
期中一部解約元本額	11,447,537,038円	10,721,402,985円
2. 受益権の総数	51,524,346,743口	55,880,870,044口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2021年2月16日 至 2022年2月15日	自 2022年2月16日 至 2023年2月15日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(38,325,748,650円)、信託約款に規定される収益調整金(147,035,593,886円)及び分配準備積立金(56,501,850,053円)より分配対象収益は241,863,192,589円(1万口当たり46,941.53円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(26,458,003,567円)、信託約款に規定される収益調整金(185,054,185,212円)及び分配準備積立金(77,740,915,454円)より分配対象収益は289,253,104,233円(1万口当たり51,762.45円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第20期	第21期
	自 2021年2月16日 至 2022年2月15日	自 2022年2月16日 至 2023年2月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 2022年2月15日現在	第21期 2023年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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よった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第20期 2022年2月15日現在	第21期 2023年2月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	45,006,494,388	29,430,432,338
合計	45,006,494,388	29,430,432,338

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第20期 2022年2月15日現在	第21期 2023年2月15日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.6398円 (56,398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

2023年2月15日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	55,311,292,707	345,125,873,103	
親投資信託受益証券	合計	55,311,292,707	345,125,873,103	
合計			345,125,873,103	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,958,066,121
コール・ローン	411,916,700
株式	817,729,794,487
投資信託受益証券	1,506,555,624
投資証券	17,705,126,582
派生商品評価勘定	533,160,330
未収入金	110,349,147
未収配当金	828,275,858
差入委託証拠金	5,723,312,456
流動資産合計	856,506,557,305
資産合計	856,506,557,305
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,077,629
未払解約金	273,902,800
流動負債合計	284,980,429
負債合計	284,980,429
純資産の部	
元本等	
元本	137,221,085,885
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	719,000,490,991
元本等合計	856,221,576,876
純資産合計	856,221,576,876
負債純資産合計	856,506,557,305

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月16日 至 2023年2月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年2月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	113,101,593,550円
同期中追加設定元本額	64,603,879,550円
同期中一部解約元本額	40,484,387,215円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,359,545,916円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,537,466円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,392,849円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	27,472,521円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,134,515円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	14,285,405円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	21,312,714円
たわらノーロード 先進国株式	43,143,503,610円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	371,248,659円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,124,755,370円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	812,932,249円
たわらノーロード バランス(堅実型)	86,757,879円
たわらノーロード バランス(標準型)	734,337,287円
たわらノーロード バランス(積極型)	932,352,496円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	1,335円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	72,512,085円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	283,171,853円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	250,978,945円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	420,410,827円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	661,599円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,654,116円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,497,348円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,796,669円
たわらノーロード 全世界株式	612,427,800円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,311,292,707円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,776,530,848円
Oneグローバルバランス	5,702,978円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	154,579,488円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	796,155,072円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,045,740,545円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	93,160,102円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	255,168,934円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	248,526,364円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,255,462円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	629,832,963円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,209,099円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	166,603,009円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	197,017,429円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	318,946,273円
投資のソムリエ	5,236,697,696円
クルーズコントロール	101,484,005円
投資のソムリエ<DC年金>	385,311,092円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	204,497,778円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	236,289,352円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	318,178,464円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,347,351,737円
ワールドアセットバランス(基本コース)	144,201,865円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	187,755,370円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	21,116,295円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,603,461円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,240,319円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	42,119,092円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	140,118,314円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	279,203,327円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	151,235,864円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	22,279,679円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,365,527円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,977,782円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	103,657,957円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,508,385円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	39,207,354円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	39,983,263円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	24,499,490円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	38,551,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	98,803,834円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	34,816,455円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	381,034,312円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	40,471,840円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,108,533,199円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,337,819円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,060,739,404円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	140,711,864円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	1,328,457円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	7,043,021円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	66,464,123円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,713,784円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	3,660,019円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	25,277,114円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	49,829,008円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,710,694円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	15,007,497円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,142,119円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,882円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,280,399円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,060,605円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	154,952,415円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	252,239,956円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	852,113,757円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	43,796,613円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	35,704,735円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	248,901,994円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	9,152,563円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	164,151円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	102,331,680円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,974,317円

D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	30,241,885円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	45,713,613円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	95,203,048円
動的パッケージファンド<DC年金>	9,895,958円
コア資産形成ファンド	6,569,591円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,688,753,509円
MHAM外国株式インデックスファンド	140,194,356円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	6,728,106円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,261,770,351円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,390,845,054円
計	137,221,085,885円
2. 受益権の総数	137,221,085,885口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年2月16日 至 2023年2月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年2月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月15日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	19,960,338,476	
投資信託受益証券	60,719,570	
投資証券	1,680,371,101	
合計	21,701,429,147	

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年2月15日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	82,336,800	-	82,713,394	376,594	
ユーロ	82,336,800	-	82,713,394	376,594	
買建	1,538,146,280	-	1,538,591,072	444,792	
アメリカ・ドル	1,123,585,690	-	1,123,770,685	184,995	
イギリス・ポンド	77,665,588	-	77,790,552	124,964	
オーストラリア・ドル	74,253,478	-	74,323,606	70,128	
カナダ・ドル	67,012,160	-	67,060,950	48,790	
ユーロ	195,629,364	-	195,645,279	15,915	
合計	1,620,483,080	-	1,621,304,466	68,198	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年2月15日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	20,040,345,535	-	20,562,360,038	522,014,503
合計	20,040,345,535	-	20,562,360,038	522,014,503

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2023年2月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	6.2397円 (62,397円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2023年2月15日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,141,595	99.700	113,817,021.500	
	ABBOTT LABORATORIES	218,054	107.260	23,388,472.040	
	AES CORP	79,505	26.290	2,090,186.450	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	112,458	136.010	15,295,412.580	
	ADVANCED MICRO DEVICES	201,632	85.950	17,330,270.400	
	ADOBE INC	58,405	377.900	22,071,249.500	
	CHUBB LTD	52,117	213.320	11,117,598.440	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	27,773	281.490	7,817,821.770	
	ALLSTATE CORP	32,939	135.040	4,448,082.560	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	83,770	201.000	16,837,770.000	

AMGEN INC	66,676	241.030	16,070,916.280	
HESS CORP	35,271	147.990	5,219,755.290	
AMERICAN EXPRESS CO	79,536	181.020	14,397,606.720	
AMERICAN ELECTRIC POWER	62,653	90.480	5,668,843.440	
AFLAC INC	72,673	69.210	5,029,698.330	
AMERICAN INTL GROUP	93,843	61.520	5,773,221.360	
ANALOG DEVICES	63,336	182.540	11,561,353.440	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	86,452	65.190	5,635,805.880	
VALERO ENERGY CORP	48,490	139.690	6,773,568.100	
ANSYS INC	10,831	274.280	2,970,726.680	
APPLE INC	2,000,134	153.200	306,420,528.800	
APPLIED MATERIALS INC	106,803	118.440	12,649,747.320	
ALBEMARLE CORP	13,961	270.700	3,779,242.700	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	69,412	81.780	5,676,513.360	
AMEREN CORP	31,621	85.200	2,694,109.200	
ARROW ELECTRONICS INC	9,936	126.170	1,253,625.120	
AUTODESK INC	26,907	228.040	6,135,872.280	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	51,847	224.590	11,644,317.730	
AUTOZONE INC	2,451	2,546.270	6,240,907.770	
AVERY DENNISON CORP	9,514	184.240	1,752,859.360	
BALL CORP	40,223	56.930	2,289,895.390	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	161,951	310.790	50,332,751.290	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	96,968	51.710	5,014,215.280	
BAXTER INTERNATIONAL INC	63,174	39.910	2,521,274.340	
BECTON DICKINSON & CO	35,061	243.410	8,534,198.010	
AMETEK INC	28,958	144.370	4,180,666.460	
VERIZON COMM INC	524,012	40.330	21,133,403.960	
WR BERKLEY CORP	29,191	67.060	1,957,548.460	
BEST BUY CO INC	25,405	88.310	2,243,515.550	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	462.520	1,397,272.920	
YUM! BRANDS INC	35,337	130.830	4,623,139.710	
FIRSTENERGY CORP	67,213	40.170	2,699,946.210	
BOEING CO	70,282	218.450	15,353,102.900	
ROBERT HALF INTL INC	14,456	83.670	1,209,533.520	
BORGWARNER INC	27,800	49.690	1,381,382.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	175,352	47.280	8,290,642.560	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	104.970	1,521,435.180	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,529	112.090	2,189,005.610	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,731	1,545.490	4,220,733.190	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	265,949	72.250	19,214,815.250	

ONEOK INC	56,980	69.770	3,975,494.600	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	131.490	1,276,636.410	
UNITED RENTALS INC	8,883	456.630	4,056,244.290	
SEMPRA ENERGY	38,567	156.850	6,049,233.950	
FEDEX CORP	30,991	212.670	6,590,855.970	
VERISIGN INC	11,850	213.820	2,533,767.000	
AMPHENOL CORP	74,344	80.730	6,001,791.120	
BROWN-FORMAN CORP	38,405	65.310	2,508,230.550	
QUANTA SERVICES INC	17,560	154.200	2,707,752.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.650	473,207.250	
CSX CORP	263,536	31.440	8,285,571.840	
COTERRA ENERGY INC	99,916	25.550	2,552,853.800	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	51.020	1,376,417.560	
CONSTELLATION BRANDS INC	19,343	225.750	4,366,682.250	
CARDINAL HEALTH INC	34,421	78.750	2,710,653.750	
CARLISLE COS INC	6,119	257.030	1,572,766.570	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	11.880	1,571,617.080	
CATERPILLAR INC	65,850	244.360	16,091,106.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	125.970	1,591,127.070	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	3.930	381,496.890	
JPMORGAN CHASE & CO	365,043	143.200	52,274,157.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	30,236	82.790	2,503,238.440	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19,878	125.780	2,500,254.840	
CINTAS CORP	11,173	443.070	4,950,421.110	
CISCO SYSTEMS INC	516,136	47.700	24,619,687.200	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	20.410	1,415,862.110	
CLOROX COMPANY	15,794	152.670	2,411,269.980	
COCA-COLA CO/THE	510,854	59.590	30,441,789.860	
COPART INC	54,011	69.280	3,741,882.080	
COGNEX CORP	20,432	55.330	1,130,502.560	
COLGATE-PALMOLIVE CO	98,865	73.180	7,234,940.700	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	34,546	181.270	6,262,153.420	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,434	297.910	2,214,662.940	
NRG ENERGY, INC.	28,364	35.100	995,576.400	
COMCAST CORP-CL A	549,210	39.060	21,452,142.600	
CONAGRA BRANDS INC	61,981	36.060	2,235,034.860	
CONSOLIDATED EDISON INC	43,855	91.100	3,995,190.500	
CMS ENERGY CORP	36,603	61.160	2,238,639.480	
COOPER COS INC	6,342	337.580	2,140,932.360	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	51.650	1,305,763.650	
CORNING INC	95,758	35.390	3,388,875.620	
WOLFSPEED INC	15,684	80.920	1,269,149.280	
SEALED AIR CORP	17,610	50.830	895,116.300	
HEICO CORP-CL A	9,463	136.890	1,295,390.070	

