

【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】 2024年1月12日提出
【計算期間】 第15期(自 2022年10月13日 至 2023年10月12日)
【ファンド名】 D I A M外国株式パッシブ・ファンド
【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、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

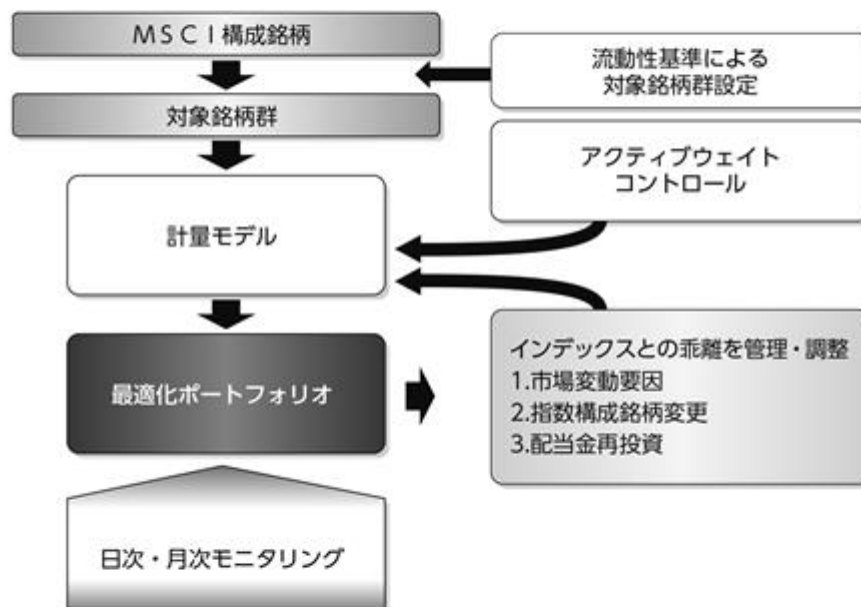
当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。

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）」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



3 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

4 実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日。))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

指数の著作権等

本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。

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

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

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

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	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信		不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

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

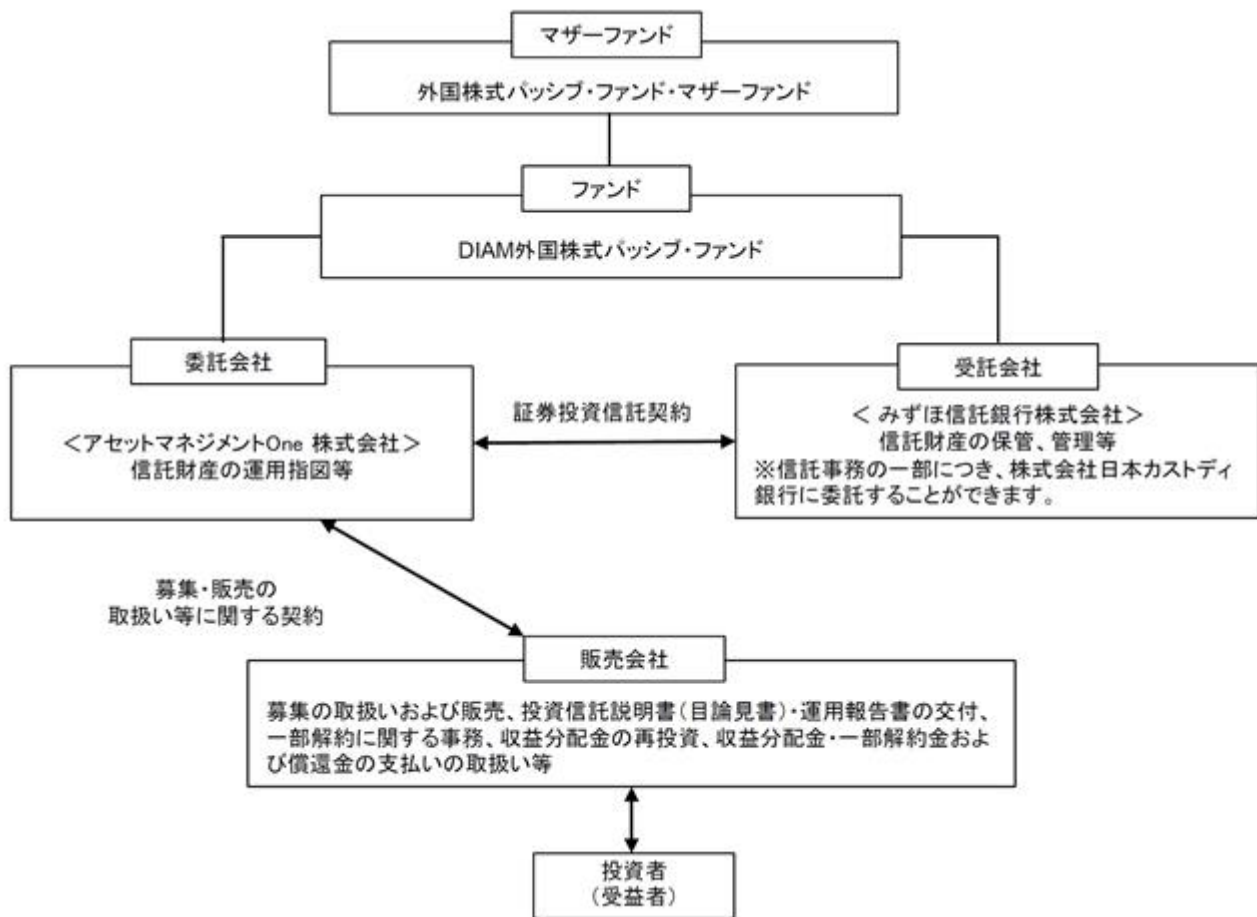
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2009年1月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2021年1月13日 信託報酬率(税抜)を「年率0.50%」から「年率0.35%」に引き下げ

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンド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

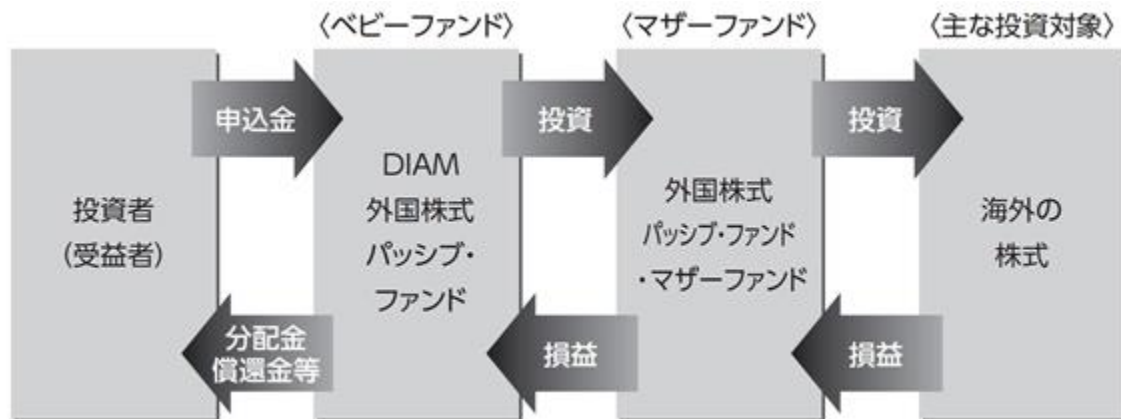
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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10月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「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10月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²

第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²
------------------	--------------------	---------	--------------------

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

この投資信託は、「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ます。

<投資態度>

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

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

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16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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22条、第23条および第24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. 運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された外国株式パッシブ・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) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証書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) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
- 8) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 9) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 10) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)
および新株予約権証券
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)~12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- 15) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 17) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- 18) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 19) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 20) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- 21) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 23) 外国の者に対する権利で上記22)の有価証券の性質を有するもの

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

3. 運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、上記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の指図をすることができます。

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

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

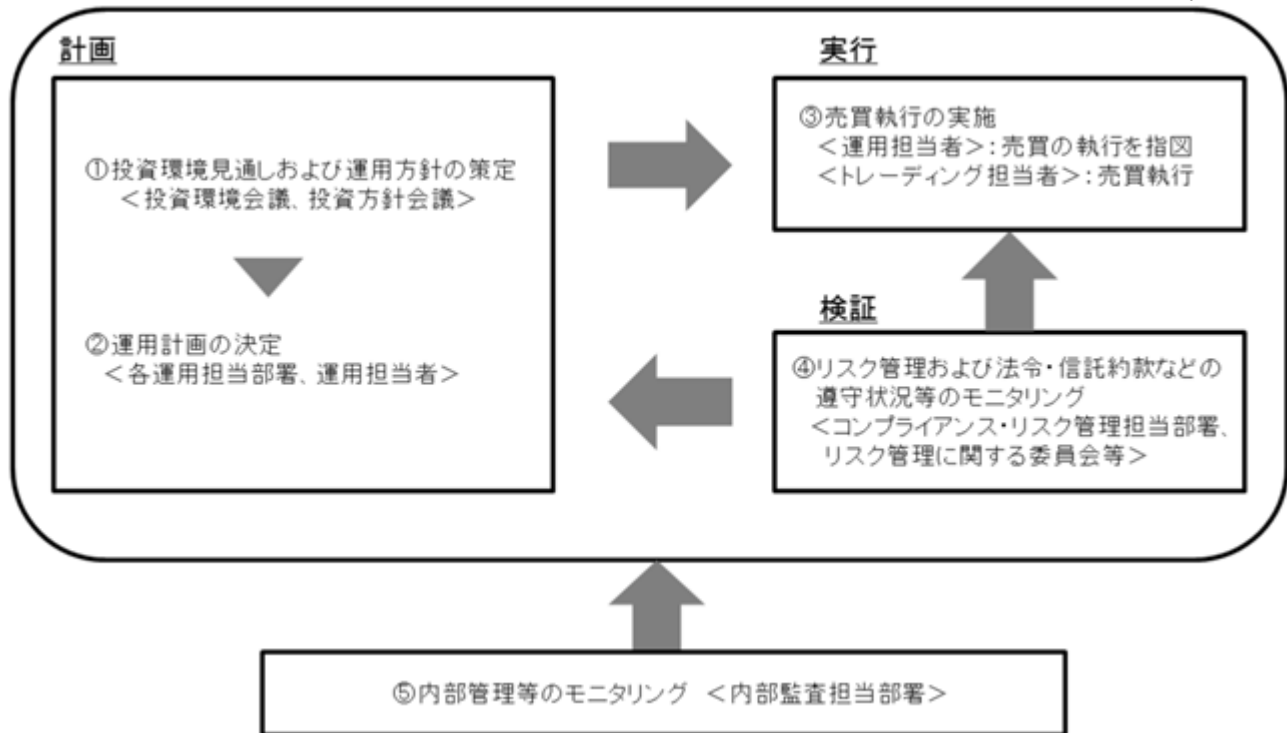
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
投資態度	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
---------------	---

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として10月12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等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

- b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に係る配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

- 1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)
- 2) 株式への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)
- 3) 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)
- 4) 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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)
- 5) 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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)
- 6) 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)
- 7) 投資する株式等の範囲(約款第20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、金融商品取引所等に上場(上場予定を含みます。)されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等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せん。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。
- 8) 信用取引の指図範囲(約款第21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、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い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(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限り、)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(上記5.に定めるものを除きます。))の行使により取得可能な株券

9) 先物取引等の運用指図(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用ならびに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。))。
- b. 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係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 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を回避するため、わが国の取引所における金利に係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行うことの指図をすることができます。

10) スワップ取引の運用指図(約款第23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。
- d. 委託会社は、スワップ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) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 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。
- d. 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。

12) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第24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。

13) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25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)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

14) 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第26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。

15) 外国為替予約取引の指図および範囲(約款第27条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. 上記a.の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- c. 上記b.においてマザーファンドの信託財産に係る為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- d. 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、

16) 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。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

(1) 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

(3) 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。

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

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、当該インデックス構成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、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

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

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

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の場合、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

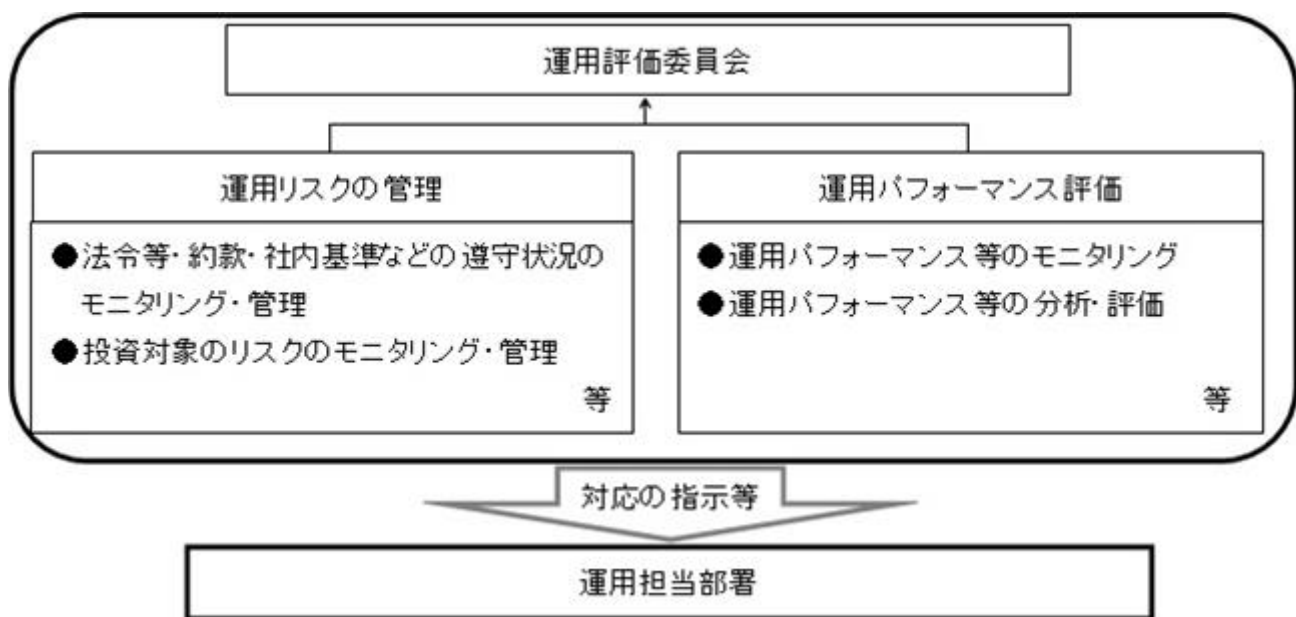
- イ．当ファンドは、実質的に株式等の値動きのある有価証券（外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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

<リスク管理体制>

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

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



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

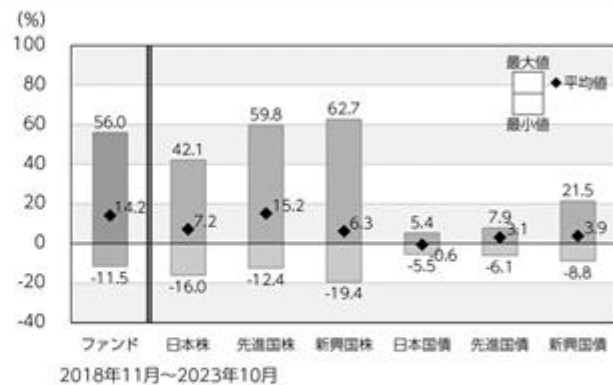
リスク管理体制は2023年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

●すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPMリサーチ・アンド・コンサルティング(以下「JPM」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JPM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	NOMJURA-BPI国債	[NOMJURA-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	JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	[JPMオルガン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・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・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0.385%(税抜0.35%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.30%	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0.02%	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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

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て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2024年1月1日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

… (参考情報) ファンドの総経費率 …

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.41%	0.39%	0.02%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年10月13日~2023年10月12日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2023年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	26,745,054,625	100.00
内 日本	26,745,054,625	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	838,970	0.00
純資産総額	26,745,893,595	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10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	1,018,391,905,613	96.28
内 アメリカ	729,396,913,856	68.96
内 イギリス	42,982,553,444	4.06
内 カナダ	35,329,818,296	3.34
内 スイス	33,061,208,027	3.13
内 フランス	32,917,655,935	3.11
内 ドイツ	24,425,043,474	2.31
内 オーストラリア	20,307,697,809	1.92
内 オランダ	19,109,478,753	1.81
内 アイルランド	18,802,575,560	1.78
内 デンマーク	10,211,458,045	0.97
内 スウェーデン	8,353,195,357	0.79
内 スペイン	7,648,325,572	0.72
内 イタリア	5,761,873,431	0.54
内 香港	5,378,046,776	0.51
内 ジャージー	3,484,999,739	0.33
内 シンガポール	3,448,384,398	0.33
内 フィンランド	3,220,928,776	0.30
内 ベルギー	2,257,542,070	0.21
内 ノルウェー	2,076,093,446	0.20
内 バミューダ	1,870,465,048	0.18
内 イスラエル	1,869,840,310	0.18
内 オランダ領キュラソー	1,696,684,392	0.16
内 ケイマン諸島	1,589,648,378	0.15
内 ニュージーランド	738,755,383	0.07
内 オーストリア	601,799,362	0.06
内 ポルトガル	557,128,532	0.05
内 ルクセンブルグ	471,239,249	0.04
内 リベリア	408,637,948	0.04
内 パナマ	252,948,672	0.02
内 マン島	160,965,575	0.02
新株予約権証券	0	0.00
内 カナダ	0	0.00
投資信託受益証券	1,574,093,149	0.15
内 オーストラリア	1,109,554,766	0.10

	内 シンガポール	464,538,383	0.04
投資証券		18,397,496,009	1.74
	内 アメリカ	17,357,065,340	1.64
	内 イギリス	332,060,048	0.03
	内 フランス	327,435,512	0.03
	内 香港	243,251,951	0.02
	内 ベルギー	73,004,961	0.01
	内 カナダ	64,678,197	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,369,512,491	1.83
純資産総額		1,057,733,007,262	100.00

その他資産の投資状況

2023年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	20,074,029,746	1.90
内 アメリカ	15,238,509,598	1.44
内 ドイツ	2,890,133,107	0.27
内 イギリス	880,541,204	0.08
内 カナダ	661,418,719	0.06
内 オーストラリア	403,427,118	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,835,296,215	7.3205 28,076,656,346	6.9734 26,745,054,625	- -	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10月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,215,083	23,748.13 52,604,083,986	25,460.05 56,396,141,433	- -	5.33
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	994,797	42,337.28 42,117,001,155	50,431.21 50,168,824,472	- -	4.74
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,300,584	15,764.55 20,503,128,881	19,841.47 25,805,501,149	- -	2.44
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	347,940	41,021.12 14,272,889,938	61,539.81 21,412,161,874	- -	2.02
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	837,859	15,341.28 12,853,830,367	18,608.01 15,590,892,504	- -	1.47
6	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	311,606	30,593.84 9,533,226,781	45,250.69 14,100,388,564	- -	1.33
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	743,127	15,237.32 11,323,270,873	18,800.88 13,971,443,409	- -	1.32
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	401,893	31,993.94 12,858,143,088	29,507.29 11,858,774,746	- -	1.12
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	131,111	74,110.89 9,716,753,525	79,238.80 10,389,078,949	- -	0.98
10	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	113,706	57,583.29 6,547,566,528	84,579.30 9,617,174,124	- -	0.91

11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	182,004	47,293.41 8,607,589,960	50,446.16 9,181,404,560	- -	0.87
12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	569,045	17,168.83 9,769,837,703	15,830.11 9,008,049,952	- -	0.85
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	411,240	21,325.16 8,769,759,625	20,545.66 8,449,198,945	- -	0.80
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	227,651	34,431.27 7,838,313,610	34,847.79 7,933,134,423	- -	0.75
15	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	338,995	24,092.85 8,167,358,819	21,982.45 7,451,942,434	- -	0.70
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	331,548	21,179.86 7,022,141,106	22,315.86 7,398,779,613	- -	0.70
17	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	58,139	97,844.65 5,688,590,674	125,775.28 7,312,449,439	- -	0.69
18	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	460,456	11,246.21 5,178,388,949	14,407.90 6,634,204,923	- -	0.63
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	119,047	55,810.64 6,644,089,467	55,680.51 6,628,598,173	- -	0.63
20	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	376,135	18,214.89 6,851,258,191	16,195.72 6,091,780,527	- -	0.58
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	141,576	46,765.86 6,620,924,414	42,084.07 5,958,094,973	- -	0.56
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	255,277	25,381.79 6,479,389,288	21,841.91 5,575,738,765	- -	0.53
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	357,359	16,179.42 5,781,863,627	15,351.68 5,486,063,443	- -	0.52
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	248,482	22,732.20 5,648,544,174	21,213.97 5,271,290,662	- -	0.50
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	62,294	76,344.23 4,755,787,710	82,960.10 5,167,917,017	- -	0.49
26	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	208,086	22,134.07 4,605,790,478	24,373.12 5,071,705,089	- -	0.48

27	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	64,266	60,440.67 3,884,280,660	78,782.79 5,063,055,386	- -	0.48
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	56,784	97,703.92 5,548,019,630	87,580.31 4,973,160,890	- -	0.47
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	577,606	8,871.64 5,124,314,303	8,394.98 4,848,994,572	- -	0.46
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	193,765	26,181.38 5,073,035,848	24,262.48 4,701,219,979	- -	0.44

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.28
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.15
投資証券	1.74
合計	98.17

(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10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	8.53
半導体・半導体製造装置		5.78
コンピュータ・周辺機器		5.57
医薬品		5.25
銀行		5.12
石油・ガス・消耗燃料		5.04
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.25
保険		3.23
金融サービス		3.03
資本市場		2.99
大規模小売り		2.85
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.29
ヘルスケア機器・用品		2.10
ホテル・レストラン・レジャー		2.03
バイオテクノロジー		1.89
化学		1.89
機械		1.78
生活必需品流通・小売り		1.76
自動車		1.72
航空宇宙・防衛		1.71
電力		1.68
飲料		1.67
専門小売り		1.55
食品		1.50
金属・鉱業		1.49

情報技術サービス	1.27
繊維・アパレル・贅沢品	1.23
家庭用品	1.13
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.08
陸上運輸	1.04
専門サービス	0.99
各種電気通信サービス	0.98
娯楽	0.98
コングロマリット	0.87
電気設備	0.82
総合公益事業	0.76
通信機器	0.70
メディア	0.69
パーソナルケア用品	0.62
タバコ	0.58
商業サービス・用品	0.57
建設関連製品	0.57
航空貨物・物流サービス	0.50
電子装置・機器・部品	0.49
商社・流通業	0.43
消費者金融	0.33
不動産管理・開発	0.33
建設・土木	0.32
エネルギー設備・サービス	0.32
建設資材	0.28
家庭用耐久財	0.27
無線通信サービス	0.23
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.12
ガス	0.10
紙製品・林産品	0.10
水道	0.10
運送インフラ	0.09
販売	0.09
海上運輸	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.06
旅客航空輸送	0.05
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.01
合計	96.28

(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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Dec23	買建	487	15,688,803,816	15,238,509,598	1.44
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec23	買建	451	2,966,578,668	2,890,133,107	0.27
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec23	買建	66	908,627,304	880,541,204	0.08
	モントルオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec23	買建	27	679,954,061	661,418,719	0.06
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec23	買建	25	416,944,098	403,427,118	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2023年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第6計算期間末 (2014年10月14日)	2,215	2,215	2.6269	2.6269
第7計算期間末 (2015年10月13日)	3,146	3,146	3.0867	3.0867
第8計算期間末 (2016年10月12日)	4,929	4,929	2.7556	2.7556
第9計算期間末 (2017年10月12日)	5,037	5,037	3.6369	3.6369
第10計算期間末 (2018年10月12日)	9,119	9,119	3.7241	3.7241
第11計算期間末 (2019年10月15日)	11,443	11,443	3.9188	3.9188
第12計算期間末 (2020年10月12日)	16,425	16,425	4.3750	4.3750
第13計算期間末 (2021年10月12日)	16,248	16,248	5.9202	5.9202
第14計算期間末 (2022年10月12日)	19,590	19,590	6.0937	6.0937
第15計算期間末 (2023年10月12日)	27,476	27,476	7.7127	7.7127

2022年10月末日	21,503	-	6.6952	-
11月末日	20,908	-	6.4956	-
12月末日	16,560	-	6.0954	-
2023年1月末日	17,346	-	6.3244	-
2月末日	20,843	-	6.5446	-
3月末日	20,921	-	6.5113	-
4月末日	24,511	-	6.6876	-
5月末日	21,775	-	6.9971	-
6月末日	26,288	-	7.5450	-
7月末日	26,940	-	7.6571	-
8月末日	27,475	-	7.7894	-
9月末日	26,961	-	7.5988	-
10月末日	26,745	-	7.3400	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	15.1
第7計算期間	17.5
第8計算期間	10.7
第9計算期間	32.0
第10計算期間	2.4
第11計算期間	5.2
第12計算期間	11.6
第13計算期間	35.3
第14計算期間	2.9
第15計算期間	26.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第6計算期間	217,412,057	398,702,037
第7計算期間	250,814,799	74,594,722
第8計算期間	991,108,656	221,609,326
第9計算期間	451,944,648	855,793,807
第10計算期間	1,897,278,171	833,544,518
第11計算期間	1,316,434,322	845,197,004