CUMMINS INC	17,803	248.410	4,422,443.230	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	68.370	1,369,587.840	
DR HORTON INC	40,602	99.170	4,026,500.340	
DANAHER CORP	86,123	256.240	22,068,157.520	
MOODY'S CORP	20,682	309.070	6,392,185.740	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	62,906	67.410	4,240,493.460	
TARGET CORP	57,714	171.170	9,878,905.380	
DEERE & CO	36,203	409.310	14,818,249.930	
MORGAN STANLEY	160,405	100.560	16,130,326.800	
REPUBLIC SERVICES INC	27,024	124.860	3,374,216.640	
COSTAR GROUP INC	50,052	76.780	3,842,992.560	
THE WALT DISNEY CO	227,404	107.660	24,482,314.640	
DOLLAR TREE INC	28,149	146.940	4,136,214.060	
DOVER CORP	17,842	155.700	2,777,999.400	
OMNICOM GROUP	26,570	93.180	2,475,792.600	
DTE ENERGY CO	23,792	113.700	2,705,150.400	
DUKE ENERGY CORP	96,473	99.470	9,596,169.310	
DARDEN RESTAURANTS INC	15,676	146.310	2,293,555.560	
EBAY INC	67,667	48.800	3,302,149.600	
BANK OF AMERICA CORP	900,868	35.620	32,088,918.160	
CITIGROUP INC	241,865	51.610	12,482,652.650	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	88.360	1,483,564.400	
EATON CORP PLC	49,676	172.970	8,592,457.720	
CADENCE DESIGN SYS INC	34,337	199.090	6,836,153.330	
DISH NETWORK CORP	24,416	14.020	342,312.320	
ECOLAB INC	32,550	158.400	5,155,920.000	
PERKINELMER INC	15,649	137.970	2,159,092.530	
ELECTRONIC ARTS INC	34,838	112.250	3,910,565.500	
SALESFORCE INC	124,876	169.960	21,223,924.960	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	238.160	803,075.520	
EMERSON ELECTRIC CO	73,889	85.990	6,353,715.110	
ATMOS ENERGY CORP	17,567	115.770	2,033,731.590	
ENTERGY CORP	26,097	106.090	2,768,630.730	
EOG RESOURCES INC	73,498	133.130	9,784,788.740	
EQUIFAX INC	15,156	214.060	3,244,293.360	
EQT CORP	40,996	31.080	1,274,155.680	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	28,995	255.520	7,408,802.400	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,974	113.110	2,259,259.140	
EXXON MOBIL CORP	519,382	116.420	60,466,452.440	
FMC CORP	15,534	128.640	1,998,293.760	
NEXTERA ENERGY INC	244,925	76.030	18,621,647.750	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,716	429.820	2,027,031.120	
FAIR ISAAC CORP	2,962	698.060	2,067,653.720	
ASSURANT INC	5,823	130.250	758,445.750	
FASTENAL CO	72,941	52.740	3,846,908.340	
FIFTH THIRD BANCORP	84,362	37.190	3,137,422.780	

M&T BANK CORP	20,766	160.620	3,335,434.920	
FIRST HORIZON CORP	69,634	24.700	1,719,959.800	
FISERV INC	76,076	116.010	8,825,576.760	
FORD MOTOR CO	494,379	12.970	6,412,095.630	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	31.710	1,202,316.360	
FREEMPORT-MCMORAN INC	180,180	42.980	7,744,136.400	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	768.400	1,219,450.800	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	26,269	188.250	4,945,139.250	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	36.990	946,907.010	
GENERAL DYNAMICS CORP	28,725	232.070	6,666,210.750	
GENERAL MILLS INC	74,919	75.350	5,645,146.650	
GENUINE PARTS CO	17,374	176.610	3,068,422.140	
GILEAD SCIENCES INC	156,388	85.680	13,399,323.840	
GARTNER INC	9,564	342.210	3,272,896.440	
MCKESSON CORP	17,980	365.850	6,577,983.000	
NVIDIA CORP	310,242	229.710	71,265,689.820	
GENERAL ELECTRIC CO	136,910	83.540	11,437,461.400	
VW GRAINGER INC	5,466	666.540	3,643,307.640	
HALLIBURTON CO	111,570	38.960	4,346,767.200	
MONSTER BEVERAGE CORP	49,739	104.250	5,185,290.750	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	42,430	371.780	15,774,625.400	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24,320	212.870	5,176,998.400	
HASBRO INC	15,437	58.110	897,044.070	
HENRY SCHEIN INC	17,431	88.980	1,551,010.380	
HEICO CORP	5,185	174.950	907,115.750	
HERSHEY FOODS CORP	18,695	238.900	4,466,235.500	
HP INC	125,955	30.400	3,829,032.000	
F5 INC	6,924	147.230	1,019,420.520	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	85.700	1,313,095.400	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	31.360	1,370,902.400	
HOLOGIC INC	30,695	83.150	2,552,289.250	
HOME DEPOT INC	127,583	318.430	40,626,254.690	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22,880	108.740	2,487,971.200	
HORMEL FOODS CORP	38,851	44.990	1,747,906.490	
CENTERPOINT ENERGY INC	78,791	29.280	2,307,000.480	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	264.370	952,260.740	
HUBBELL INC	6,903	245.420	1,694,134.260	
HUMANA INC	15,844	501.680	7,948,617.920	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,348	194.350	2,011,133.800	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	181,491	15.350	2,785,886.850	
BIOGEN INC	17,603	289.080	5,088,675.240	
IDEX CORP	9,065	225.350	2,042,797.750	
ILLINOIS TOOL WORKS	38,790	238.050	9,233,959.500	
INTUIT INC	33,501	421.970	14,136,416.970	

IDEXX LABORATORIES INC	10,162	503.650	5,118,091.300	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	29,293	185.680	5,439,124.240	
INTEL CORP	512,432	28.640	14,676,052.480	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	31,979	96.030	3,070,943.370	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	39.150	1,728,589.950	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	37.580	1,716,616.820	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,506	166.560	1,583,319.360	
INCYTE CORP	24,449	79.360	1,940,272.640	
JOHNSON & JOHNSON	327,095	162.040	53,002,473.800	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,402	77.580	3,056,807.160	
KLA CORPORATION	17,734	402.330	7,134,920.220	
DEVON ENERGY CORP	78,384	63.940	5,011,872.960	
KELLOGG CO	32,941	67.200	2,213,635.200	
KEYCORP	118,955	19.280	2,293,452.400	
KIMBERLY-CLARK CORP	42,173	128.580	5,422,604.340	
BLACKROCK INC/NEW YORK	18,814	729.150	13,718,228.100	
KROGER CO	82,775	43.630	3,611,473.250	
LAM RESEARCH CORP	17,260	516.210	8,909,784.600	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,890	441.450	2,600,140.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	142.630	1,573,066.270	
AKAMAI TECHNOLOGIES	20,036	87.790	1,758,960.440	
PLUG POWER INC	56,149	15.810	887,715.690	
LENNAR CORP	32,361	104.070	3,367,809.270	
ELI LILLY & CO	100,641	347.560	34,978,785.960	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	44.930	1,265,049.080	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	34.680	622,055.160	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	91,189	186.770	17,031,369.530	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	37,189	153.040	5,691,404.560	
LOCKHEED MARTIN CORP	29,695	481.580	14,300,518.100	
LOEWS CORP	23,530	61.780	1,453,683.400	
LOWE'S COS INC	77,478	213.760	16,561,697.280	
DOMINION ENERGY INC	101,828	58.060	5,912,133.680	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	44.140	1,783,300.140	
MCCORMICK & CO INC	32,031	74.910	2,399,442.210	
MCDONALD'S CORPORATION	91,413	266.610	24,371,619.930	
S&P GLOBAL INC	42,505	364.860	15,508,374.300	
EVEREST RE GROUP LTD	5,353	379.660	2,032,319.980	
MARKEL CORPORATION	1,674	1,347.860	2,256,317.640	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	77,695	76.590	5,950,660.050	
MARSH & MCLENNAN COS	62,147	167.000	10,378,549.000	

MASCO CORP	28,937	55.430	1,603,977.910	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,736	356.200	2,755,563.200	
METLIFE INC	84,799	72.050	6,109,767.950	
MEDTRONIC PLC	166,079	83.400	13,850,988.600	
ACTIVISION BLIZZARD INC	97,496	76.780	7,485,742.880	
CVS HEALTH CORP	163,616	88.520	14,483,288.320	
MERCK & CO. INC.	315,672	108.740	34,326,173.280	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	54,362	86.880	4,722,970.560	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,455	243.870	2,793,530.850	
MICROSOFT CORP	881,904	272.170	240,027,811.680	
MICRON TECH INC	135,654	62.070	8,420,043.780	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	69,597	84.880	5,907,393.360	
3M CO	69,396	114.210	7,925,717.160	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	117.150	739,333.650	
ENTEGRIS INC	17,709	85.140	1,507,744.260	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	251.740	1,622,464.300	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,578	270.420	5,564,702.760	
ILLUMINA INC	19,833	212.830	4,221,057.390	
XCEL ENERGY INC	69,325	67.980	4,712,713.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,716	102.920	1,205,810.720	
NETAPP INC	28,265	67.720	1,914,105.800	
NEWELL BRANDS INC	41,984	14.900	625,561.600	
NEWMONT CORP	99,287	47.010	4,667,481.870	
NVR INC	405	5,119.910	2,073,563.550	
NIKE INC-CL B	157,485	126.200	19,874,607.000	
NORDSON CORP	6,447	242.770	1,565,138.190	
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,997	235.280	6,822,414.160	
EVERSOURCE ENERGY	43,042	78.890	3,395,583.380	
NISOURCE INC	53,270	26.930	1,434,561.100	
NORTHERN TRUST CORP	24,836	97.330	2,417,287.880	
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,361	467.510	8,583,951.110	
WELLS FARGO & CO	472,491	48.500	22,915,813.500	
NUCOR CORP	31,660	171.260	5,422,091.600	
CHENIERE ENERGY INC	28,554	148.790	4,248,549.660	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,654	115.350	5,381,538.900	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	114,744	66.340	7,612,116.960	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,630	358.690	4,171,564.700	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,757	861.000	6,678,777.000	
ORACLE CORP	199,212	89.090	17,747,797.080	
PACCAR INC	64,801	73.200	4,743,433.200	
PTC INC	13,665	134.360	1,836,029.400	

EXELON CORP	121,664	42.030	5,113,537.920	
PARKER HANNIFIN CORP	16,101	352.350	5,673,187.350	
PAYCHEX INC	40,519	113.940	4,616,734.860	
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,651	331.520	3,199,499.520	
PPL CORPORATION	88,737	28.540	2,532,553.980	
PEPSICO INC	171,495	175.770	30,143,676.150	
PENTAIR PLC	19,804	56.400	1,116,945.600	
PFIZER INC	698,945	43.720	30,557,875.400	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	45.880	1,504,680.480	
CONOCOPHILLIPS	159,169	113.550	18,073,639.950	
PG&E CORP	178,257	15.580	2,777,244.060	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	28,445	233.720	6,648,165.400	
ALTRIA GROUP INC	224,442	47.410	10,640,795.220	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51,010	161.130	8,219,241.300	
BROWN & BROWN INC	30,650	57.260	1,755,019.000	
GARMIN LTD	19,911	97.310	1,937,539.410	
PPG INDUSTRIES INC	28,341	129.780	3,678,094.980	
COSTCO WHOLESALE CORP	55,182	503.220	27,768,686.040	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,707	120.900	3,349,776.300	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	144.590	2,101,760.240	
PROCTER & GAMBLE CO	296,779	139.280	41,335,379.120	
PROGRESSIVE CORP	73,178	139.270	10,191,500.060	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	60,100	61.160	3,675,716.000	
PULTE GROUP INC	29,050	56.480	1,640,744.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	33,653	116.180	3,909,805.540	
QUALCOMM INC	140,158	132.340	18,548,509.720	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	23,437	114.240	2,677,442.880	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	65.520	1,532,250.720	
REGENERON PHARMACEUTICALS	13,397	754.210	10,104,151.370	
REPLIGEN CORP	6,730	188.360	1,267,662.800	
RESMED INC	18,628	213.920	3,984,901.760	
US BANCORP	176,600	49.130	8,676,358.000	
SEAGEN INC	16,860	140.815	2,374,140.900	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,851	66.280	3,039,004.280	
ROSS STORES INC	44,171	116.800	5,159,172.800	
ROLLINS INC	25,920	35.640	923,788.800	
ROPER TECHNOLOGIES INC	13,120	426.760	5,599,091.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,633	293.170	4,289,956.610	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	75.370	2,070,941.490	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	89.100	1,467,209.700	
ACCENTURE PLC-CL A	78,843	284.770	22,452,121.110	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	168,645	65.660	11,073,230.700	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,232	241.480	3,195,263.360	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	29,595	184.130	5,449,327.350	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	75,043	67.810	5,088,665.830	
BOOKING HOLDINGS INC	4,956	2,471.050	12,246,523.800	
SCHLUMBERGER LTD	177,410	56.820	10,080,436.200	
SCHWAB (CHARLES) CORP	181,379	80.770	14,649,981.830	
POOL CORP	4,660	375.330	1,749,037.800	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26,144	126.710	3,312,706.240	
BUNGE LTD	18,642	99.960	1,863,454.320	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	62.480	904,522.960	
ELEVANCE HEALTH INC	29,928	491.480	14,709,013.440	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,104	157.360	3,006,205.440	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31,921	91.980	2,936,093.580	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30,476	231.950	7,068,908.200	
CENTENE CORP	70,080	73.380	5,142,470.400	
SVB FINANCIAL GROUP	7,330	310.770	2,277,944.100	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	67.480	1,002,482.880	
SNAP-ON INC	7,068	252.200	1,782,549.600	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	46,776	103.270	4,830,557.520	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	150.760	1,080,195.400	
EDISON INTERNATIONAL	48,533	67.540	3,277,918.820	
SOUTHERN CO	136,027	66.650	9,066,199.550	
TRUIST FINANCIAL CORP	165,326	48.820	8,071,215.320	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	35.510	699,547.000	
AT&T INC	888,201	19.150	17,009,049.150	
CHEVRON CORP	231,639	172.320	39,916,032.480	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	89.160	1,718,113.200	
STATE STREET CORP	46,198	93.580	4,323,208.840	
STARBUCKS CORP	142,819	107.980	15,421,595.620	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	126.500	2,901,530.500	
STRYKER CORP	42,635	264.660	11,283,779.100	
NETFLIX INC	55,471	359.960	19,967,341.160	
GEN DIGITAL INC	73,086	21.200	1,549,423.200	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,318	60.840	1,236,147.120	
SYNOPSIS INC	18,779	375.940	7,059,777.260	
SYSCO CORP	62,521	77.780	4,862,883.380	
INTUITIVE SURGICAL INC	44,632	241.090	10,760,328.880	
TELEFLEX INC	5,532	245.260	1,356,778.320	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	10.250	1,381,505.250	
TERADYNE INC	18,512	108.010	1,999,481.120	
TEXAS INSTRUMENTS INC	113,701	176.340	20,050,034.340	

TEXTRON INC	25,824	74.590	1,926,212.160	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	48,795	571.480	27,885,366.600	
GLOBE LIFE INC	12,153	120.690	1,466,745.570	
DAVITA INC	6,813	82.890	564,729.570	
TRACTOR SUPPLY CO	13,690	237.990	3,258,083.100	
BIO-TECHNE CORP	20,652	77.000	1,590,204.000	
TRIMBLE INC	28,676	55.610	1,594,672.360	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,300	326.190	1,728,807.000	
TYSON FOODS INC	35,684	60.890	2,172,798.760	
UGI CORP	24,160	39.450	953,112.000	
MARATHON OIL CORP	84,059	27.160	2,283,042.440	
UNION PACIFIC CORP	77,769	204.030	15,867,209.070	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	183,061	101.370	18,556,893.570	
UNITEDHEALTH GROUP INC	116,509	492.830	57,419,130.470	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	148.340	1,200,960.640	
VF CORP	37,887	27.620	1,046,438.940	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	22.450	1,765,984.350	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32,140	300.250	9,650,035.000	
VULCAN MATERIALS CO	16,452	185.580	3,053,162.160	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	91,706	36.750	3,370,195.500	
WALMART INC	187,896	145.490	27,336,989.040	
WASTE MANAGEMENT INC	50,578	151.340	7,654,474.520	
WATERS CORP	7,511	339.320	2,548,632.520	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	55.130	1,228,572.050	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	9,641	276.040	2,661,301.640	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	147.040	1,864,320.160	
VAIL RESORTS INC	5,235	255.770	1,338,955.950	
WESTERN DIGITAL CORP	40,723	43.640	1,777,151.720	
WABTEC CORP	20,273	103.450	2,097,241.850	
WHIRLPOOL CORP	6,832	150.570	1,028,694.240	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	121.770	2,293,294.410	
WYNN RESORTS LTD	12,757	109.080	1,391,533.560	
NASDAQ INC	41,596	58.620	2,438,357.520	
CME GROUP INC	44,342	186.390	8,264,905.380	
WILLIAMS COS INC	151,890	31.920	4,848,328.800	
LKQ CORP	31,504	57.420	1,808,959.680	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	53.290	1,810,048.140	
WEC ENERGY GROUP INC	38,318	91.700	3,513,760.600	
CARMAX INC	18,673	75.910	1,417,467.430	
TJX COMPANIES INC	145,228	80.720	11,722,804.160	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	6,730	318.760	2,145,254.800	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	4.800	749,035.200	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	51.450	891,525.600	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15,092	224.910	3,394,341.720	
SIGNATURE BANK	7,996	130.150	1,040,679.400	
CBRE GROUP INC	41,089	88.900	3,652,812.100	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	21.020	331,674.580	
REGIONS FINANCIAL CORP	117,222	23.850	2,795,744.700	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	347.580	1,430,291.700	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,387	520.560	2,804,256.720	
WESTLAKE CORP	4,187	124.190	519,983.530	
T-MOBILE US INC	78,434	147.490	11,568,230.660	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,972	57.560	2,473,468.320	
MOSAIC CO/THE	42,561	49.970	2,126,773.170	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	356.080	1,734,465.680	
CELANESE CORP	13,841	122.080	1,689,709.280	
DEXCOM INC	48,710	118.550	5,774,570.500	
EXPEDIA GROUP INC	19,186	114.950	2,205,430.700	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	85.530	2,055,029.310	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,123	352.740	4,629,007.020	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	21.730	783,018.820	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	69,896	108.400	7,576,726.400	
LIVE NATION	20,444	78.080	1,596,267.520	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,474	1,644.520	5,713,062.480	
TRANSDIGM GROUP INC	6,148	755.680	4,645,920.640	
MASTERCARD INC	107,466	369.960	39,758,121.360	
WESTERN UNION CO	46,712	14.100	658,639.200	
OWENS CORNING	13,227	103.410	1,367,804.070	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	95.250	1,439,037.000	
AERCAP HOLDINGS NV	17,861	63.010	1,125,421.610	
FIRST SOLAR INC	11,903	165.040	1,964,471.120	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	15,300	144.550	2,211,615.000	
DELTA AIR LINES INC	21,592	39.100	844,247.200	
INSULET CORP	8,834	293.200	2,590,128.800	
DISCOVER FINANCIAL	33,236	115.350	3,833,772.600	
TE CONNECTIVITY LTD	38,762	132.700	5,143,717.400	
MASIMO CORP	5,688	165.180	939,543.840	
LULULEMON ATHLETICA INC	14,547	319.880	4,653,294.360	
VMWARE INC	26,690	117.230	3,128,868.700	
MERCADOLIBRE INC	5,715	1,132.310	6,471,151.650	
ULTA BEAUTY INC	6,073	524.650	3,186,199.450	
INVESCO LTD	38,530	19.000	732,070.000	
MSCI INC	9,807	561.820	5,509,768.740	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	193,016	101.710	19,631,657.360	
VISA INC	203,526	229.390	46,686,829.140	
KEURIG DR PEPPER INC	92,816	35.390	3,284,758.240	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22,809	149.310	3,405,611.790	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,137	128.640	8,121,943.680	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	65.030	1,052,315.460	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	257,877	18.310	4,721,727.870	
XYLEM INC	22,848	107.340	2,452,504.320	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	33,342	100.130	3,338,534.460	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	216.190	1,018,903.470	
SPLUNK INC	20,898	106.580	2,227,308.840	
EPAM SYSTEMS INC	7,090	361.500	2,563,035.000	
HCA HEALTHCARE INC	28,752	258.900	7,443,892.800	
VERISK ANALYTICS INC	18,974	176.820	3,354,982.680	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	150.690	1,174,176.480	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	210.000	1,857,240.000	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	22,434	135.360	3,036,666.240	
NXP SEMICONDUCTOR NV	32,109	189.790	6,093,967.110	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	16,343	94.870	1,550,460.410	
TARGA RESOURCES CORP	25,830	77.220	1,994,592.600	
LEAR CORP	6,911	142.090	981,983.990	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,709	126.550	1,608,323.950	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	31,059	62.460	1,939,945.140	
DOLLAR GENERAL CORP	27,899	231.380	6,455,270.620	
FORTINET INC	81,166	61.190	4,966,547.540	
HORIZON PHARMA PLC	27,613	109.550	3,025,004.150	
TESLA INC	331,953	209.250	69,461,165.250	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	125.210	865,701.940	
ENPHASE ENERGY INC	17,046	208.350	3,551,534.100	
GENERAL MOTORS CO	171,210	42.430	7,264,440.300	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	32.610	1,279,290.300	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,661	245.020	2,367,138.220	
APTIV PLC	34,310	121.100	4,154,941.000	
PHILLIPS 66	59,404	107.950	6,412,661.800	
META PLATFORMS INC	284,533	179.480	51,067,982.840	
IQVIA HOLDINGS INC	22,514	227.070	5,112,253.980	
DIAMONDBACK ENERGY INC	20,087	149.870	3,010,438.690	
SERVICENOW INC	25,333	461.350	11,687,379.550	