第12計算期間	2,131,675,935	1,297,472,253
第13計算期間	947,676,819	1,957,413,445
第14計算期間	803,953,408	333,645,504
第15計算期間	1,672,162,031	1,324,547,160

(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10月31日

基準価額・純資産の推移 (2013年10月31日～2023年10月31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:2009年1月30日)

分配の推移(税引前)

2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
2022年10月	0円
2023年10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	96.28
内 アメリカ	68.96
内 イギリス	4.06
内 カナダ	3.34
内 スイス	3.13
内 フランス	3.11
内 その他	13.68
新株予約権証券	0.00
内 カナダ	0.00
投資信託受益証券	0.15
内 オーストラリア	0.10
内 シンガポール	0.04
投資証券	1.74
内 アメリカ	1.64
内 イギリス	0.03
内 フランス	0.03
内 香港	0.02
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)	1.83
合計(純資産総額)	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.33
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.74
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売	2.44
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	2.02
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.47
6	META PLATFORMS INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.33
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	1.32
8	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.12
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	0.98
10	ELI LILLY & CO	株式	アメリカ	医薬品	0.91

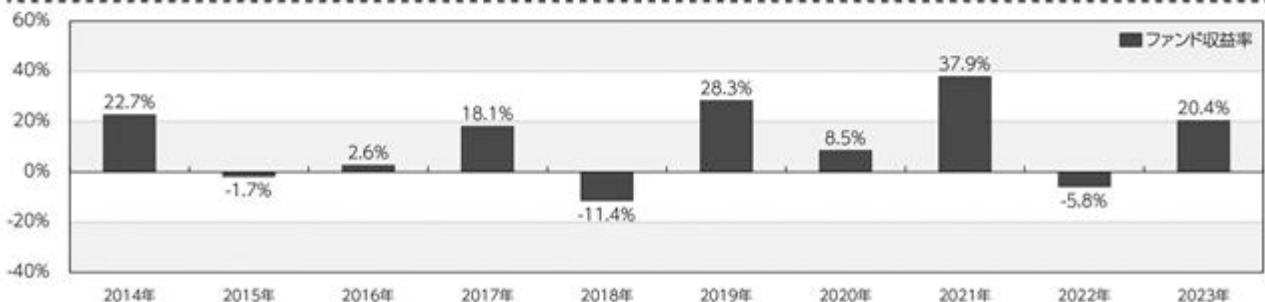
その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.90

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	ソフトウェア	8.53
2	半導体・半導体製造装置	5.78
3	コンピュータ・周辺機器	5.57
4	医薬品	5.25
5	銀行	5.12

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

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

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

ただし、ニューヨーク証券取引所、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。)には、お申込みの受付を行いません。

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

受益権の取得申込者は販売会社に、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。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額となります。

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

<基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <https://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

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。

お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・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）に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、解約の請求をすることができます。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、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して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において、委託会社にて計算され、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 <https://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、2009年1月30日から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12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ます。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

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

た場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ．信託約款の変更等

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

払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八．関係法人との契約の更改

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

二．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。(URL <https://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10月12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 <https://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2022年10月13日から2023年10月12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外国株式パッシブ・ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 2022年10月12日現在	第15期 2023年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	50,553,629	67,320,874
親投資信託受益証券	19,590,042,678	27,475,387,346
流動資産合計	19,640,596,307	27,542,708,220
資産合計	19,640,596,307	27,542,708,220
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,093,960	17,246,308
未払受託者報酬	3,298,850	4,134,776
未払委託者報酬	35,188,108	44,104,781
その他未払費用	348,962	396,921
流動負債合計	49,929,880	65,882,786
負債合計	49,929,880	65,882,786
純資産の部		
元本等		
元本	3,214,907,065	3,562,521,936
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	16,375,759,362	23,914,303,498
(分配準備積立金)	5,268,729,492	8,110,284,091
元本等合計	19,590,666,427	27,476,825,434
純資産合計	19,590,666,427	27,476,825,434
負債純資産合計	19,640,596,307	27,542,708,220

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期		第15期	
	自	2021年10月13日	自	2022年10月13日
	至	2022年10月12日	至	2023年10月12日
営業収益				
受取利息		281		561
有価証券売買等損益		601,868,947		5,393,481,668
営業収益合計		601,869,228		5,393,482,229
営業費用				
支払利息		14,165		102,584
受託者報酬		6,382,777		7,335,259
委託者報酬		68,083,745		78,243,695
その他費用		677,145		733,141
営業費用合計		75,157,832		86,414,679
営業利益又は営業損失()		526,711,396		5,307,067,550
経常利益又は経常損失()		526,711,396		5,307,067,550
当期純利益又は当期純損失()		526,711,396		5,307,067,550
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()		140,492,367		667,597,134
期首剰余金又は期首欠損金()		13,503,911,932		16,375,759,362
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,137,248,219		9,748,409,990
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		4,137,248,219		9,748,409,990
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,651,619,818		6,849,336,270
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,651,619,818		6,849,336,270
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()		16,375,759,362		23,914,303,498

(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15期	
	自 2022年10月13日	至 2023年10月12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14期	第15期
	2022年10月12日現在	2023年10月12日現在
1. 期首元本額	2,744,599,161円	3,214,907,065円
期中追加設定元本額	803,953,408円	1,672,162,031円
期中一部解約元本額	333,645,504円	1,324,547,160円
2. 受益権の総数	3,214,907,065口	3,562,521,936口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期	第15期
	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日	自 2022年10月13日 至 2023年10月12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(284,857,416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(101,361,613円)、信託約款に規定される収益調整金(11,107,029,870円)及び分配準備積立金(4,882,510,463円)より分配対象収益は16,375,759,362円(1万口当たり50,936.96円)であります、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(415,961,593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(4,223,508,823円)、信託約款に規定される収益調整金(15,804,019,407円)及び分配準備積立金(3,470,813,675円)より分配対象収益は23,914,303,498円(1万口当たり67,127.45円)であります、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期	第15期
	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日	自 2022年10月13日 至 2023年10月12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14期 2022年10月12日現在	第15期 2023年10月12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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第14期 2022年10月12日現在	第15期 2023年10月12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	502,809,543	4,829,424,952
合計	502,809,543	4,829,424,952

(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14期 2022年10月12日現在	第15期 2023年10月12日現在
1口当たり純資産額	6.0937円	7.7127円
(1万口当たり純資産額)	(60,937円)	(77,127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10月12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	3,750,342,931	27,475,387,346	
親投資信託受益証券	合計	3,750,342,931	27,475,387,346	
合計			27,475,387,346	

(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10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	8,219,448,160
コール・ローン	1,520,869,620
株式	1,062,956,630,858
投資信託受益証券	1,635,442,490
投資証券	19,502,616,492
派生商品評価勘定	141,576,462
未収配当金	860,059,060
差入委託証拠金	8,097,660,976
流動資産合計	1,102,934,304,118
資産合計	
1,102,934,304,118	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	200,274,858
未払解約金	25,958,000
流動負債合計	226,232,858
負債合計	
226,232,858	
純資産の部	
元本等	
元本	150,516,972,968
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	952,191,098,292
元本等合計	1,102,708,071,260
純資産合計	1,102,708,071,260
負債純資産合計	1,102,934,304,118

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10月13日 至 2023年10月12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>新株予約権証券 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10月12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	124,720,616,433円
同期中追加設定元本額	57,546,414,721円
同期中一部解約元本額	31,750,058,186円

元本の内訳

ファンド名

D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,750,342,931円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,865,878円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,964,353円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	20,322,262円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,375,109円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,496,762円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,508,496円
たわらノーロード 先進国株式	52,705,801,413円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	300,919,387円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,850,562,877円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	890,697,093円
たわらノーロード バランス(堅実型)	83,810,670円
たわらノーロード バランス(標準型)	759,835,975円
たわらノーロード バランス(積極型)	994,025,781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)	34,495,247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)	225,244,057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)	235,178,829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)	404,033,833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)	293,769円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	14,371,442円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,718,583円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,712,292円
たわらノーロード 全世界株式	1,124,100,521円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	56,193,139,136円
O n e D C 先進国株式インデックスファンド	3,124,121,110円
O n eグローバルバランス	17,655,147円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	144,071,172円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	786,104,094円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,029,593,459円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	85,216,821円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	241,011,603円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	243,878,266円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,590,614円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	120,079,720円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	163,664,280円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	187,179,176円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	311,129,369円
投資のソムリエ	5,947,090,919円
クルーズコントロール	77,645,969円
投資のソムリエ<DC年金>	523,090,509円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	186,158,390円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	276,563,089円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	539,738,436円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,940,555,774円
ワールドアセットバランス(基本コース)	121,856,881円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	217,559,181円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	57,580,667円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	29,425,550円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,252,171円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	167,669,251円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	139,001,924円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	968,850,817円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	136,286,413円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	59,620,684円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	31,483,183円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	19,114,510円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	130,182,296円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,533,391円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	34,964,356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)	653,645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)	752,790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)	496,066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)	708,336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)	1,530,912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)	597,645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)	335,381,172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)	35,412,248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)	1,107,506,924円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	197,745,796円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,268,307,761円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	172,053,673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)	363,221円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	5,826,884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)	1,234,941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)	2,740,183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)	21,549,114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)	38,631,716円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,528,053円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,229,024円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,008,055円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	31,131円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	899,092円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	16,064,292円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	118,779,928円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	212,248,411円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	730,347,553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)	31,190,803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)	28,082,780円

D I A M 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）	184,084,451円
D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	5,115,534円
D I A M世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	142,173円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	70,436,332円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	6,058,954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）	22,711,287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）	35,490,373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）	79,725,309円
動的パッケージファンド<DC年金>	13,317,338円
コア資産形成ファンド	8,038,970円
たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジなし）<ラップ専用>	2,649,319,470円
MHAM外国株式インデックスファンド	136,860,746円
たわらノーロード 先進国株式（為替ヘッジあり）<ラップ専用>	11,570,986円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,592,593,643円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,934,975,245円
計	150,516,972,968円
2. 受益権の総数	150,516,972,968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10月13日 至 2023年10月12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10月12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10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	37,998,677,678	
投資信託受益証券	57,527,483	
投資証券	2,850,406,049	
合計	35,090,744,146	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年2月16日から2023年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	1,588,664,670	-	1,594,735,870	6,071,200	
イギリス・ポンド	1,001,417,560	-	1,005,206,377	3,788,817	
オーストラリア・ドル	99,866,126	-	100,330,678	464,552	
カナダ・ドル	50,431,127	-	50,467,225	36,098	
ユーロ	81,989,823	-	82,267,687	277,864	
ユーロ	354,960,034	-	356,463,903	1,503,869	
合計	1,588,664,670	-	1,594,735,870	6,071,200	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2023年10月12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	18,854,139,656	-	18,789,370,060	64,769,596
合計	18,854,139,656	-	18,789,370,060	64,769,596

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2023年10月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	7.3261円 (73,261円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2023年10月12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	1,289,446	131.830	169,987,666.180	
	ABBOTT LABORATORIES	243,281	92.640	22,537,551.840	
	AES CORP	90,680	13.390	1,214,205.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	127,099	143.230	18,204,389.770	
	ADVANCED MICRO DEVICES	223,468	108.310	24,203,819.080	
	ADOBE INC	63,562	549.910	34,953,379.420	
	CHUBB LTD	58,149	210.180	12,221,756.820	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30,769	290.890	8,950,394.410	
	ALLSTATE CORP	35,641	114.770	4,090,517.570	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	93,039	187.400	17,435,508.600	