PALO ALTO NETWORKS INC	36,942	170.140	6,285,311.880	
WORKDAY INC	25,547	189.540	4,842,178.380	
ABBVIE INC	220,198	152.590	33,600,012.820	
ZOETIS INC	58,756	171.900	10,100,156.400	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	18.820	1,020,251.020	
CDW CORP	16,465	208.090	3,426,201.850	
HOWMET AEROSPACE INC	47,590	43.020	2,047,321.800	
TWILIO INC	21,090	62.100	1,309,689.000	
SNAP INC	127,318	10.850	1,381,400.300	
TRADE DESK INC A	53,230	49.920	2,657,241.600	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,466	71.120	1,597,781.920	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	35.100	310,459.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	35.020	695,882.420	
OKTA INC	17,828	77.280	1,377,747.840	
BLACK KNIGHT INC	17,653	63.600	1,122,730.800	
BAKER HUGHES CO	126,292	32.460	4,099,438.320	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,167	99.270	1,803,438.090	
BROADCOM INC	50,259	602.310	30,271,498.290	
ARES MANAGEMENT CORP	19,534	83.930	1,639,488.620	
MONGODB INC	9,021	228.810	2,064,095.010	
BURLINGTON STORES INC	8,453	229.990	1,944,105.470	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	12.890	790,427.690	
VEEVA SYSTEMS INC	16,856	171.930	2,898,052.080	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,212	52.370	1,267,982.440	
EVERGY INC	28,226	60.650	1,711,906.900	
ALLEGION PLC	10,140	119.860	1,215,380.400	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	77.550	1,420,250.700	
STERIS PLC	12,524	194.840	2,440,176.160	
DOCUSIGN INC	26,362	63.640	1,677,677.680	
WIX.COM LTD	5,855	86.930	508,975.150	
DROPBOX INC	30,479	24.000	731,496.000	
KKR & CO INC	67,430	58.600	3,951,398.000	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	47.880	241,794.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,921	77.900	2,175,045.900	
MODERNA INC	41,626	175.620	7,310,358.120	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	34,409	151.370	5,208,490.330	
ARAMARK	31,133	39.010	1,214,498.330	
CIGNA CORP	38,214	299.360	11,439,743.040	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	43.030	1,410,093.100	
DOW INC	87,667	59.760	5,238,979.920	
OVINTIV INC	31,603	48.740	1,540,330.220	
AMCOR PLC	188,789	11.400	2,152,194.600	
PINTEREST INC	69,746	24.680	1,721,331.280	
FOX CORP-A	36,501	35.760	1,305,275.760	
FOX CORP-B	15,511	33.130	513,879.430	

CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	10.860	462,483.960	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	25,723	116.310	2,991,842.130	
CHEWY INC	9,648	47.890	462,042.720	
AVANTOR INC	78,214	24.280	1,899,035.920	
DYNATRACE INC	25,429	44.370	1,128,284.730	
CLOUDFLARE INC	29,770	68.380	2,035,672.600	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	74.470	1,027,686.000	
CARRIER GLOBAL CORP	101,898	45.130	4,598,656.740	
OTIS WORLDWIDE CORP	52,855	84.330	4,457,262.150	
UBER TECHNOLOGIES INC	181,560	35.230	6,396,358.800	
CORTEVA INC	90,590	62.180	5,632,886.200	
MATCH GROUP INC	35,259	45.040	1,588,065.360	
FERGUSON PLC	25,702	147.430	3,789,245.860	
BILL.COM HOLDINGS INC	11,988	97.060	1,163,555.280	
BLACKSTONE INC	88,026	96.770	8,518,276.020	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	217.060	1,155,193.320	
CARLYLE GROUP INC	24,530	35.330	866,644.900	
DATADOG INC	29,179	85.480	2,494,220.920	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	72.460	1,861,424.940	
INGERSOLL RAND INC	51,479	57.430	2,956,438.970	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	44,135	72.610	3,204,642.350	
PAYCOM SOFTWARE INC	6,341	324.690	2,058,859.290	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	19.490	747,285.580	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	21.200	196,460.400	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	39.720	1,224,925.080	
AON PLC	26,341	312.440	8,229,982.040	
WARNER BROS DISCOVERY INC	291,778	14.730	4,297,889.940	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	1,928.560	1,419,420.160	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	40.950	924,077.700	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	59.030	772,938.820	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	13.100	242,716.800	
AIRBNB INC	47,177	120.870	5,702,283.990	
CONSTELLATION ENERGY CORP	41,224	86.060	3,547,737.440	
ROYALTY PHARMA PLC	41,775	38.000	1,587,450.000	
ROBLOX CORP	45,019	35.670	1,605,827.730	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	26.870	796,856.720	
VIATRIS INC	150,826	11.810	1,781,255.060	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,444	53.290	1,409,200.760	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	12,687	83.870	1,064,058.690	
HF SINCLAIR CORP	20,299	55.360	1,123,752.640	
SNOWFLAKE INC	28,582	171.020	4,888,093.640	
DOORDASH INC	29,575	61.610	1,822,115.750	

ARISTA NETWORKS INC	29,367	141.460	4,154,255.820	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	50,482	71.660	3,617,540.120	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	202,824	9.220	1,870,037.280	
FNF GROUP	31,004	43.590	1,351,464.360	
JACOBS SOLUTIONS INC	16,615	122.520	2,035,669.800	
MARVELL TECHNOLOGY INC	107,989	47.210	5,098,160.690	
APA CORP	40,946	42.470	1,738,976.620	
LUCID GROUP INC	44,910	10.330	463,920.300	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	57.550	689,506.550	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	214.880	799,568.480	
TOAST INC	32,620	25.110	819,088.200	
GRAB HOLDINGS LTD	168,328	3.480	585,781.440	
CATALENT INC	20,564	70.350	1,446,677.400	
SYNCHRONY FINANCIAL	61,118	36.320	2,219,805.760	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	63,378	43.360	2,748,070.080	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	149.510	782,983.870	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,209	185.240	4,113,995.160	
HUBSPOT INC	5,802	363.920	2,111,463.840	
QORVO INC	14,144	106.430	1,505,345.920	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	92.730	1,422,014.550	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	6,728	315.430	2,122,213.040	
GODADDY INC	19,713	81.040	1,597,541.520	
ETSY INC	15,614	133.750	2,088,372.500	
TRANSUNION	25,708	68.190	1,753,028.520	
ALCOA CORP	23,941	48.930	1,171,433.130	
BLOCK INC	66,910	78.800	5,272,508.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	60,266	76.460	4,607,938.360	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	55.950	1,467,064.950	
WESTROCK CO	34,286	33.000	1,131,438.000	
KRAFT HEINZ CO	92,106	39.880	3,673,187.280	
NOVOCURE LTD	12,317	86.410	1,064,311.970	
FORTIVE CORP	42,608	69.020	2,940,804.160	
WASTE CONNECTIONS INC	31,039	134.680	4,180,332.520	
ALPHABET INC-CL A	744,329	94.680	70,473,069.720	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	156,384	16.540	2,586,591.360	
PAYPAL HOLDINGS INC	137,530	77.260	10,625,567.800	
SEA LTD ADR	43,908	64.230	2,820,210.840	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	32.880	1,477,101.120	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	45.540	743,258.340	
ALPHABET INC-CL C	691,660	94.950	65,673,117.000	
ZSCALER INC	10,310	136.190	1,404,118.900	

	LINDE PLC	62,082	334.000	20,735,388.000	
	ROKU INC	15,660	56.640	886,982.400	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,085	400.130	5,635,831.050	
	VISTRA CORP	49,633	23.010	1,142,055.330	
アメリカ・ドル	小計	42,370,849		4,451,014,168.120 (591,050,171,385)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	17.025	782,520.070	
	ASHTED GROUP	54,304	55.880	3,034,507.520	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	27.940	821,352.180	
	BARCLAYS PLC	2,022,417	1.873	3,787,987.040	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.599	571,177.400	
	BT GROUP PLC	904,198	1.383	1,250,505.830	
	BUNZL PLC	38,593	30.290	1,168,981.970	
	AVIVA PLC	348,683	4.430	1,544,665.690	
	CRODA INTERNATIONAL	16,782	68.420	1,148,224.440	
	DIAGEO PLC	282,974	35.200	9,960,684.800	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.970	548,519.020	
	DCC PLC	11,135	46.310	515,661.850	
	NATIONAL GRID PLC	460,569	10.545	4,856,700.100	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.771	624,561.230	
	BAE SYSTEMS PLC	379,623	8.654	3,285,257.440	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	262,877	31.110	8,178,103.470	
	HALMA PLC	51,066	22.200	1,133,665.200	
	NEXT PLC	18,751	67.120	1,258,567.120	
	IMPERIAL BRANDS PLC	107,889	20.220	2,181,515.580	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	22.320	445,864.320	
	ANGLO AMERICAN PLC	157,426	32.130	5,058,097.380	
	COMPASS GROUP PLC	220,935	18.965	4,190,032.270	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,488,738	6.092	15,161,391.890	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,179	2.547	1,880,141.910	
	UNILEVER PLC	316,686	42.665	13,511,408.190	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.535	954,144.410	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	19.100	808,904.100	
	PEARSON PLC	84,159	9.132	768,539.980	
	PERSIMMON PLC	35,252	14.095	496,876.940	
	PRUDENTIAL PLC	333,971	12.835	4,286,517.780	
	RIO TINTO PLC	140,839	60.180	8,475,691.020	
	VODAFONE GROUP PLC	3,220,482	0.972	3,130,308.500	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	88,653	57.400	5,088,682.200	
	RELX PLC	240,403	24.210	5,820,156.630	
	RENTOKIL INITIAL PLC	312,114	5.002	1,561,194.220	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.083	1,215,043.690	