AMGEN INC	74,390	283.600	21,097,004.000	
HESS CORP	37,733	154.980	5,847,860.340	
AMERICAN EXPRESS CO	88,192	151.510	13,361,969.920	
AMERICAN ELECTRIC POWER	69,313	75.280	5,217,882.640	
AFLAC INC	83,202	79.800	6,639,519.600	
AMERICAN INTL GROUP	99,164	61.530	6,101,560.920	
ANALOG DEVICES	69,484	174.920	12,154,141.280	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	97,613	53.410	5,213,510.330	
VALERO ENERGY CORP	50,039	129.600	6,485,054.400	
ANSYS INC	11,587	304.880	3,532,644.560	
APPLE INC	2,197,121	179.800	395,042,355.800	
APPLIED MATERIALS INC	116,660	142.180	16,586,718.800	
ALBEMARLE CORP	16,885	164.800	2,782,648.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,760	73.700	5,804,612.000	
AMEREN CORP	38,938	77.390	3,013,411.820	
ARROW ELECTRONICS INC	7,023	119.010	835,807.230	
AUTODESK INC	29,385	213.200	6,264,882.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	57,549	249.460	14,356,173.540	
AUTOZONE INC	2,591	2,571.860	6,663,689.260	
AVERY DENNISON CORP	11,542	186.510	2,152,698.420	
BALL CORP	45,691	45.990	2,101,329.090	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	181,145	348.430	63,116,352.350	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	104,322	42.150	4,397,172.300	
BAXTER INTERNATIONAL INC	71,337	32.740	2,335,573.380	
BECTON DICKINSON & CO	39,422	261.300	10,300,968.600	
AMETEK INC	32,705	152.250	4,979,336.250	
VERIZON COMM INC	589,099	31.460	18,533,054.540	
WR BERKLEY CORP	30,631	64.140	1,964,672.340	
BEST BUY CO INC	29,593	70.950	2,099,623.350	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	357.000	1,078,497.000	
YUM! BRANDS INC	37,898	118.380	4,486,365.240	
FIRSTENERGY CORP	75,630	35.460	2,681,839.800	
BOEING CO	79,649	196.070	15,616,779.430	
ROBERT HALF INC	14,456	77.000	1,113,112.000	
BORGWARNER INC	29,975	39.970	1,198,100.750	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	206,139	50.910	10,494,536.490	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17,233	85.990	1,481,865.670	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	24,629	144.750	3,565,047.750	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,933	1,107.080	3,247,065.640	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	293,293	56.650	16,615,048.450	

ONEOK INC	82,913	67.460	5,593,310.980	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	9,709	110.650	1,074,300.850	
UNITED RENTALS INC	9,916	454.070	4,502,558.120	
SEMPRA	88,786	69.270	6,150,206.220	
FEDEX CORP	32,918	255.460	8,409,232.280	
VERISIGN INC	13,302	210.090	2,794,617.180	
AMPHENOL CORP	84,731	84.640	7,171,631.840	
BROWN-FORMAN CORP	43,429	56.190	2,440,275.510	
QUANTA SERVICES INC	20,975	179.320	3,761,237.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	4.590	467,101.350	
CSX CORP	293,894	31.610	9,289,989.340	
COTERRA ENERGY INC	112,611	28.250	3,181,260.750	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	39.430	1,063,742.540	
CONSTELLATION BRANDS INC	23,956	239.000	5,725,484.000	
CARDINAL HEALTH INC	33,461	91.680	3,067,704.480	
CARLISLE COS INC	7,522	267.570	2,012,661.540	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	148,408	12.650	1,877,361.200	
CATERPILLAR INC	71,704	272.830	19,563,002.320	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	134.370	1,697,227.470	
JPMORGAN CHASE & CO	408,203	146.150	59,658,868.450	
CHURCH & DWIGHT CO INC	34,837	87.650	3,053,463.050	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,671	102.270	2,318,563.170	
CINTAS CORP	12,807	512.510	6,563,715.570	
CISCO SYSTEMS INC	569,349	53.660	30,551,267.340	
CLEVELAND-CLIFFS INC	69,371	15.740	1,091,899.540	
CLOROX COMPANY	18,305	122.360	2,239,799.800	
COCA-COLA CO/THE	576,198	53.710	30,947,594.580	
COPART INC	114,384	46.150	5,278,821.600	
COGNEX CORP	25,772	40.930	1,054,847.960	
COLGATE-PALMOLIVE CO	112,540	68.870	7,750,629.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	36,790	198.270	7,294,353.300	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,616	340.480	2,593,095.680	
NRG ENERGY, INC.	34,874	41.270	1,439,249.980	
COMCAST CORP-CL A	581,376	44.240	25,720,074.240	
CONAGRA BRANDS INC	71,055	27.360	1,944,064.800	
CONSOLIDATED EDISON INC	46,058	88.450	4,073,830.100	
CMS ENERGY CORP	43,873	54.180	2,377,039.140	
COOPER COS INC	7,281	310.750	2,262,570.750	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	25,281	60.050	1,518,124.050	
CORNING INC	115,879	29.100	3,372,078.900	
WOLFSPEED INC	15,684	33.700	528,550.800	
SEALED AIR CORP	17,610	30.970	545,381.700	
HEICO CORP-CL A	9,463	133.910	1,267,190.330	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	7,878	209.490	1,650,362.220	

CUMMINS INC	18,916	230.050	4,351,625.800	
DARLING INTERNATIONAL INC	23,806	46.460	1,106,026.760	
DR HORTON INC	41,113	108.670	4,467,749.710	
DANAHER CORP	97,832	216.430	21,173,779.760	
MOODY'S CORP	22,734	325.520	7,400,371.680	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	68,959	68.340	4,712,658.060	
TARGET CORP	63,536	108.990	6,924,788.640	
DEERE & CO	38,736	389.360	15,082,248.960	
MORGAN STANLEY	174,759	78.900	13,788,485.100	
REPUBLIC SERVICES INC	32,288	146.470	4,729,223.360	
COSTAR GROUP INC	57,938	81.870	4,743,384.060	
DECKERS OUTDOOR CORP	3,727	509.070	1,897,303.890	
THE WALT DISNEY CO	254,869	84.850	21,625,634.650	
DOLLAR TREE INC	28,091	107.030	3,006,579.730	
DOVER CORP	17,145	142.180	2,437,676.100	
OMNICOM GROUP	26,669	74.840	1,995,907.960	
DTE ENERGY CO	30,474	97.840	2,981,576.160	
DUKE ENERGY CORP	111,102	89.870	9,984,736.740	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,594	137.520	2,419,526.880	
EBAY INC	75,181	43.050	3,236,542.050	
BANK OF AMERICA CORP	1,000,292	27.020	27,027,889.840	
CITIGROUP INC	270,018	41.530	11,213,847.540	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	74.230	1,246,321.700	
EATON CORP PLC	55,045	215.870	11,882,564.150	
CADENCE DESIGN SYS INC	38,973	252.980	9,859,389.540	
ECOLAB INC	36,605	169.750	6,213,698.750	
REVVITY INC	17,972	108.980	1,958,588.560	
ELECTRONIC ARTS INC	37,893	129.690	4,914,343.170	
SALESFORCE INC	135,649	206.850	28,058,995.650	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	305.300	1,029,471.600	
EMERSON ELECTRIC CO	79,101	97.090	7,679,916.090	
ATMOS ENERGY CORP	21,185	111.790	2,368,271.150	
ENTERGY CORP	30,815	94.960	2,926,192.400	
EOG RESOURCES INC	81,575	127.370	10,390,207.750	
EQUIFAX INC	16,146	186.600	3,012,843.600	
EQT CORP	51,269	43.550	2,232,764.950	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	33,270	140.430	4,672,106.100	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	22,788	117.000	2,666,196.000	
EXXON MOBIL CORP	565,160	106.490	60,183,888.400	
FMC CORP	17,711	62.760	1,111,542.360	
NEXTERA ENERGY INC	283,123	53.540	15,158,405.420	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,412	456.870	2,472,580.440	
FAIR ISAAC CORP	3,381	904.680	3,058,723.080	
ASSURANT INC	8,276	146.800	1,214,916.800	
FASTENAL CO	76,599	56.010	4,290,309.990	
FIFTH THIRD BANCORP	85,111	24.990	2,126,923.890	

M&T BANK CORP	21,769	125.710	2,736,580.990	
FIRST HORIZON CORP	69,634	10.610	738,816.740	
FISERV INC	85,177	113.550	9,671,848.350	
FORD MOTOR CO	563,883	12.250	6,907,566.750	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	23.700	898,609.200	
FREEMPORT-MCMORAN INC	194,676	37.150	7,232,213.400	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	1,390.130	2,206,136.310	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,751	234.900	6,988,509.900	
DENTSPLY SIRONA INC	33,798	31.800	1,074,776.400	
GENERAL DYNAMICS CORP	33,504	237.780	7,966,581.120	
GENERAL MILLS INC	83,996	62.730	5,269,069.080	
GENUINE PARTS CO	19,809	146.770	2,907,366.930	
GILEAD SCIENCES INC	173,124	76.960	13,323,623.040	
GARTNER INC	11,345	360.820	4,093,502.900	
MCKESSON CORP	19,309	456.660	8,817,647.940	
NVIDIA CORP	344,718	468.060	161,348,707.080	
GRACO INC	23,985	75.880	1,819,981.800	
GENERAL ELECTRIC CO	151,379	113.260	17,145,185.540	
WW GRAINGER INC	6,074	714.290	4,338,597.460	
HALLIBURTON CO	121,086	41.640	5,042,021.040	
MONSTER BEVERAGE CORP	113,115	49.600	5,610,504.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	46,325	313.020	14,500,651.500	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	25,632	176.820	4,532,250.240	
HASBRO INC	21,174	58.240	1,233,173.760	
HENRY SCHEIN INC	17,431	73.440	1,280,132.640	
HEICO CORP	6,878	168.630	1,159,837.140	
HERSHEY FOODS CORP	19,554	191.770	3,749,870.580	
HP INC	124,613	26.830	3,343,366.790	
F5 INC	8,981	157.330	1,412,980.730	
CROWN HOLDINGS INC NPR	18,125	83.870	1,520,143.750	
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,222	234.580	1,459,556.760	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	26.200	1,145,333.000	
HOLOGIC INC	34,146	69.410	2,370,073.860	
HOME DEPOT INC	140,483	298.050	41,870,958.150	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,319	88.580	2,331,337.020	
HORMEL FOODS CORP	35,980	36.230	1,303,555.400	
CENTERPOINT ENERGY INC	78,047	27.750	2,165,804.250	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,776	390.200	1,863,595.200	
HUBBELL INC	7,826	310.630	2,430,990.380	
HUMANA INC	17,271	493.420	8,521,856.820	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,314	193.760	2,385,960.640	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	178,023	10.160	1,808,713.680	
BIOGEN INC	20,763	266.520	5,533,754.760	
IDEX CORP	11,156	209.030	2,331,938.680	

ILLINOIS TOOL WORKS	42,126	236.610	9,967,432.860	
INTUIT INC	39,008	541.580	21,125,952.640	
IDEXX LABORATORIES INC	12,015	445.880	5,357,248.200	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	32,771	211.300	6,924,512.300	
INTEL CORP	580,650	36.880	21,414,372.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	35,897	65.550	2,353,048.350	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	35.430	1,564,340.790	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	54,063	29.140	1,575,395.820	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,059	147.180	1,333,303.620	
JABIL CIRCUIT INC	15,856	138.500	2,196,056.000	
INCYTE CORP	22,728	56.960	1,294,586.880	
JOHNSON & JOHNSON	336,651	156.180	52,578,153.180	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	44,033	70.940	3,123,701.020	
KLA CORPORATION	18,936	482.630	9,139,081.680	
DEVON ENERGY CORP	86,432	46.750	4,040,696.000	
KELLANOVA	33,492	49.530	1,658,858.760	
KEYCORP	143,240	10.560	1,512,614.400	
KIMBERLY-CLARK CORP	45,701	119.350	5,454,414.350	
BLACKROCK INC/NEW YORK	20,869	642.670	13,411,880.230	
KROGER CO	99,244	44.190	4,385,592.360	
LAM RESEARCH CORP	18,592	641.730	11,931,044.160	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6,561	412.590	2,707,002.990	
PACKAGING CORP OF AMERICA	13,551	154.310	2,091,054.810	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	20,260	80.920	1,639,439.200	
AKAMA I TECHNOLOGIES	19,795	108.370	2,145,184.150	
LENNAR CORP	33,398	114.270	3,816,389.460	
ELI LILLY & CO	112,575	605.280	68,139,396.000	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	31.110	875,933.160	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	101,175	155.300	15,712,477.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	39,643	113.380	4,494,723.340	
LOCKHEED MARTIN CORP	31,975	436.650	13,961,883.750	
LOEWS CORP	29,698	64.290	1,909,284.420	
LOWE'S COS INC	81,720	203.290	16,612,858.800	
DOMINION ENERGY INC	113,579	42.960	4,879,353.840	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	38.010	1,535,642.010	
MCCORMICK & CO INC	35,510	62.020	2,202,330.200	
MCDONALD'S CORPORATION	102,326	250.920	25,675,639.920	
S&P GLOBAL INC	45,479	371.900	16,913,640.100	
EVEREST GROUP LTD	5,528	392.500	2,169,740.000	
MARKEL GROUP INC	1,657	1,487.330	2,464,505.810	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	81,961	71.140	5,830,705.540	
MARSH & MCLENNAN COS	69,913	192.900	13,486,217.700	
MASCO CORP	33,476	53.630	1,795,317.880	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	8,118	436.690	3,545,049.420	
METLIFE INC	89,802	62.850	5,644,055.700	
MEDTRONIC PLC	185,884	72.890	13,549,084.760	
ACTIVISION BLIZZARD INC	109,648	94.470	10,358,446.560	
CVS HEALTH CORP	178,108	71.730	12,775,686.840	
MERCK & CO. INC.	354,291	103.460	36,654,946.860	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	62,344	95.140	5,931,408.160	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	13,267	199.890	2,651,940.630	
MICROSOFT CORP	986,731	332.420	328,009,119.020	
MICRON TECH INC	151,730	70.210	10,652,963.300	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	77,820	81.230	6,321,318.600	
3M CO	75,907	90.390	6,861,233.730	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	84.370	532,459.070	
ENTEGRIS INC	20,987	97.610	2,048,541.070	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	7,674	197.080	1,512,391.920	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,288	287.600	6,985,228.800	
ILLUMINA INC	21,056	137.920	2,904,043.520	
XCEL ENERGY INC	73,107	58.810	4,299,422.670	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,755	113.610	1,676,315.550	
NETAPP INC	28,265	77.050	2,177,818.250	
NEWMONT CORP	116,853	39.110	4,570,120.830	
NVR INC	462	6,178.660	2,854,540.920	
NIKE INC-CL B	171,651	98.650	16,933,371.150	
NORDSON CORP	7,548	227.900	1,720,189.200	
NORFOLK SOUTHERN CORP	31,049	202.000	6,271,898.000	
EVERSOURCE ENERGY	43,648	58.970	2,573,922.560	
NISOURCE INC	53,270	26.050	1,387,683.500	
NORTHERN TRUST CORP	26,127	68.350	1,785,780.450	
NORTHROP GRUMMAN CORP	20,050	473.370	9,491,068.500	
WELLS FARGO & CO	511,449	39.690	20,299,410.810	
NUCOR CORP	36,511	154.860	5,654,093.460	
CHENIERE ENERGY INC	33,140	172.390	5,713,004.600	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	55,081	97.120	5,349,466.720	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	92,600	63.350	5,866,210.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,116	425.760	6,010,028.160	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,365	916.410	7,665,769.650	
ORACLE CORP	227,161	109.640	24,905,932.040	

PACCAR INC	75,017	86.680	6,502,473.560	
PTC INC	15,968	143.520	2,291,727.360	
EXELON CORP	144,751	40.040	5,795,830.040	
PARKER HANNIFIN CORP	17,358	407.290	7,069,739.820	
PAYCHEX INC	47,024	118.660	5,579,867.840	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,597	277.520	2,940,879.440	
PPL CORPORATION	102,363	24.110	2,467,971.930	
PEPSICO INC	192,723	162.620	31,340,614.260	
PENTAIR PLC	19,459	65.600	1,276,510.400	
PFIZER INC	787,990	33.110	26,090,348.900	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	34.230	1,122,607.080	
CONOCOPHILLIPS	169,323	120.040	20,325,532.920	
PG&E CORP	259,254	16.040	4,158,434.160	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32,251	240.820	7,766,685.820	
ALTRIA GROUP INC	249,953	42.560	10,637,999.680	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	54,185	122.740	6,650,666.900	
BROWN & BROWN INC	35,984	71.460	2,571,416.640	
GARMIN LTD	19,735	108.730	2,145,786.550	
PPG INDUSTRIES INC	33,760	132.520	4,473,875.200	
COSTCO WHOLESALE CORP	61,929	565.520	35,022,088.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	31,190	104.150	3,248,438.500	
QUEST DIAGNOSTICS	16,598	122.730	2,037,072.540	
PROCTER & GAMBLE CO	329,495	143.000	47,117,785.000	
PROGRESSIVE CORP	81,318	143.860	11,698,407.480	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	67,402	60.770	4,096,019.540	
PULTE GROUP INC	32,561	75.590	2,461,285.990	
GLOBAL PAYMENTS INC	37,196	115.180	4,284,235.280	
QUALCOMM INC	155,257	111.120	17,252,157.840	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	29,105	100.150	2,914,865.750	
EXACT SCIENCES CORP	26,045	66.890	1,742,150.050	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	7,931	263.250	2,087,835.750	
REGENERON PHARMACEUTICALS	14,964	836.070	12,510,951.480	
REPLIGEN CORP	6,730	156.350	1,052,235.500	
RESMED INC	18,645	144.230	2,689,168.350	
US BANCORP	220,548	32.510	7,170,015.480	
SEAGEN INC	20,184	214.500	4,329,468.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	49,747	83.020	4,129,995.940	
ROSS STORES INC	46,277	113.670	5,260,306.590	
ROLLINS INC	36,205	36.320	1,314,965.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,293	502.030	7,677,544.790	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,478	299.920	4,642,161.760	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	31,833	89.200	2,839,503.600	

RPM INTERNATIONAL INC	19,169	99.610	1,909,424.090	
ACCENTURE PLC-CL A	88,144	312.540	27,548,525.760	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	188,870	62.900	11,879,923.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,309	210.600	3,013,475.400	
AXON ENTERPRISE INC	10,996	220.000	2,419,120.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	33,616	162.410	5,459,574.560	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	80,075	53.120	4,253,584.000	
BOOKING HOLDINGS INC	5,130	3,071.950	15,759,103.500	
SCHLUMBERGER LTD	197,675	58.760	11,615,383.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	208,292	51.910	10,812,437.720	
POOL CORP	5,406	351.370	1,899,506.220	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	27,528	105.350	2,900,074.800	
BUNGE LTD	21,715	101.990	2,214,712.850	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	57.860	837,639.220	
ELEVANCE HEALTH INC	33,024	453.570	14,978,695.680	
CENCORA INC	23,804	188.030	4,475,866.120	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,327	70.650	2,495,852.550	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	34,934	255.540	8,927,034.360	
CENTENE CORP	78,244	70.980	5,553,759.120	
SMITH (A.O.) CORP	19,467	71.090	1,383,909.030	
SNAP-ON INC	6,590	261.210	1,721,373.900	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	49,426	94.860	4,688,550.360	
EDISON INTERNATIONAL	50,343	64.930	3,268,770.990	
SOUTHERN CO	156,515	67.100	10,502,156.500	
TRUIST FINANCIAL CORP	191,230	29.610	5,662,320.300	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	26.200	516,140.000	
AT&T INC	997,667	14.770	14,735,541.590	
CHEVRON CORP	253,806	161.100	40,888,146.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,889	84.070	1,924,278.230	
STATE STREET CORP	44,619	65.300	2,913,620.700	
STARBUCKS CORP	159,737	91.950	14,687,817.150	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	110.490	2,534,309.130	
STRYKER CORP	47,631	260.050	12,386,441.550	
NETFLIX INC	61,934	365.930	22,663,508.620	
GEN DIGITAL INC	89,004	17.730	1,578,040.920	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	19,152	48.950	937,490.400	
SYNOPSIS INC	21,045	494.950	10,416,222.750	
SYSCO CORP	72,334	64.080	4,635,162.720	
INTUITIVE SURGICAL INC	48,608	281.790	13,697,248.320	
TELEFLEX INC	6,985	192.230	1,342,726.550	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	169,250	9.040	1,530,020.000	
TERADYNE INC	22,066	99.560	2,196,890.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	126,747	157.330	19,941,105.510	
TEXTRON INC	26,006	79.760	2,074,238.560	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	53,835	492.630	26,520,736.050	
GLOBE LIFE INC	12,153	113.300	1,376,934.900	
TORO CO	14,644	86.090	1,260,701.960	
DAVITA INC	6,813	75.890	517,038.570	
TRACTOR SUPPLY CO	14,379	204.310	2,937,773.490	
BIO-TECHNE CORP	19,606	69.290	1,358,499.740	
TRIMBLE INC	36,251	52.530	1,904,265.030	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,996	392.420	2,352,950.320	
TYSON FOODS INC	41,316	48.210	1,991,844.360	
MARATHON OIL CORP	76,035	26.490	2,014,167.150	
UNION PACIFIC CORP	85,044	209.480	17,815,017.120	
RTX CORP	203,018	73.310	14,883,249.580	
UNITEDHEALTH GROUP INC	130,051	524.130	68,163,630.630	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	127.020	1,028,353.920	
VF CORP	51,762	16.160	836,473.920	
PARAMOUNT GLOBAL	78,663	12.140	954,968.820	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	35,537	365.250	12,979,889.250	
VULCAN MATERIALS CO	17,433	214.760	3,743,911.080	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	107,661	22.600	2,433,138.600	
WALMART INC	207,453	158.230	32,825,288.190	
WASTE MANAGEMENT INC	56,297	156.680	8,820,613.960	
WATERS CORP	8,441	266.200	2,246,994.200	
WATSCO INC	4,889	402.720	1,968,898.080	
WEBSTER FINANCIAL CORP	21,109	39.990	844,148.910	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,639	392.210	4,172,722.190	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,386	114.730	1,765,235.780	
VAIL RESORTS INC	5,235	215.870	1,130,079.450	
WESTERN DIGITAL CORP	47,864	46.390	2,220,410.960	
WABTEC CORP	22,016	105.740	2,327,971.840	
WHIRLPOOL CORP	6,832	128.160	875,589.120	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,235	97.880	2,176,361.800	
WYNN RESORTS LTD	15,379	94.730	1,456,852.670	
NASDAQ INC	47,600	49.660	2,363,816.000	
CME GROUP INC	49,920	217.100	10,837,632.000	
WILLIAMS COS INC	174,840	34.690	6,065,199.600	
DICK'S SPORTING GOODS INC	8,551	108.710	929,579.210	
LKQ CORP	37,072	50.920	1,887,706.240	
ALLIANT ENERGY CORP	33,966	49.690	1,687,770.540	

WEC ENERGY GROUP INC	41,287	82.950	3,424,756.650	
CARMAX INC	22,414	69.100	1,548,807.400	
TJX COMPANIES INC	159,850	89.250	14,266,612.500	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	7,764	217.160	1,686,030.240	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	156,049	3.470	541,490.030	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	23,528	42.920	1,009,821.760	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,146	167.820	2,877,441.720	
CBRE GROUP INC	45,160	73.850	3,335,066.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	133,681	16.490	2,204,399.690	
DOMINO'S PIZZA INC	5,137	354.050	1,818,754.850	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,578	502.040	3,302,419.120	
WESTLAKE CORP	6,030	125.130	754,533.900	
T-MOBILE US INC	74,866	143.120	10,714,821.920	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,820	46.520	2,224,586.400	
MOSAIC CO/THE	48,502	36.130	1,752,377.260	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,871	236.590	1,152,429.890	
CELANESE CORP	12,876	124.090	1,597,782.840	
DEXCOM INC	55,631	78.970	4,393,180.070	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	16,634	125.690	2,090,727.460	
EXPEDIA GROUP INC	18,344	103.610	1,900,621.840	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	25,892	84.000	2,174,928.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,506	329.340	4,777,406.040	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	18.020	649,332.680	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	82,389	111.450	9,182,254.050	
LIVE NATION	21,189	87.610	1,856,368.290	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,791	1,823.480	6,912,812.680	
TRANSDIGM GROUP INC	7,547	869.000	6,558,343.000	
MASTERCARD INC	118,296	399.810	47,295,923.760	
OWENS CORNING	13,227	136.560	1,806,279.120	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,061	95.640	1,727,354.040	
AERCAP HOLDINGS NV	24,379	61.840	1,507,597.360	
FIRST SOLAR INC	14,780	151.500	2,239,170.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17,337	182.390	3,162,095.430	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,308	308.860	2,257,148.880	
AECOM TECHNOLOGY CORP	17,000	83.780	1,424,260.000	
DELTA AIR LINES INC	21,592	35.980	776,880.160	
INSULET CORP	10,158	133.450	1,355,585.100	
DISCOVER FINANCIAL	35,918	90.760	3,259,917.680	
TE CONNECTIVITY LTD	45,141	125.430	5,662,035.630	
LULULEMON ATHLETICA INC	16,679	373.360	6,227,271.440	