NATWEST GROUP PLC	670,464	3.050	2,044,915.200	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	12.485	842,088.280	
SSE PLC	131,574	17.295	2,275,572.330	
BP PLC	2,347,086	5.601	13,146,028.680	
SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	7.610	980,875.730	
SMITHS GROUP PLC	51,695	17.720	916,035.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	119.100	1,064,277.600	
STANDARD CHARTERED PLC	319,802	7.216	2,307,691.230	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,477,863	0.537	4,552,612.430	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.193	679,846.550	
TESCO PLC	934,247	2.458	2,296,379.120	
3I GROUP PLC	124,751	16.415	2,047,787.660	
SMITH & NEPHEW PLC	107,679	11.515	1,239,923.680	
GSK PLC	499,550	14.700	7,343,385.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	41,494	76.580	3,177,610.520	
WPP PLC	142,785	9.848	1,406,146.680	
ASTRAZENECA PLC	193,029	115.180	22,233,080.220	
WHITBREAD PLC	25,470	30.580	778,872.600	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	44.230	1,030,957.070	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	24.050	1,256,107.450	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	55.640	1,210,281.280	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.644	507,904.460	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	22.230	474,054.750	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	42.220	696,165.580	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	17.515	323,239.320	
ABRDN PLC	285,831	2.140	611,678.340	
EXPERIAN PLC	112,709	29.690	3,346,330.210	
MONDI PLC	58,887	14.790	870,938.730	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	9.478	350,136.270	
OCADO GROUP PLC	69,766	6.202	432,688.730	
INFORMA PLC	186,195	6.638	1,235,962.410	
GLENCORE PLC	1,225,776	5.159	6,323,778.380	
ENTAIN PLC	74,451	13.200	982,753.200	
COCA-COLA HBC AG	21,338	20.380	434,868.440	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	6.320	544,929.360	
M&G PLC	270,401	2.003	541,613.200	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.783	449,636.940	
HALEON PLC	622,766	3.281	2,043,295.240	
SHELL PLC	905,972	25.605	23,197,413.060	
AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	6.050	670,539.650	
MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.415	689,397.900	
イギリス・ポンド 小計	35,143,594		237,063,952.260 (38,347,464,918)	

イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	30.280	4,442,166.840	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	29.640	5,345,366.520	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	5.480	1,576,996.040	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,662	579.900	2,123,593.800	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	143.600	1,805,626.400	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	17.900	2,916,697.600	
	ICL GROUP LTD	103,067	26.730	2,754,980.910	
	NICE LTD	7,640	772.000	5,898,080.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	114.300	1,993,392.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	214.200	1,000,742.400	
イスラエル・シュケル 小計		926,818		29,857,642.510 (1,126,561,695)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	63.840	1,388,775.360	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	437,712	23.860	10,443,808.320	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	210,104	22.180	4,660,106.720	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	4.140	1,999,019.700	
	ASX LTD	23,664	69.250	1,638,732.000	
	BHP GROUP LTD	631,300	47.720	30,125,636.000	
	AMPOL LTD	31,828	31.200	993,033.600	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	24.590	1,772,471.790	
	CSL LIMITED	60,103	307.750	18,496,698.250	
	REA GROUP LTD	6,134	122.170	749,390.780	
	TRANSURBAN GROUP	379,633	13.950	5,295,880.350	
	COCHLEAR LTD	7,836	209.080	1,638,350.880	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	7.060	1,505,396.740	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	211,229	109.250	23,076,768.250	
	RIO TINTO LIMITED	45,936	121.500	5,581,224.000	
	APA GROUP	164,300	10.700	1,758,010.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	36.040	2,763,367.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.820	1,357,620.480	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	30.400	1,847,316.800	
	IGO LTD	91,947	14.410	1,324,956.270	
	ORICA LTD	63,862	15.830	1,010,935.460	
	LEND LEASE CORP LTD	107,181	7.850	841,370.850	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	19.130	962,717.250	
	MACQUARIE GROUP LTD	46,642	191.660	8,939,405.720	
	SUNCORP GROUP LTD	154,162	12.650	1,950,149.300	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	392,866	31.610	12,418,494.260		
NEWCREST MINING LTD	112,815	24.750	2,792,171.250		

	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.450	726,650.550	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	13.290	2,292,352.230	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	12.020	1,629,647.560	
	REECE LTD	31,558	16.480	520,075.840	
	SANTOS LTD	417,358	7.110	2,967,415.380	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	28.680	1,513,558.320	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	28.560	742,131.600	
	WESFARMERS LTD	139,720	48.700	6,804,364.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	235,431	36.230	8,529,665.130	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	154,320	36.280	5,598,729.600	
	SEEK LTD	38,405	24.370	935,929.850	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	87.030	1,843,208.370	
	BRAMBLES LTD	170,929	11.900	2,034,055.100	
	PILBARA MINERALS LTD	327,947	4.850	1,590,542.950	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.340	744,315.660	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	14.330	1,135,408.890	
	XERO LTD	18,860	78.540	1,481,264.400	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	31.370	746,009.970	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.990	1,453,437.300	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	7.090	1,137,732.300	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	374,353	25.750	9,639,589.750	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.060	913,642.560	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	4.640	2,768,660.160	
	COLES GROUP LTD	171,684	18.030	3,095,462.520	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	56.480	837,203.040	
	オーストラリア・ドル 小計	8,727,527		209,012,860.410 (19,373,402,031)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	57,030	68.140	3,886,024.200	
	BARRICK GOLD CORP	214,835	23.780	5,108,776.300	
	BANK OF MONTREAL	82,585	135.210	11,166,317.850	
	BANK OF NOVA SCOTIA	149,435	73.950	11,050,718.250	
	NATIONAL BANK OF CANADA	40,967	100.910	4,133,979.970	
	BCE INC	7,697	61.150	470,671.550	
	BROOKFIELD CORP	177,131	48.770	8,638,678.870	
	SAPUTO INC	34,582	36.700	1,269,159.400	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	9.860	910,186.460	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	100.830	1,160,351.640	
	CGI INC	27,918	123.800	3,456,248.400	
	CCL INDUSTRIES INC	21,058	62.420	1,314,440.360	
	CAE INC	40,808	31.740	1,295,245.920	
	CAMECO CORP	54,264	38.890	2,110,326.960	

ROGERS COMM-CL B	45,607	65.490	2,986,802.430	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	114,514	62.460	7,152,544.440	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	140,703	80.350	11,305,486.050	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	163.900	1,003,723.600	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	36.610	597,841.300	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	73,233	159.520	11,682,128.160	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.460	856,794.980	
OPEN TEXT CORP	33,217	47.670	1,583,454.390	
EMPIRE CO LTD	29,433	36.640	1,078,425.120	
KINROSS GOLD CORP	219,914	5.530	1,216,124.420	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	85.370	1,134,225.820	
FORTIS INC	60,484	55.130	3,334,482.920	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	74,203	27.210	2,019,063.630	
TELUS CORP	31,890	27.380	873,148.200	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	35.910	1,228,409.280	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	70.660	1,925,202.360	
ENBRIDGE INC	251,728	53.060	13,356,687.680	
IGM FINANCIAL INC	12,478	42.290	527,694.620	
MANULIFE FINANCIAL CORP	233,861	26.110	6,106,110.710	
LOBLAW CO LTD	21,600	117.390	2,535,624.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	101,210	63.990	6,476,427.900	
MAGNA INTERNATIONAL INC	35,844	74.490	2,670,019.560	
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,884	68.160	5,172,253.440	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,799	872.250	2,441,427.750	
METRO INC	28,629	71.150	2,036,953.350	
EMERA INC	36,998	54.190	2,004,921.620	
ONEX CORP	10,157	66.900	679,503.300	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	22.010	425,299.230	
POWER CORP OF CANADA	65,500	35.660	2,335,730.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	31.910	548,692.450	
ROYAL BANK OF CANADA	171,947	138.850	23,874,840.950	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	116,363	106.350	12,375,205.050	
SHAW COMM INC-B	59,877	39.380	2,357,956.260	
SUNCOR ENERGY INC	171,898	46.380	7,972,629.240	
LUNDIN MINING CORP	68,762	8.970	616,795.140	
TECK RESOURCES LTD-CL B	57,326	56.360	3,230,893.360	
THOMSON REUTERS CORP	19,979	165.640	3,309,321.560	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	107.400	1,038,021.000	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	225,161	93.150	20,973,747.150	
TC ENERGY CORP	123,753	56.420	6,982,144.260	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	110.480	895,108.960		
WESTON (GEORGE) LTD	9,839	168.260	1,655,510.140		
INTACT FINANCIAL CORP	21,566	199.170	4,295,300.220		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	58,539	57.610	3,372,431.790		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,530	2,405.910	6,086,952.300		
FRANCO-NEVADA CORP NPR	23,163	181.500	4,204,084.500		
TOURMALINE OIL CORP	39,298	62.790	2,467,521.420		
KEYERA CORP	24,571	31.250	767,843.750		
PARKLAND CORP	15,665	30.230	473,552.950		
ALTAGAS LTD	33,833	24.920	843,118.360		
PEMBINA PIPELINE CORP	68,179	47.080	3,209,867.320		
DOLLARAMA INC	36,204	78.940	2,857,943.760		
CENOVUS ENERGY INC W/I	167,715	26.560	4,454,510.400		
ARC RESOURCES LTD	74,961	16.140	1,209,870.540		
NORTHLAND POWER INC	34,152	33.230	1,134,870.960		
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	19.100	978,741.300		
TMX GROUP LTD	7,040	136.680	962,227.200		
BRP INC	4,307	119.600	515,117.200		
IVANHOE MINES LTD	64,027	12.080	773,446.160		
NUTRIEN LTD	66,177	102.680	6,795,054.360		
TFI INTERNATIONAL INC	9,399	170.530	1,602,811.470		
WSP GLOBAL INC	15,681	171.900	2,695,563.900		
IA FINANCIAL CORP INC	12,011	83.950	1,008,323.450		
GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	41.960	1,157,130.920		
NUVEI CORP	7,929	43.800	347,290.200		
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	39.810	641,060.430		
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	42,501	47.360	2,012,847.360		
AIR CANADA	18,814	22.720	427,454.080		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	35,384	88.790	3,141,745.360		
SHOPIFY INC	146,823	66.820	9,810,712.860		
FIRSTSERVICE CORP	5,237	194.620	1,019,224.940		
HYDRO ONE LTD	46,225	36.180	1,672,420.500		
カナダ・ドル 小計	5,086,966		309,487,541.870 (30,800,200,167)		
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.640	524,888.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	224,810	35.060	7,881,838.600	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	8.130	320,322.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.510	441,905.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.180	916,164.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	1.020	776,416.860	

	KEPPEL CORP LTD	184,900	7.070	1,307,243.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	398,198	12.970	5,164,628.060	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.500	2,358,325.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.870	955,049.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	139,966	30.260	4,235,371.160	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.910	301,276.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	18.520	811,176.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.980	1,028,830.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.850	1,180,371.500	
	シンガポール・ドル 小計	3,766,487		28,203,804.180 (2,820,098,380)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	451,599	2.783	1,256,800.010	
	LOGITECH INTL-REG	23,734	53.540	1,270,718.360	
	NESTLE SA-REGISTERED	341,882	111.300	38,051,466.600	
	CIE FINANC RICHEMONT	64,458	142.500	9,185,265.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	87,221	278.400	24,282,326.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,236	200.500	1,049,818.000	
	SIKA INHABER	17,793	256.400	4,562,125.200	
	SGS SA-REG	748	2,178.000	1,629,144.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	269,394	80.420	21,664,665.480	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	151.900	862,032.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,926.000	885,960.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	15.790	332,726.880	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	569.600	1,954,297.600	
	ABB LTD	194,538	31.110	6,052,077.180	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	34.570	685,937.940	
	GEBERIT AG	4,377	517.200	2,263,784.400	
	LONZA GROUP AG-REG	9,027	546.800	4,935,963.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	10,200.000	1,397,400.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	103,100.000	1,340,300.000	
	GIVAUDAN-REG	1,173	2,877.000	3,374,721.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18,771	438.200	8,225,452.200	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,612	302.200	1,091,546.400	
	HOLCIM LTD	66,607	55.760	3,714,006.320	
	TEMENOS GROUP	7,082	69.940	495,315.080	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	89.450	417,999.850	
	SONOVA HOLDING AG	6,984	229.300	1,601,431.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	244.400	1,683,182.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	14,531	128.700	1,870,139.700	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	325.000	1,017,250.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	59.500	550,910.500	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	191.800	521,696.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,978	548.800	2,183,126.400	

	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	84.050	412,097.150	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	710.500	575,505.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	81.300	680,643.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,852	931.000	2,655,212.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	61.020	1,588,411.620	
	SWISS RE LTD	38,139	95.240	3,632,358.360	
	BKW AG	3,194	131.200	419,052.800	
	SIG GROUP AG	38,322	22.040	844,616.880	
	ALCON INC	61,285	69.240	4,243,373.400	
	UBS GROUP AG	418,921	20.250	8,483,150.250	
	VAT GROUP AG	3,325	287.600	956,270.000	
スイス・フラン	小計	2,276,198		174,900,277.660 (25,196,134,000)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	334,122	126.100	42,132,784.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	194,204	111.060	21,568,296.240	
	ERICSSON LM-B SHS	366,551	59.960	21,978,397.960	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	238.600	6,145,143.000	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	208.500	12,184,114.500	
	LUNDBERGS B	7,859	494.600	3,887,061.400	
	SKF AB-B SHS	46,594	199.400	9,290,843.600	
	SANDVIK AB	133,350	215.500	28,736,925.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	195,837	124.950	24,469,833.150	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	191.750	8,424,919.750	
	SWEDBANK AB	112,296	203.600	22,863,465.600	
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	70,211	152.050	10,675,582.550	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	105.750	19,510,769.250	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	214.600	5,192,890.800	
	VOLVO AB-B SHS	191,625	205.350	39,350,193.750	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	434.300	4,404,670.600	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	93.500	6,022,896.000	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	287.000	4,388,804.000	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	285.900	6,096,817.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	127.340	3,426,337.380	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	92.640	7,048,514.400	
	INVESTOR AB-B SHS	226,392	203.850	46,150,009.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	127.740	10,511,341.380	
	ASSA ABLOY AB-B	124,612	254.700	31,738,676.400	
	TELIA CO AB	344,810	26.370	9,092,639.700	
	BOLIDEN AB	36,260	439.500	15,936,270.000	
	ALFA LAVAL AB	35,313	345.400	12,197,110.200	
	KINNEVIK AB-B	36,278	163.150	5,918,755.700	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	57.750	4,212,400.500	
	INDUTRADE AB	39,178	235.900	9,242,090.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	90.580	4,326,916.020	

	NIBE INDUSTRIER AB	185,845	115.150	21,400,051.750	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	243.000	4,466,340.000	
	HEXAGON AB-B SHS	248,163	119.000	29,531,397.000	
	SAGAX AB	28,022	270.400	7,577,148.800	
	EPIROC AB-A	84,563	204.600	17,301,589.800	
	EPIROC AB-B	41,205	177.000	7,293,285.000	
	ESSITY AB-B	75,180	278.100	20,907,558.000	
	EQT AB	40,716	245.800	10,007,992.800	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	50.340	4,016,678.940	
	VOLVO CAR AB	63,710	49.400	3,147,274.000	
	LIFCO AB	26,835	217.100	5,825,878.500	
	EVOLUTION AB	22,326	1,328.000	29,648,928.000	
	NORDEA BANK ABP	420,356	125.560	52,779,899.360	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	235.100	3,653,218.900	
スウェーデン・クローナ 小計		4,600,114		674,682,710.780 (8,656,179,179)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	988.800	12,408,451.200	
	A P MOLLER A/S	663	15,425.000	10,226,775.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	15,220.000	5,463,980.000	
	DANSKE BANK A/S	85,371	147.900	12,626,370.900	
	GENMAB A/S	7,926	2,736.000	21,685,536.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	346.200	8,259,985.800	
	ROCKWOOL AS	873	1,712.500	1,495,012.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	206,349	994.000	205,110,906.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	125,436	208.200	26,115,775.200	
	COLOPLAST-B	15,343	806.800	12,378,732.400	
	DSV A/S	23,842	1,279.500	30,505,839.000	
	DEMANT A/S	11,367	214.800	2,441,631.600	
	TRYG A/S	44,887	157.850	7,085,412.950	
	PANDORA A/S	12,473	633.600	7,902,892.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	494.500	6,200,041.000	
	ORSTED A/S	23,240	625.900	14,545,916.000	
デンマーク・クローネ 小計		607,075		384,453,258.350 (7,358,435,365)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.530	1,401,828.730	
	FISHER & PAYKEL	78,460	25.600	2,008,576.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.300	1,160,901.400	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.330	397,739.220	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	5.360	708,361.520	
ニュージーランド・ドル 小計		656,830		5,677,406.870 (477,242,821)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	177.300	9,995,287.500	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	76.800	12,516,172.800	
	TELENOR ASA	85,954	115.150	9,897,603.100	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	414.600	4,637,301.000	
	ORKLA ASA	116,068	69.440	8,059,761.920	
	EQUINOR ASA	115,617	328.150	37,939,718.550	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	461.500	9,153,391.000	
	AKER BP ASA	38,723	294.600	11,407,795.800	
	SALMAR ASA	7,248	449.000	3,254,352.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	184.300	4,740,380.300	
	ADEVINTA ASA	24,382	88.450	2,156,587.900	
	DNB BANK ASA	119,319	193.500	23,088,226.500	
	ノルウェー・クローネ 小計	783,397		136,846,578.370 (1,794,058,642)	
ユーロ	CRH PLC	90,748	43.710	3,966,595.080	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	145.000	2,893,185.000	
	KERRY GROUP PLC-A	20,761	85.100	1,766,761.100	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	59.840	1,044,267.840	
	UMICORE	24,290	32.160	781,166.400	
	AIR LIQUIDE	65,317	144.440	9,434,387.480	
	AIRBUS SE	73,377	115.980	8,510,264.460	
	AXA SA	228,092	28.220	6,436,756.240	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	83,720	28.060	2,349,183.200	
	ADIDAS AG	21,974	138.820	3,050,430.680	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	18.250	2,639,187.250	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	159.700	498,264.000	
	DANONE	79,150	50.670	4,010,530.500	
	SAFRAN SA	42,557	129.760	5,522,196.320	
	INTESA SANPAOLO	2,050,973	2.502	5,131,534.440	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	41,577	97.740	4,063,735.980	
	ACCOR SA	18,305	30.130	551,529.650	
	BOUYGUES	29,123	30.860	898,735.780	
	BNP PARIBAS	139,023	64.380	8,950,300.740	
	THALES SA	12,886	127.450	1,642,320.700	
	CAPGEMINI SA	19,839	184.950	3,669,223.050	
	UNICREDIT SPA	241,149	18.926	4,563,985.970	
	D'IETEREN TRDG	2,736	182.100	498,225.600	
	KONINKLIJKE DSM NV	22,201	118.500	2,630,818.500	
	COMMERZBANK AG	141,036	10.075	1,420,937.700	
	EIFFAGE	11,784	102.950	1,213,162.800	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	28.300	1,385,228.400	
	UNITED INTERNET	10,010	19.665	196,846.650	
	PUBLICIS GROUPE	29,405	74.940	2,203,610.700	
	IBERDROLA SA	779,592	10.750	8,380,614.000	
	ENI SPA	315,196	14.826	4,673,095.890	
	JERONIMO MARTINS	34,644	19.370	671,054.280	
	KESKO OYJ-B	35,252	20.340	717,025.680	
	KBC GROUPE	32,213	70.760	2,279,391.880	
	HANNOVER RUECK SE	7,105	179.300	1,273,926.500	

WARTSILA OYJ	50,956	9.430	480,515.080	
L'OREAL	30,122	387.750	11,679,805.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	34,454	810.500	27,924,967.000	
GEA GROUP AG	17,490	41.210	720,762.900	
BOLLORE	114,808	5.105	586,094.840	
MEDIOBANCA SPA	86,792	10.410	903,504.720	
MICHELIN(CGDE)-B	86,908	29.445	2,559,006.060	
CONTINENTAL AG	12,921	68.360	883,279.560	
DEUTSCHE POST AG-REG	124,772	41.020	5,118,147.440	
OMV AG	17,258	47.000	811,126.000	
VERBUND AG	7,320	77.900	570,228.000	
PERNOD-RICARD	24,888	187.150	4,657,789.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	55.260	931,352.040	
RENAULT SA	27,902	42.100	1,174,674.200	
REPSOL SA	178,713	15.425	2,756,648.020	
REMY COINTREAU	2,866	165.100	473,176.600	
MERCK KGAA	16,230	188.000	3,051,240.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	61,460	52.780	3,243,858.800	
RWE AG	77,853	39.440	3,070,522.320	
SEB SA	2,596	97.200	252,331.200	
SOCIETE GENERALE-A	100,409	26.510	2,661,842.590	
VINCI S.A.	66,767	107.620	7,185,464.540	
SODEXO	9,822	86.140	846,067.080	
SOFINA	2,281	232.800	531,016.800	
SOLVAY SA	9,070	108.000	979,560.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67,865	151.480	10,280,190.200	
VIVENDI SE	98,944	9.758	965,495.550	
SAP SE	130,068	109.900	14,294,473.200	
TELEFONICA S.A	664,975	3.662	2,435,138.450	
TOTALENERGIES SE	310,090	59.980	18,599,198.200	
VALEO	26,570	20.650	548,670.500	
E.ON SE	280,287	10.035	2,812,680.040	
VOEST-ALPINE AG	10,593	33.200	351,687.600	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	63.650	851,382.400	
SIEMENS AG-REG	95,329	145.020	13,824,611.580	
UPM-KYMMENE OYJ	67,758	34.870	2,362,721.460	
ING GROEP NV-CVA	470,718	13.056	6,145,694.200	
PUMA AG	16,210	61.000	988,810.000	
BAYER AG	121,329	60.460	7,335,551.340	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	13.875	1,040,070.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	66.980	1,315,755.120	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	99,529	71.480	7,114,332.920	
BASF SE	116,408	51.060	5,943,792.480	
BEIERSDORF AG	12,940	112.950	1,461,573.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	20,809	62.860	1,308,053.740	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	37.350	890,984.250	
ASM INTERNATIONAL NV	5,978	324.550	1,940,159.900	
ORANGE	255,481	9.925	2,535,648.920	
SAMPO OYJ-A SHS	58,396	45.330	2,647,090.680	
RANDSTAD NV	15,584	59.160	921,949.440	
ALLIANZ SE	50,940	220.150	11,214,441.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.621	1,469,274.670	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	125,884	27.480	3,459,292.320	
HERMES INTL	3,916	1,712.500	6,706,150.000	
ENDESA S.A.	37,701	18.495	697,279.990	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	9.638	697,232.190	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	35.780	1,634,645.080	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	17,612	324.900	5,722,138.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	66,878	27.845	1,862,217.910	
DASSAULT SYSTEMES SA	81,900	37.860	3,100,734.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	27.380	645,373.980	
RHEINMETALL STAMM	5,596	236.700	1,324,573.200	
HEINEKEN NV	32,026	91.220	2,921,411.720	
AKZO NOBEL	22,627	69.180	1,565,335.860	
ASML HOLDING NV	50,605	621.100	31,430,765.500	
AEGON NV	232,433	5.144	1,195,635.350	
VOLKSWAGEN AG	3,315	167.950	556,754.250	
VOLKSWAGEN AG PFD	22,269	130.200	2,899,423.800	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	735,118	6.875	5,053,936.250	
KERING	9,382	561.400	5,267,054.800	
ACCIONA S.A.	2,642	185.500	490,091.000	
FORTUM OYJ	54,194	14.450	783,103.300	
AGEAS	18,136	43.710	792,724.560	
UCB SA	16,732	77.660	1,299,407.120	
NEMETSCHEK SE	9,878	51.360	507,334.080	
CARREFOUR SA	75,572	16.420	1,240,892.240	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.290	464,728.330	
NOKIA OYJ	679,569	4.363	2,964,959.540	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115,512	15.842	1,829,941.100	
WOLTERS KLUWER-CVA	32,047	102.350	3,280,010.450	
SANOFI	142,461	88.110	12,552,238.710	
STMICROELECTRONICS NV	86,919	45.605	3,963,940.990	
ELISA OYJ	20,242	53.080	1,074,445.360	
BANCO SANTANDER SA	2,066,857	3.500	7,233,999.500	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	16.205	794,223.250	
QIAGEN N.V.	27,412	45.240	1,240,118.880	
DEUTSCHE BANK AG-REG	253,716	11.552	2,930,927.230	
BMW VORZUG	7,821	89.900	703,107.900	