VMWARE INC	34,158	171.480	5,857,413.840	
MERCADOLIBRE INC	6,207	1,243.950	7,721,197.650	
ULTA BEAUTY INC	7,466	391.300	2,921,445.800	
INVESCO LTD	57,267	13.810	790,857.270	
MSCI INC	11,575	523.170	6,055,692.750	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	217,190	93.150	20,231,248.500	
VISA INC	226,104	235.680	53,288,190.720	
KEURIG DR PEPPER INC	130,795	29.290	3,830,985.550	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,490	122.220	3,482,047.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	58,937	148.520	8,753,323.240	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	62.470	1,010,889.540	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	279,350	16.850	4,707,047.500	
XYLEM INC	33,760	92.370	3,118,411.200	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	37,537	93.540	3,511,210.980	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	6,330	220.300	1,394,499.000	
SPLUNK INC	23,372	147.180	3,439,890.960	
EPAM SYSTEMS INC	8,162	248.920	2,031,685.040	
HCA HEALTHCARE INC	28,711	244.070	7,007,493.770	
VERISK ANALYTICS INC	20,276	245.510	4,977,960.760	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,533	129.990	1,369,184.670	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,298	256.240	2,638,759.520	
NXP SEMICONDUCTOR NV	35,299	203.460	7,181,934.540	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	19,741	126.650	2,500,197.650	
TARGA RESOURCES CORP	27,732	85.500	2,371,086.000	
LEAR CORP	9,620	139.250	1,339,585.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,261	161.580	2,465,872.380	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	34,899	52.760	1,841,271.240	
DOLLAR GENERAL CORP	29,298	103.660	3,037,030.680	
FORTINET INC	90,920	58.970	5,361,552.400	
HYATT HOTELS CORP	6,647	108.290	719,803.630	
TESLA INC	398,105	262.990	104,697,633.950	
GENERAC HOLDINGS INC	9,111	107.780	981,983.580	
ENPHASE ENERGY INC	18,723	128.610	2,407,965.030	
GENERAL MOTORS CO	191,495	30.980	5,932,515.100	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	25.410	996,834.300	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10,655	233.380	2,486,663.900	
APTIV PLC	38,007	98.920	3,759,652.440	
PHILLIPS 66	64,680	112.130	7,252,568.400	
META PLATFORMS INC	308,773	327.820	101,221,964.860	

IQVIA HOLDINGS INC	26,820	204.560	5,486,299.200	
DIAMONDBACK ENERGY INC	24,714	158.850	3,925,818.900	
SERVICENOW INC	28,267	558.670	15,791,924.890	
PALO ALTO NETWORKS INC	42,240	259.210	10,949,030.400	
WORKDAY INC	29,552	222.000	6,560,544.000	
ABBVIE INC	246,089	149.340	36,750,931.260	
ZOETIS INC	64,279	176.950	11,374,169.050	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	20.900	1,133,009.900	
CDW CORP	17,900	213.820	3,827,378.000	
HOWMET AEROSPACE INC	55,049	46.470	2,558,127.030	
TWILIO INC	25,710	57.420	1,476,268.200	
SNAP INC	152,250	9.110	1,386,997.500	
TRADE DESK INC A	60,797	84.770	5,153,761.690	
OKTA INC	21,831	87.970	1,920,473.070	
BAKER HUGHES CO	146,676	34.900	5,118,992.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,514	91.840	1,975,845.760	
BROADCOM INC	57,542	874.560	50,323,931.520	
ARES MANAGEMENT CORP	23,111	111.140	2,568,556.540	
MONGODB INC	10,029	365.220	3,662,791.380	
BURLINGTON STORES INC	8,453	123.610	1,044,875.330	
VEEVA SYSTEMS INC	20,611	216.720	4,466,815.920	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,938	37.740	941,160.120	
EVERGY INC	33,192	50.300	1,669,557.600	
ALLEGION PLC	13,423	105.970	1,422,435.310	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	22,274	75.110	1,673,000.140	
STERIS PLC	14,147	225.000	3,183,075.000	
DOCUSIGN INC	26,362	42.230	1,113,267.260	
WIX.COM LTD	8,997	85.820	772,122.540	
DROPBOX INC	32,221	28.220	909,276.620	
KKR & CO INC	82,021	63.100	5,175,525.100	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	63.950	322,947.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	33,857	64.820	2,194,610.740	
MODERNA INC	47,242	102.760	4,854,587.920	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	37,524	153.690	5,767,063.560	
ARAMARK	29,717	26.320	782,151.440	
CIGNA GROUP	41,015	294.450	12,076,866.750	
DELL TECHNOLOGIES INC	38,670	70.340	2,720,047.800	
DOW INC	101,691	50.890	5,175,054.990	
OVINTIV INC	39,779	48.620	1,934,054.980	
AMCOR PLC	187,204	8.950	1,675,475.800	
PINTEREST INC	79,624	28.460	2,266,099.040	
FOX CORP-A	36,501	31.190	1,138,466.190	
FOX CORP-B	28,295	28.810	815,178.950	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	6.780	288,733.080	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	30,263	188.220	5,696,101.860	
CHEWY INC	9,648	18.790	181,285.920	

AVANTOR INC	97,157	20.950	2,035,439.150	
DYNATRACE INC	32,648	48.180	1,572,980.640	
CLOUDFLARE INC	39,882	65.290	2,603,895.780	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	83.140	1,147,332.000	
CARRIER GLOBAL CORP	119,861	56.040	6,717,010.440	
OTIS WORLDWIDE CORP	59,624	81.040	4,831,928.960	
UBER TECHNOLOGIES INC	252,413	46.640	11,772,542.320	
CORTEVA INC	102,288	49.880	5,102,125.440	
MATCH GROUP INC	42,058	38.320	1,611,662.560	
FERGUSON PLC	29,638	169.570	5,025,715.660	
BILL HOLDINGS INC	14,365	114.610	1,646,372.650	
BLACKSTONE INC	97,713	107.270	10,481,673.510	
PAYLOCITY HOLDING CORP	7,378	205.050	1,512,858.900	
CARLYLE GROUP INC	34,847	30.410	1,059,697.270	
DATADOG INC	35,218	89.440	3,149,897.920	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	25,689	69.560	1,786,926.840	
INGERSOLL RAND INC	51,111	65.990	3,372,814.890	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	58,669	67.780	3,976,584.820	
PAYCOM SOFTWARE INC	6,479	278.090	1,801,745.110	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	93,426	19.370	1,809,661.620	
DRAFTKINGS INC	53,576	30.740	1,646,926.240	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	30.270	933,496.530	
AON PLC	28,690	327.320	9,390,810.800	
WARNER BROS DISCOVERY INC	310,364	10.960	3,401,589.440	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	906	1,847.550	1,673,880.300	
BENTLEY SYSTEMS INC	26,659	53.710	1,431,854.890	
COINBASE GLOBAL INC	23,696	77.350	1,832,885.600	
UIPATH INC	53,439	17.020	909,531.780	
AIRBNB INC	56,873	130.000	7,393,490.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP	44,942	115.070	5,171,475.940	
MONDAY.COM LTD	3,043	148.070	450,577.010	
ROYALTY PHARMA PLC	47,149	27.140	1,279,623.860	
ROBLOX CORP	59,573	31.760	1,892,038.480	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	41,904	17.500	733,320.000	
VIATRIS INC	186,021	9.690	1,802,543.490	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	33,177	47.010	1,559,650.770	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	15,846	88.200	1,397,617.200	
HF SINCLAIR CORP	20,299	54.090	1,097,972.910	
SNOWFLAKE INC	35,393	163.540	5,788,171.220	
DOORDASH INC	37,045	80.800	2,993,236.000	
ARISTA NETWORKS INC	35,798	191.860	6,868,204.280	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	55,400	89.290	4,946,666.000	

GLOBAL-E ONLINE LTD	15,893	35.640	566,426.520	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	254,570	17.920	4,561,894.400	
FNF GROUP	38,907	39.890	1,552,000.230	
JACOBS SOLUTIONS INC	18,941	140.350	2,658,369.350	
MARVELL TECHNOLOGY INC	117,012	55.140	6,452,041.680	
APA CORP	40,946	38.930	1,594,027.780	
CONFLUENT INC	27,524	31.500	867,006.000	
LINDE PLC	68,457	378.670	25,922,612.190	
ROBINHOOD MARKETS INC	73,566	9.720	715,061.520	
LUCID GROUP INC	143,927	5.340	768,570.180	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	52.250	626,007.250	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	204.830	762,172.430	
TOAST INC	45,399	18.810	853,955.190	
GRAB HOLDINGS LTD	279,515	3.490	975,507.350	
CATALENT INC	27,357	46.570	1,274,015.490	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,847	29.660	1,597,102.020	
VERALTO CORP	32,610	74.470	2,428,466.700	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY SIRIUSXM	19,871	25.980	516,248.580	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY FORMULA ONE	28,191	68.590	1,933,620.690	
KENVUE INC	218,684	19.570	4,279,645.880	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	71,856	26.750	1,922,148.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	163.770	857,663.490	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,504	132.920	3,389,991.680	
HUBSPOT INC	6,653	455.450	3,030,108.850	
QORVO INC	14,144	93.420	1,321,332.480	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	18,513	93.070	1,723,004.910	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	7,789	124.540	970,042.060	
GODADDY INC	19,713	76.400	1,506,073.200	
ETSY INC	18,558	64.840	1,203,300.720	
TRANSUNION	24,667	71.720	1,769,117.240	
ALBERTSONS COS INC	40,041	22.720	909,731.520	
BLOCK INC	78,232	46.690	3,652,652.080	
DUPONT DE NEMOURS INC	62,713	76.420	4,792,527.460	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	31,108	58.430	1,817,640.440	
WESTROCK CO	34,286	37.280	1,278,182.080	
KRAFT HEINZ CO	114,528	32.440	3,715,288.320	
FORTIVE CORP	49,865	77.160	3,847,583.400	
WASTE CONNECTIONS INC	34,595	138.030	4,775,147.850	
ALPHABET INC-CL A	827,386	140.550	116,289,102.300	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	188,508	17.160	3,234,797.280	

	PAYPAL HOLDINGS INC	146,445	58.070	8,504,061.150	
	SEA LTD ADR	50,316	44.390	2,233,527.240	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	41,786	28.290	1,182,125.940	
	ZILLOW GROUP INC-C	22,374	45.040	1,007,724.960	
	ALPHABET INC-CL C	740,563	141.700	104,937,777.100	
	ZSCALER INC	12,304	173.050	2,129,207.200	
	ATLISSIAN CORP PLC	21,763	199.450	4,340,630.350	
	ROKU INC	15,660	71.360	1,117,497.600	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,512	449.820	6,077,967.840	
	VISTRA CORP	49,633	32.770	1,626,473.410	
アメリカ・ドル	小計	47,810,389		5,304,508,632.700 (791,750,958,517)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	61,295	14.385	881,728.570	
	ASHTREAD GROUP	63,076	50.380	3,177,768.880	
	SEVERN TRENT PLC	27,019	24.220	654,400.180	
	BARCLAYS PLC	2,207,571	1.571	3,468,094.040	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.298	533,794.400	
	BT GROUP PLC	904,198	1.196	1,081,420.800	
	BUNZL PLC	46,691	30.090	1,404,932.190	
	CRH PLC	102,020	47.060	4,801,061.200	
	AVIVA PLC	344,901	4.096	1,412,714.490	
	CRODA INTERNATIONAL	20,573	45.440	934,837.120	
	DIAGEO PLC	323,409	30.970	10,015,976.730	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.036	445,437.170	
	DCC PLC	16,599	46.360	769,529.640	
	NATIONAL GRID PLC	504,761	9.686	4,889,115.040	
	KINGFISHER PLC	323,222	2.124	686,523.520	
	BAE SYSTEMS PLC	418,384	10.540	4,409,767.360	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	294,881	25.425	7,497,349.420	
	HALMA PLC	51,066	19.450	993,233.700	
	NEXT PLC	16,093	68.760	1,106,554.680	
	IMPERIAL BRANDS PLC	125,526	17.550	2,202,981.300	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	15.550	310,626.800	
	ANGLO AMERICAN PLC	169,158	22.705	3,840,732.390	
	COMPASS GROUP PLC	235,947	20.820	4,912,416.540	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,743,184	6.590	18,077,582.560	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	856,399	2.201	1,884,934.190	
	CENTRICA PLC	793,776	1.563	1,240,671.880	
	UNILEVER PLC	351,404	39.305	13,811,934.220	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	9.742	882,323.190	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	53,779	19.670	1,057,832.930	
	PEARSON PLC	84,159	9.036	760,460.720	
	PERSIMMON PLC	56,474	10.620	599,753.880	