ENEL SPA	1,019,343	5.380	5,484,065.340	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	403,392	20.510	8,273,569.920	
SARTORIUS AG	2,847	439.700	1,251,825.900	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	19.900	219,536.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	159,023	35.840	5,699,384.320	
RATIONAL AG	516	616.500	318,114.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	133.450	649,367.700	
BECHTLE AG	8,139	40.410	328,896.990	
KONINKLIJKE KPN NV	475,739	3.153	1,500,005.060	
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	67.500	1,203,120.000	
TELEPERFORMANCE	7,845	257.600	2,020,872.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	23,884	171.200	4,088,940.800	
EURAZEO	5,673	64.550	366,192.150	
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	79.220	896,611.960	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	76.600	831,339.800	
INDITEX	136,321	28.290	3,856,521.090	
ESSILORLUXOTTICA	35,682	171.400	6,115,894.800	
SNAM SPA	256,415	4.799	1,230,535.580	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	11.564	1,661,978.080	
ENAGAS	38,270	16.865	645,423.550	
WENDEL	5,449	100.300	546,534.700	
TENARIS SA	55,855	16.195	904,571.720	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.296	268,852.650	
TERNA SPA	166,064	7.378	1,225,220.190	
BIOMERIEUX	4,870	96.580	470,344.600	
GRIFOLS SA	31,982	13.550	433,356.100	
FERROVIAL SA	63,513	27.450	1,743,431.850	
NESTE OYJ	50,599	46.300	2,342,733.700	
RECORDATI SPA	10,908	41.050	447,773.400	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	10.275	593,638.120	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	218.000	1,590,092.000	
KONE OYJ	43,814	49.050	2,149,076.700	
ELIA GROUP	4,078	130.100	530,547.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	342.700	1,065,454.300	
ENGIE	221,751	13.240	2,935,983.240	
ALSTOM	37,007	26.900	995,488.300	
IPSEN SA	3,873	105.400	408,214.200	
ARKEMA SA	6,392	91.300	583,589.600	
LEGRAND SA	32,783	87.180	2,858,021.940	
AMPLIFON SPA	12,300	27.340	336,282.000	
ADP	3,975	143.750	571,406.250	
ORION OYJ	13,559	46.680	632,934.120	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	11.500	683,169.000	
SYMRISE AG	17,265	95.420	1,647,426.300	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	36.770	1,192,156.940	
PRYSMIAN SPA	30,728	37.070	1,139,086.960	

DIASORIN ITALIA SPA	2,429	118.100	286,864.900	
CAIXABANK	566,059	3.999	2,263,669.940	
BUREAU VERITAS SA	39,729	25.930	1,030,172.970	
GETLINK	63,509	16.620	1,055,519.580	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	19.300	765,978.400	
AMADEUS IT GROUP SA	54,712	59.000	3,228,008.000	
BRENNTAG SE	17,934	70.680	1,267,575.120	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	20.100	496,208.700	
EDENRED	31,091	51.240	1,593,102.840	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.773	292,479.400	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	71.680	588,421.120	
VONOVIA SE	85,937	25.910	2,226,627.670	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	9.884	1,329,763.700	
KNORR-BREMSE AG	10,342	62.860	650,098.120	
OCI NV	12,329	29.200	360,006.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34,318	51.180	1,756,395.240	
FERRARI NV	15,435	245.700	3,792,379.500	
CNH INDUSTRIAL NV	124,604	15.130	1,885,258.520	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.580	292,120.500	
AIB GROUP PLC	147,578	3.936	580,867.000	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	38.480	665,434.640	
MONCLER SPA	25,014	56.700	1,418,293.800	
NEXI SPA	83,576	7.800	651,892.800	
PROSUS NV	102,526	74.310	7,618,707.060	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	114.200	1,732,870.800	
JDE PEET'S BV	14,385	27.460	395,012.100	
EXOR NV	14,142	75.860	1,072,812.120	
SIEMENS ENERGY AG	59,014	19.000	1,121,266.000	
EURONEXT NV	10,081	77.000	776,237.000	
IMCD NV	6,823	151.200	1,031,637.600	
WORLDLINE SA	29,916	40.450	1,210,102.200	
NN GROUP NV	36,289	39.950	1,449,745.550	
FINECOBANK SPA	75,180	16.630	1,250,243.400	
ARGENX SE	6,753	349.200	2,358,147.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	92,502	22.660	2,096,095.320	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,693	31.045	1,760,034.180	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	37.260	365,967.720	
ZALANDO SE	31,321	39.630	1,241,251.230	
STELLANTIS NV	280,695	15.576	4,372,105.320	
AENA SME SA	9,989	140.750	1,405,951.750	
CELLNEX TELECOM SAU	69,572	38.500	2,678,522.000	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	21.030	476,750.100	
ABN AMRO BANK NV	52,835	16.155	853,549.420	
SCOUT24 SE	10,048	52.340	525,912.320	
COVESTRO AG	27,558	41.640	1,147,515.120	

	HELLOFRESH SE	17,856	21.710	387,653.760	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	105,327	54.710	5,762,440.170	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	10.190	600,078.910	
	AMUNDI SA	10,436	63.400	661,642.400	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.520	440,567.080	
	ADYEN NV	2,593	1,369.200	3,550,335.600	
	DELIVERY HERO SE	22,564	42.000	947,688.000	
ユーロ 小計		22,540,483		589,162,603.920 (84,026,370,571)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	15.800	4,060,600.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	57.700	11,383,979.200	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	44.000	4,105,816.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	151,891	337.200	51,217,645.200	
	MTR CORP	192,441	41.500	7,986,301.500	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	125.500	11,934,548.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	28.250	4,829,959.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	43.650	6,605,118.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	7.720	11,861,054.320	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	53.600	13,984,454.400	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	26.500	11,129,867.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	22.350	3,868,025.100	
	SINO LAND CO	411,200	10.460	4,301,152.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	180,565	111.700	20,169,110.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	66.550	3,528,481.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	180,156	107.200	19,312,723.200	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	15.940	2,837,320.000	
	AIA GROUP LTD	1,493,316	86.300	128,873,170.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.700	4,955,555.200	
	SANDS CHINA LTD	335,800	29.100	9,771,780.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	17.180	2,405,200.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	21.450	4,324,320.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	43.600	8,551,486.000	
	ESR GROUP LTD	216,400	15.160	3,280,624.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.200	1,281,800.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	23.700	6,280,500.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.710	4,387,365.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	49.250	15,289,416.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	51.350	13,669,113.250	
香港・ドル	小計	9,768,669		396,186,485.420 (6,703,475,333)	
合計		137,255,007		817,729,794,487 (817,729,794,487)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年2月15日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,393,906.500		
		GOODMAN GROUP	214,602.000	4,268,433.780		
		GPT GROUP	219,223.000	1,008,425.800		
		MIRVAC GROUP	432,802.000	960,820.440		
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,922,175.090		
		STOCKLAND	259,328.000	1,011,379.200		
		VICINITY CENTRES	545,645.000	1,096,746.450		
		オーストラリア・ドル 小計		2,482,786.000	11,661,887.260 (1,080,940,330)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,542,972.760		
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,225,084.840		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	787,006.000		
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	701,515.000		
		シンガポール・ドル 小計		2,107,509.000	4,256,578.600 (425,615,294)	
	投資信託受益証券	合計		4,590,295	1,506,555,624 (1,506,555,624)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,835.000	3,109,281.800		
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,443,718.710		
		AMERICAN TOWER CORP	58,087.000	12,497,418.050		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,280,738.030		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,932.000	3,049,114.560		
		BOSTON PROPERTIES INC	18,531.000	1,340,532.540		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,622,379.750		
		CROWN CASTLE INC	54,164.000	7,530,962.560		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	36,258.000	4,090,990.140		
		EQUINIX INC	11,399.000	8,303,259.580		
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,468,846.200		
		EQUITY RESIDENTIAL	46,054.000	3,053,380.200		
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,345.000	1,993,036.350		
EXTRA SPACE STORAGE INC	16,256.000	2,600,309.760				