PRUDENTIAL PLC	399,036	9.078	3,622,448.800	
RIO TINTO PLC	155,039	50.550	7,837,221.450	
VODAFONE GROUP PLC	3,279,277	0.775	2,541,439.670	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	103,199	59.000	6,088,741.000	
RELX PLC	262,540	29.000	7,613,660.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	363,315	6.048	2,197,329.120	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,235,225	2.131	2,632,264.470	
NATWEST GROUP PLC	746,475	2.292	1,710,920.700	
ST JAMES'S PLACE PLC	89,082	8.200	730,472.400	
SSE PLC	158,403	15.875	2,514,647.620	
BP PLC	2,420,400	5.203	12,593,341.200	
SAGE GROUP PLC(THE)	152,196	10.010	1,523,481.960	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.435	849,607.320	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,751	89.400	961,139.400	
STANDARD CHARTERED PLC	309,012	7.582	2,342,928.980	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,257,724	0.432	3,999,336.760	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.167	665,030.120	
TESCO PLC	1,032,016	2.811	2,900,996.970	
3I GROUP PLC	143,794	20.570	2,957,842.580	
SMITH & NEPHEW PLC	125,930	9.442	1,189,031.060	
GSK PLC	580,157	15.192	8,813,745.140	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	57,829	82.660	4,780,145.140	
WPP PLC	142,785	7.464	1,065,747.240	
ASTRAZENECA PLC	215,917	109.440	23,629,956.480	
WHITBREAD PLC	25,470	33.490	852,990.300	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.230	984,339.070	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	17.770	928,109.330	
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,700	60.700	1,195,790.000	
SAINSBURY (J) PLC	159,205	2.581	410,908.100	
ADMIRAL GROUP PLC	32,350	24.010	776,723.500	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,489	41.390	682,479.710	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	20.790	383,679.450	
ABRDN PLC	285,831	1.640	468,762.840	
EXPERIAN PLC	130,915	27.830	3,643,364.450	
MONDI PLC	74,310	13.940	1,035,881.400	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	7.760	286,669.920	
OCADO GROUP PLC	69,766	5.876	409,945.010	
INFORMA PLC	186,195	7.276	1,354,754.820	
GLENCORE PLC	1,454,559	4.613	6,709,880.660	
ENTAIN PLC	96,924	9.466	917,482.580	
COCA-COLA HBC AG	31,035	21.470	666,321.450	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,323	4.713	241,885.290	
M&G PLC	270,401	2.011	543,776.410	

	ENDEAVOUR MINING PLC	28,075	15.770	442,742.750	
	WISE PLC	96,207	7.202	692,882.810	
	JD SPORTS FASHION PLC	382,071	1.386	529,550.400	
	HALEON PLC	743,306	3.353	2,492,305.010	
	SHELL PLC	934,420	26.460	24,724,753.200	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,188	6.454	924,135.350	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	221,854	4.733	1,050,034.980	
イギリス・ポンド 小計		38,986,861		257,858,114.100 (47,394,321,372)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	187,404	29.990	5,620,245.960	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	228,914	27.680	6,336,339.520	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,330	838.300	2,791,539.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.240	2,972,098.560	
	ICL GROUP LTD	103,067	20.900	2,154,100.300	
	NICE LTD	9,053	635.000	5,748,655.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	26,490	127.400	3,374,826.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	179.100	836,755.200	
イスラエル・シュケル 小計		725,874		29,834,559.540 (1,125,058,257)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	28,306	51.190	1,448,984.140	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	502,599	21.440	10,775,722.560	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	234,609	21.160	4,964,326.440	
	TELSTRA GROUP LTD	599,853	3.900	2,339,426.700	
	ASX LTD	31,066	57.640	1,790,644.240	
	BHP GROUP LTD	702,987	44.730	31,444,608.510	
	AMPOL LTD	31,828	32.070	1,020,723.960	
	COMPUTERSHARE LT	69,013	25.820	1,781,915.660	
	CSL LIMITED	66,595	254.270	16,933,110.650	
	REA GROUP LTD	6,134	164.060	1,006,344.040	
	TRANSURBAN GROUP	450,346	12.720	5,728,401.120	
	COCHLEAR LTD	7,969	259.240	2,065,883.560	
	ORIGIN ENERGY LTD	257,692	9.210	2,373,343.320	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	233,216	100.640	23,470,858.240	
	RIO TINTO LIMITED	54,047	113.790	6,150,008.130	
	APA GROUP	164,300	8.310	1,365,333.000	
	ARISTOCRAT LEISU	89,945	40.880	3,676,951.600	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	360,082	5.530	1,991,253.460	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	41.580	2,526,691.860	
	IGO LTD	91,947	11.460	1,053,712.620	
ORICA LTD	63,862	15.640	998,801.680		
LEND LEASE CORP LTD	107,181	6.910	740,620.710		
BLUESCOPE STEEL LTD	75,503	19.530	1,474,573.590		

	MACQUARIE GROUP LTD	50,207	169.940	8,532,177.580	
	SUNCORP GROUP LTD	158,081	13.730	2,170,452.130	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	447,363	29.290	13,103,262.270	
	NEWCREST MINING LTD	126,686	25.280	3,202,622.080	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.030	566,674.770	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	215,572	15.770	3,399,570.440	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	162,629	11.260	1,831,202.540	
	REECE LTD	31,558	18.600	586,978.800	
	SANTOS LTD	485,603	7.750	3,763,423.250	
	SONIC HEALTHCARE	64,897	30.170	1,957,942.490	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	34.020	884,009.700	
	WESFARMERS LTD	155,701	52.660	8,199,214.660	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	262,185	35.910	9,415,063.350	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	169,400	37.920	6,423,648.000	
	SEEK LTD	35,880	22.740	815,911.200	
	MINERAL RESOURCES LTD	28,198	61.720	1,740,380.560	
	BRAMBLES LTD	170,377	14.320	2,439,798.640	
	PILBARA MINERALS LTD	404,496	4.040	1,634,163.840	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.670	817,855.830	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	87,104	11.780	1,026,085.120	
	XERO LTD	17,754	119.740	2,125,863.960	
	IDP EDUCATION LTD	44,923	22.700	1,019,752.100	
	LOTTERY CORP LTD	291,270	4.810	1,401,008.700	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	233,640	5.320	1,242,964.800	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	430,039	25.650	11,030,500.350	
	MEDIBANK PVT LTD	412,751	3.510	1,448,756.010	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	3.430	2,046,660.420	
	COLES GROUP LTD	203,490	15.670	3,188,688.300	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,310	64.800	1,380,888.000	
	オーストラリア・ドル 小計	9,959,148		224,517,759.680 (21,504,311,022)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	67,555	64.640	4,366,755.200	
	BARRICK GOLD CORP	239,565	20.690	4,956,599.850	
	BANK OF MONTREAL	99,353	112.100	11,137,471.300	
	BANK OF NOVA SCOTIA	166,984	60.530	10,107,541.520	
	NATIONAL BANK OF CANADA	44,531	89.460	3,983,743.260	
	BCE INC	14,197	52.220	741,367.340	
	BROOKFIELD CORP	204,437	45.320	9,265,084.840	
	SAPUTO INC	34,582	28.020	968,987.640	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	8.100	747,719.100	

DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	101.250	1,165,185.000	
CGI INC	31,363	137.990	4,327,780.370	
CCL INDUSTRIES INC	21,058	56.660	1,193,146.280	
CAE INC	40,808	31.750	1,295,654.000	
CAMECO CORP	58,355	50.600	2,952,763.000	
ROGERS COMM-CL B	53,428	54.250	2,898,469.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	131,160	51.890	6,805,892.400	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	153,634	88.570	13,607,363.380	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	8,857	143.560	1,271,510.920	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	30.110	491,696.300	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	80,815	148.390	11,992,137.850	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	40.160	871,994.080	
OPEN TEXT CORP	40,459	49.000	1,982,491.000	
EMPIRE CO LTD	20,608	37.820	779,394.560	
KINROSS GOLD CORP	193,561	6.700	1,296,858.700	
RB GLOBAL INC	26,641	91.600	2,440,315.600	
FORTIS INC	71,759	55.390	3,974,731.010	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	85,421	31.500	2,690,761.500	
TELUS CORP	31,890	22.920	730,918.800	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	38.960	1,332,743.680	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	81.950	2,232,809.700	
ENBRIDGE INC	296,376	44.610	13,221,333.360	
IGM FINANCIAL INC	12,478	34.400	429,243.200	
MANULIFE FINANCIAL CORP	265,111	25.520	6,765,632.720	
LOBLAW CO LTD	21,229	116.110	2,464,899.190	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	112,792	74.340	8,384,957.280	
MAGNA INTERNATIONAL INC	34,858	74.260	2,588,555.080	
SUN LIFE FINANCIAL INC	81,434	67.600	5,504,938.400	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,229	1,139.520	3,679,510.080	
METRO INC	27,929	72.370	2,021,221.730	
EMERA INC	36,998	48.750	1,803,652.500	
ONEX CORP	10,157	81.360	826,373.520	
PAN AMERICAN SILVER CORP	55,373	19.800	1,096,385.400	
POWER CORP OF CANADA	87,955	35.230	3,098,654.650	
QUEBECOR INC-B	17,195	29.670	510,175.650	
ROYAL BANK OF CANADA	194,165	116.380	22,596,922.700	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	128,591	99.740	12,825,666.340	
STANTEC INC	11,917	91.080	1,085,400.360	
SUNCOR ENERGY INC	181,890	45.880	8,345,113.200	
LUNDIN MINING CORP	77,139	9.760	752,876.640	
TECK RESOURCES LTD-CL B	66,934	55.940	3,744,287.960	
THOMSON REUTERS CORP	22,378	173.570	3,884,149.460	

	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,166	112.020	1,026,775.320	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	256,201	81.420	20,859,885.420	
	TC ENERGY CORP	148,310	47.670	7,069,937.700	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	92.950	753,080.900	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,839	150.850	1,484,213.150	
	INTACT FINANCIAL CORP	23,992	200.700	4,815,194.400	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	55,704	56.450	3,144,490.800	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,768	2,870.460	7,945,433.280	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	25,662	186.050	4,774,415.100	
	TOURMALINE OIL CORP	46,466	69.130	3,212,194.580	
	KEYERA CORP	39,467	32.840	1,296,096.280	
	PARKLAND CORP	15,665	39.760	622,840.400	
	ALTAGAS LTD	33,833	27.110	917,212.630	
	PEMBINA PIPELINE CORP	81,652	41.360	3,377,126.720	
	DOLLARAMA INC	41,354	96.480	3,989,833.920	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	202,950	27.850	5,652,157.500	
	ARC RESOURCES LTD	78,639	21.670	1,704,107.130	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	22.760	777,299.520	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	19.710	1,009,999.530	
	TMX GROUP LTD	35,200	30.500	1,073,600.000	
	BRP INC	4,307	107.820	464,380.740	
	IVANHOE MINES LTD	98,820	11.290	1,115,677.800	
	NUTRIEN LTD	71,801	82.580	5,929,326.580	
	TFI INTERNATIONAL INC	11,591	171.230	1,984,726.930	
	WSP GLOBAL INC	17,782	196.310	3,490,784.420	
	IA FINANCIAL CORP INC	16,448	85.470	1,405,810.560	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	35,667	44.040	1,570,774.680	
	NUVEI CORP	7,929	21.520	170,632.080	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	32.700	526,568.100	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	52,249	45.580	2,381,509.420	
	AIR CANADA	14,871	18.780	279,277.380	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	41,208	87.740	3,615,589.920	
	SHOPIFY INC	165,173	73.720	12,176,553.560	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	201.040	1,052,846.480	
	HYDRO ONE LTD	46,225	36.260	1,676,118.500	
	カナダ・ドル 小計	5,676,241		331,586,308.030 (36,428,071,800)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	171,800	3.870	664,866.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	162,200	4.880	791,536.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	259,510	33.720	8,750,677.200	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	28,400	6.720	190,848.000	
	SEATRIUM LTD	7,235,222	0.128	926,108.410	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	30.490	472,595.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	95,700	9.900	947,430.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.840	639,402.120	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	6.660	1,231,434.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,198	13.000	5,969,574.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,092,930	2.440	2,666,749.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	244,000	6.400	1,561,600.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	183,066	28.500	5,217,381.000	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.530	284,708.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	3.730	964,205.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	431,290	3.130	1,349,937.700	
	シンガポール・ドル 小計	11,627,009		32,629,051.630 (3,573,860,025)	
スイス・フラン	LOGITECH INTL-REG	23,734	64.120	1,521,824.080	
	NESTLE SA-REGISTERED	373,312	105.160	39,257,489.920	
	CIE FINANC RICHEMONT	72,123	109.300	7,883,043.900	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	97,873	254.050	24,864,635.650	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,311	186.200	988,908.200	
	SIKA INHABER	21,046	234.600	4,937,391.600	
	SGS SA-REG	23,250	78.640	1,828,380.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	286,738	89.680	25,714,663.840	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,830	129.500	754,985.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,440.000	662,400.000	
	CLARIANT AG-REG	23,316	13.590	316,864.440	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	548.000	1,880,188.000	
	ABB LTD	219,922	33.380	7,340,996.360	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	37.000	734,154.000	
	GEBERIT AG	4,211	462.600	1,948,008.600	
	LONZA GROUP AG-REG	10,006	432.200	4,324,593.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	137	9,900.000	1,356,300.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	16	98,200.000	1,571,200.000	
	GIVAUDAN-REG	1,257	2,892.000	3,635,244.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	21,465	427.400	9,174,141.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	4,810	273.200	1,314,092.000	
	HOLCIM LTD	70,371	58.040	4,084,332.840	
	TEMENOS GROUP	7,082	64.460	456,505.720	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	71.750	335,287.750	
	SONOVA HOLDING AG	6,685	219.200	1,465,352.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	7,890	261.800	2,065,602.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	16,536	118.500	1,959,516.000	