	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,600,753.050	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	870,724.050	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,971.000	1,789,107.740	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,700,627.810	
	INVITATION HOMES INC	76,646.000	2,533,916.760	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,835,799.660	
	KIMCO REALTY	79,991.000	1,713,407.220	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	875,156.700	
	MID AMERICA	13,578.000	2,320,072.860	
	PROLOGIS INC	115,173.000	14,711,047.290	
	PUBLIC STORAGE	19,317.000	5,812,098.960	
	REALTY INCOME CORP	76,685.000	5,038,971.350	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,269,698.250	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	13,584.000	3,901,596.480	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	40,894.000	5,128,516.540	
	SUN COMMUNITIES INC	14,694.000	2,335,170.480	
	UDR INC	41,516.000	1,853,689.400	
	VENTAS INC	48,092.000	2,444,997.280	
	VICI PROPERTIES INC	120,602.000	4,122,176.360	
	WELLTOWER INC	58,944.000	4,465,008.000	
	WEYERHAEUSER CO	89,893.000	2,945,793.610	
	WP CAREY INC	23,664.000	1,982,806.560	
アメリカ・ドル	小計	1,612,427.000	124,635,104.640 (16,550,295,545)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	533,259.940	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	541,802.570	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,370,502.460	
イギリス・ポンド	小計	361,284.000	2,445,564.970 (395,594,590)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	431,913.440	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	320,357.040	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	752,270.480 (74,865,958)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	323,717.400	
	GECINA SA	5,045.000	556,463.500	
	KLEPIERRE	25,279.000	607,959.950	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	822,251.250	
	WAREHOUSES DE PAUW	27,206.000	806,385.840	
ユーロ	小計	76,131.000	3,116,777.940 (444,514,870)	
香港・ドル	LINK REIT	262,516.000	14,175,864.000	
香港・ドル	小計	262,516.000	14,175,864.000	

			(239,855,619)	
投資証券 合計		2,335,504	17,705,126,582 (17,705,126,582)	
合計			19,211,682,206 (19,211,682,206)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 601銘柄	69.03	-	-	72.60
	投資証券 36銘柄	-	-	1.93	
イギリス・ポンド	株式 77銘柄	4.48	-	-	4.63
	投資証券 3銘柄	-	-	0.05	
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.13	-	-	0.13
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	2.26	-	-	2.44
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.60	-	-	3.69
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 15銘柄	0.33	-	-	0.39
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 43銘柄	2.94	-	-	3.01
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	1.01	-	-	1.03
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.86	-	-	0.88
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.06	-	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.21	-	-	0.21
ユーロ	株式 221銘柄	9.81	-	-	10.09
	投資証券 5銘柄	-	-	0.05	
香港・ドル	株式 29銘柄	0.78	-	-	0.83
	投資証券 1銘柄	-	-	0.03	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年2月28日現在

資産総額	343,732,621,657円
負債総額	1,004,743,069円
純資産総額(-)	342,727,878,588円
発行済数量	55,838,634,060口
1口当たり純資産額(/)	6.1378円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年2月28日現在

資産総額	852,772,726,215円
負債総額	462,479,416円
純資産総額(-)	852,310,246,799円
発行済数量	137,436,860,211口
1口当たり純資産額(/)	6.2015円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2023年2月28日現在)

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2023年2月28日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年2月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,441,537,402,941
追加型株式投資信託	798	14,568,229,430,009
単位型公社債投資信託	24	45,836,053,530
単位型株式投資信託	214	1,111,365,351,083
合計	1,062	17,166,968,237,563

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第37期事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第38期中間会計期間(自2022年4月1日至2022年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	36,734	31,421
金銭の信託	25,670	30,332
未収委託者報酬	16,804	17,567
未収運用受託報酬	5,814	4,348
未収投資助言報酬	317	309
未収収益	7	5
前払費用	724	1,167
その他	2,419	2,673
流動資産計	88,493	87,826
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 915	1 1,109
器具備品	1 202	1 158
建設仮勘定	0	-
無形固定資産		
ソフトウェア	2,878	3,107
ソフトウェア仮勘定	1,109	1,449
電話加入権	3	3
投資その他の資産		
投資有価証券	261	241
関係会社株式	5,299	5,349
長期差入保証金	1,324	1,102
繰延税金資産	3,676	3,092
その他	591	367
固定資産計	16,264	15,983
資産合計	104,757	103,810

(単位:百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

(単位:百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		1	559
時効成立分配金・償還金	0		0	
為替差益	7		7	
金銭の信託運用益	1,229		-	
雑収入	13		19	
時効後支払損引当金戻入額	13		10	
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0		-	
金銭の信託運用損	-		743	
早期割増退職金	48		20	
雑損失	0		-	
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	-		0	
特別利益計		-		0
特別損失				
固定資産除却損	1		5	
投資有価証券売却損	-		6	
ゴルフ会員権売却損	-		3	
オフィス再編費用	-		2	509
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

(3) 【株主資本等変動計算書】

第36期(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	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,871	49,674	71,227
当期変動額									
剰余金の配当							12,000	12,000	12,000
当期純利益							14,125	14,125	14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125	2,125	2,125
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353

	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	0	0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	0	0	73,353

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	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	0	0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	4,219
当期末残高	0	0	77,573

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 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) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

(会計上の見積りの変更)

第37期

(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

当社は、当事業年度において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万円減少しております。

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識に関する会計基準」(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。)等を当会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

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

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

(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」(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法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

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
建物	407	415
器具備品	978	966

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
受取配当金	-	543

2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

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

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

第37期(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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当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16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	25,670	25,670	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,672	25,672	-

第37期(2022年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	36,734	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	85,024	1	-	-

第37期(2022年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第36期(2021年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

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

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額239百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

区分	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)
投資信託	0	-	0

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

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

区分	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)
株式	13	-	6

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (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	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	4	14
退職給付の支払額	245	185
過去勤務費用の発生額	1	-
その他	1	-
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

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

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	84	35
未認識過去勤務費用	102	33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	7	3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.76%	1.00% ~ 3.76%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度97百万円であります。

(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の内訳

	第36期	第37期
	(2021年3月31日現在)	(2022年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額(一括償却資産)	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額(税法上)	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	3,676	3,092
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,676	3,092

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224百万円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b. 負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

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

のれん	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

(2) 損益計算書項目

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,823百万円	8,429百万円
経常利益	8,823百万円	8,429百万円
税引前当期純利益	8,823百万円	8,429百万円
当期純利益	7,288百万円	7,015百万円
1株当たり当期純利益	182,220円85銭	175,380円68銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬(注)	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

(注) 成功報酬は、損益計算書において委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)及び第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (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 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435	未払 手数料	1,457
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	12,767	未払 手数料	2,524

第37期(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 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (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 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	7,789	未払 手数料	1,592
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,373	未払 手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
 (東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36銭

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

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

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,934
金銭の信託		29,712
未収委託者報酬		17,398
未収運用受託報酬		3,150
未収投資助言報酬		291
未収収益		16
前払費用		939
その他		2,564
	流動資産計	82,009
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,055
器具備品	1	138
リース資産	1	8
無形固定資産		
ソフトウェア		3,151
ソフトウェア仮勘定		1,794
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		182
関係会社株式		5,810
長期差入保証金		779
繰延税金資産		2,962
その他		411
	固定資産計	16,298
資産合計		98,307

(単位:百万円)

	第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	959
リース債務	1
未払金	7,709
未払収益分配金	0
未払手数料	7,486
その他未払金	221
未払費用	9,245
未払法人税等	2,605
未払消費税等	719
契約負債	20
賞与引当金	866
役員賞与引当金	26
流動負債計	22,155
固定負債	
リース債務	7
退職給付引当金	2,600
時効後支払損引当金	108
固定負債計	2,716
負債合計	24,871
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	51,882
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,759
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,079
株主資本計	73,435
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等計	0
純資産合計	73,435
負債・純資産合計	98,307

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	48,925	
運用受託報酬	7,371	
投資助言報酬	1,029	
その他営業収益	11	
		営業収益計 57,336
営業費用		
支払手数料	20,939	
広告宣伝費	102	
公告費	0	
調査費	16,544	
調査費	5,756	
委託調査費	10,787	
委託計算費	277	
営業雑経費	371	
通信費	17	
印刷費	249	
協会費	34	
諸会費	20	
支払販売手数料	49	
		営業費用計 38,235
一般管理費		
給料	4,691	
役員報酬	81	
給料・手当	4,561	
賞与	49	
交際費	4	
寄付金	4	
旅費交通費	48	
租税公課	243	
不動産賃借料	504	
退職給付費用	235	
固定資産減価償却費	1 655	
福利厚生費	26	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	866	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	2,103	
事務用消耗品費	18	
器具備品費	0	
諸経費	159	
		一般管理費計 9,590
営業利益		9,510

（単位：百万円）

	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	6	
受取配当金	2,400	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	25	
為替差益	28	
雑収入	2	
		営業外収益計 2,463
営業外費用		
金銭の信託運用損	530	
早期割増退職金	3	
雑損失	28	
		営業外費用計 561
経常利益		11,411
特別利益		
投資有価証券売却益	4	
		特別利益計 4
特別損失		
固定資産除却損	12	
投資有価証券売却損	9	
関係会社株式評価損	584	
		特別損失計 605
税引前中間純利益		10,809
法人税、住民税及び事業税		2,457
法人税等調整額		129
法人税等合計		2,587
中間純利益		8,222

(3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間(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			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,360
中間純利益							8,222
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	-	-	-	-	-	-	4,137
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	56,020	77,573	0	0	77,573
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,360	12,360			12,360
中間純利益	8,222	8,222			8,222
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,137	4,137	0	0	4,137
当中間期末残高	51,882	73,435	0	0	73,435

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 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) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。</p>

（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」（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り扱いに従って、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しております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当中間財務諸表への影響はありません。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第38期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	469百万円
	器具備品	...	975百万円
	リース資産	...	0百万円

（中間損益計算書関係）

項目	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	74百万円
	無形固定資産	...	580百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（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

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類 株式				

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

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末(2022年9月30日現在)

1.金融商品の時価等に関する事項

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	29,712	29,712	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,714	29,714	-

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

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価(百万円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	29,712	-	29,712
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,714	-	29,714

(注1)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

(注2)市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	180
関係会社株式	
非上場株式	5,810

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末
(2022年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,810百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額180百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

(持分法損益等)

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2022年4月1日から2022年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	72,873百万円
資産合計	72,873百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	4,223百万円
負債合計	4,223百万円
純資産	68,650百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額53,357百万円及び顧客関連資産の金額23,061百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,019百万円
経常利益	4,019百万円
税引前中間純利益	4,019百万円
中間純利益	3,372百万円
1株当たり中間純利益	84,308円98銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,114百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第38期中間会計期間
(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

委託者報酬	48,925百万円
運用受託報酬	7,338百万円
投資助言報酬	1,029百万円
成功報酬(注)	32百万円
その他営業収益	11百万円
合計	57,336百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,835,889円89銭
1株当たり中間純利益金額	205,562円11銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益金額	8,222百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,222百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社(以下「PPAM」といいます。)の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

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

(注) 資本金の額は2022年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2022年5月13日	有価証券報告書
2022年5月13日	有価証券届出書
2022年11月15日	半期報告書
2022年11月15日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2022年5月26日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の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及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年4月14日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>の2022年2月16日から2023年2月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>の2023年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月24日

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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、アセットマネジメントOne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及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。