	THE SWATCH GROUP AG-B	4,157	234.400	974,400.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	44.650	413,414.350	
	HELVETIA HOLDING AG	4,906	129.100	633,364.600	
	SCHINDLER NAMEN	4,276	180.800	773,100.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,848	582.800	2,242,614.400	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	98.700	483,926.100	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	618.000	500,580.000	
	SWISS PRIME SITE AG	9,861	85.700	845,087.700	
	DUFREY GROUP	12,933	32.010	413,985.330	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,369	1,046.500	3,525,658.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,558	59.340	1,516,611.720	
	SWISS RE LTD	41,653	97.280	4,052,003.840	
	BKW AG	3,194	159.000	507,846.000	
	SIG GROUP AG	38,322	21.700	831,587.400	
	ALCON INC	72,016	68.040	4,899,968.640	
	SANDOZ GROUP AG	57,347	25.760	1,477,258.720	
	UBS GROUP AG	455,603	22.690	10,337,632.070	
	VAT GROUP AG	4,053	334.800	1,356,944.400	
スイス・フラン	小計	2,087,395		188,162,085.470 (31,161,522,975)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	382,550	150.650	57,631,157.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	196,242	132.000	25,903,944.000	
	ERICSSON LM-B SHS	418,000	53.320	22,287,760.000	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	203.400	5,238,567.000	
	LUNDBERGS B	14,161	469.800	6,652,837.800	
	SKF AB-B SHS	46,594	184.700	8,605,911.800	
	SANDVIK AB	150,884	201.700	30,433,302.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	222,348	134.800	29,972,510.400	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	179.850	7,902,069.450	
	SWEDBANK AB	110,760	207.600	22,993,776.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	92,465	158.600	14,664,949.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	216,734	99.180	21,495,678.120	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	230.000	5,565,540.000	
	VOLVO AB-B SHS	221,062	227.800	50,357,923.600	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	437.500	4,437,125.000	
	TELE2 AB-B SHS	67,654	84.420	5,711,350.680	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	292.600	4,474,439.200	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	291.600	6,218,370.000	
	SAAB AB-B	11,789	578.000	6,814,042.000	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	90.760	6,905,474.600	
	INVESTOR AB-B SHS	246,861	216.950	53,556,493.950	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	79,621	151.280	12,045,064.880	
	ASSA ABLOY AB-B	133,962	247.700	33,182,387.400	
	TELIA CO AB	344,810	23.710	8,175,445.100	

	BOLIDEN AB	36,260	307.750	11,159,015.000	
	ALFA LAVAL AB	44,259	374.200	16,561,717.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	50.440	3,679,194.480	
	INDUTRADE AB	39,178	205.000	8,031,490.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	82.800	3,955,273.200	
	NIBE INDUSTRIER AB	212,832	70.500	15,004,656.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	17,403	221.000	3,846,063.000	
	HEXAGON AB-B SHS	303,304	98.200	29,784,452.800	
	SAGAX AB	28,022	211.200	5,918,246.400	
	EPIROC AB-A	79,158	210.800	16,686,506.400	
	EPIROC AB-B	61,487	178.300	10,963,132.100	
	ESSITY AB-B	86,900	236.700	20,569,230.000	
	EQT AB	55,194	218.000	12,032,292.000	
	VOLVO CAR AB	63,710	44.650	2,844,651.500	
	BEIJER REF AB	50,493	112.800	5,695,610.400	
	LIFCO AB	39,479	195.500	7,718,144.500	
	EVOLUTION AB	25,280	1,101.000	27,833,280.000	
	NORDEA BANK ABP	457,613	123.560	56,542,662.280	
	INVESTMENT AB LATOUR	27,638	196.000	5,417,048.000	
スウェーデン・クローナ 小計		4,922,152		715,468,786.140 (9,794,767,682)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	14,635	908.600	13,297,361.000	
	A P MOLLER A/S	663	12,615.000	8,363,745.000	
	AP MOLLER MAERSK A	520	12,430.000	6,463,600.000	
	DANSKE BANK A/S	101,212	164.550	16,654,434.600	
	GENMAB A/S	9,624	2,487.000	23,934,888.000	
	NOVOZYMES-B SHS	29,795	291.600	8,688,222.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,675.000	1,462,275.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	454,459	681.800	309,850,146.200	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	140,190	148.060	20,756,531.400	
	COLOPLAST-B	17,884	727.800	13,015,975.200	
	DSV A/S	24,601	1,291.000	31,759,891.000	
	DEMANT A/S	11,367	277.400	3,153,205.800	
	TRYG A/S	44,887	130.100	5,839,798.700	
	PANDORA A/S	12,473	820.000	10,227,860.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	16,295	445.200	7,254,534.000	
ORSTED A/S	26,911	371.400	9,994,745.400		
デンマーク・クローネ 小計		906,389		490,717,213.300 (10,432,647,955)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.860	1,291,720.260	
	EBOS GROUP LTD	25,631	35.000	897,085.000	
	FISHER & PAYKEL	78,460	21.910	1,719,058.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.890	1,071,095.820	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	6.155	386,743.270	
	MERIDIAN ENERGY LTD	239,308	5.200	1,244,401.600	

ニュージーランド・ドル 小計		789,612		6,610,104.550 (593,719,591)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	56,375	187.800	10,587,225.000	
	NORSK HYDRO ASA	210,898	62.240	13,126,291.520	
	TELENOR ASA	117,313	120.550	14,142,082.150	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	467.000	5,223,395.000	
	ORKLA ASA	116,068	80.300	9,320,260.400	
	EQUINOR ASA	132,805	360.800	47,916,044.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	397.800	7,889,965.200	
	AKER BP ASA	50,741	304.600	15,455,708.600	
	SALMAR ASA	7,248	544.200	3,944,361.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	157.800	4,058,773.800	
	ADEVINTA ASA	24,382	107.500	2,621,065.000	
	DNB BANK ASA	139,232	218.300	30,394,345.600	
ノルウェー・クローネ 小計		911,802		164,679,517.870 (2,264,343,371)	
ユーロ	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	25,007	159.550	3,989,866.850	
	KERRY GROUP PLC-A	20,033	75.820	1,518,902.060	
	KINGSPAN GROUP PLC	21,860	70.880	1,549,436.800	
	UMICORE	34,853	21.990	766,417.470	
	AIR LIQUIDE	73,085	163.300	11,934,780.500	
	AIRBUS SE	82,761	126.320	10,454,369.520	
	AXA SA	260,350	28.560	7,435,596.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	99,848	26.770	2,672,930.960	
	ADIDAS AG	21,616	169.660	3,667,370.560	
	ASSICURAZIONI GENERALI	144,613	19.045	2,754,154.580	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	184.900	576,888.000	
	DANONE	86,012	54.650	4,700,555.800	
	SAFRAN SA	48,802	152.060	7,420,832.120	
	INTESA SANPAOLO	2,067,102	2.443	5,049,930.180	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	41,014	98.500	4,039,879.000	
	ACCOR SA	29,321	32.190	943,842.990	
	BOUYGUES	29,123	32.390	943,293.970	
	BNP PARIBAS	143,189	60.240	8,625,705.360	
	THALES SA	15,023	139.000	2,088,197.000	
	CAPGEMINI SA	22,114	170.050	3,760,485.700	
	LOTUS BAKERIES NV	30	7,180.000	215,400.000	
	UNICREDIT SPA	266,042	22.950	6,105,663.900	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	12,755	92.100	1,174,735.500	
	D'IETEREN TRDG	2,736	158.400	433,382.400	
	COMMERZBANK AG	141,036	10.395	1,466,069.220	
	EIFFAGE	11,784	88.600	1,044,062.400	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	58,814	25.510	1,500,345.140	
PUBLICIS GROUPE	33,221	73.340	2,436,428.140		

IBERDROLA SA	847,500	10.635	9,013,162.500	
ENI SPA	334,555	15.086	5,047,096.730	
JERONIMO MARTINS	45,606	20.180	920,329.080	
KESKO OYJ-B	35,252	16.230	572,139.960	
KBC GROUPE	35,962	57.900	2,082,199.800	
HANNOVER RUECK SE	8,405	207.500	1,744,037.500	
WARTSILA OYJ	77,148	10.600	817,768.800	
L'OREAL	33,633	396.800	13,345,574.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	38,454	686.100	26,383,289.400	
GEA GROUP AG	24,987	33.890	846,809.430	
BOLLORE	114,808	5.135	589,539.080	
MEDIOBANCA SPA	86,792	12.190	1,057,994.480	
MICHELIN(CGDE) -B	98,907	29.480	2,915,778.360	
CONTINENTAL AG	17,450	65.560	1,144,022.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	133,895	39.040	5,227,260.800	
OMV AG	23,354	43.770	1,022,204.580	
VERBUND AG	10,663	81.750	871,700.250	
PERNOD-RICARD	27,460	160.300	4,401,838.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	23,311	47.160	1,099,346.760	
RENAULT SA	27,902	37.465	1,045,348.430	
REPSOL SA	167,595	14.525	2,434,317.370	
REMY COINTREAU	2,866	112.600	322,711.600	
MERCK KGAA	18,389	155.500	2,859,489.500	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	60,581	55.040	3,334,378.240	
RWE AG	92,342	34.630	3,197,803.460	
SEB SA	2,596	89.350	231,952.600	
SOCIETE GENERALE-A	104,069	22.600	2,351,959.400	
VINCI S.A.	73,205	105.500	7,723,127.500	
SODEXO	12,910	98.340	1,269,569.400	
SOFINA	2,281	192.200	438,408.200	
SOLVAY SA	11,217	102.750	1,152,546.750	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	75,267	157.260	11,836,488.420	
VIVENDI SE	98,944	8.558	846,762.750	
SAP SE	145,473	124.840	18,160,849.320	
TELEFONICA S.A	750,387	3.867	2,901,746.520	
TOTALENERGIES SE	314,668	61.690	19,411,868.920	
VALEO	26,570	14.345	381,146.650	
E.ON SE	299,003	11.045	3,302,488.130	
VOEST-ALPINE AG	18,032	25.600	461,619.200	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	60.240	805,770.240	
SIEMENS AG-REG	105,449	138.240	14,577,269.760	
UPM-KYMMENE OYJ	77,752	33.630	2,614,799.760	
ING GROEP NV-CVA	489,434	12.862	6,295,100.100	
PUMA AG	11,558	53.740	621,126.920	
BAYER AG	139,086	44.855	6,238,702.530	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	12.405	929,878.800	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,191	67.920	1,643,052.720	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	110,563	64.850	7,170,010.550	
BASF SE	120,584	42.500	5,124,820.000	
BEIERSDORF AG	12,408	123.150	1,528,045.200	
HEIDELBERG MATERIALS AG	21,586	72.940	1,574,482.840	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	32,346	32.740	1,059,008.040	
ASM INTERNATIONAL NV	6,651	394.850	2,626,147.350	
ORANGE	249,830	11.010	2,750,628.300	
SAMPO OYJ-A SHS	64,080	37.480	2,401,718.400	
RANDSTAD NV	15,584	51.040	795,407.360	
ALLIANZ SE	56,407	226.950	12,801,568.650	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	433,193	3.829	1,658,695.990	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	135,085	28.870	3,899,903.950	
HERMES INTL	4,525	1,751.000	7,923,275.000	
ENDESA S.A.	50,946	19.300	983,257.800	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.294	527,662.540	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	33.160	1,514,947.760	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	18,810	378.800	7,125,228.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,492	23.105	1,420,772.660	
DASSAULT SYSTEMES SA	91,841	37.050	3,402,709.050	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,284	33.530	780,712.520	
RHEINMETALL STAMM	5,596	261.500	1,463,354.000	
HEINEKEN NV	39,116	84.800	3,317,036.800	
AKZO NOBEL	23,353	68.260	1,594,075.780	
ASML HOLDING NV	56,263	567.100	31,906,747.300	
AEGON LTD	232,433	4.650	1,080,813.450	
VOLKSWAGEN AG	3,315	125.000	414,375.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	31,519	109.280	3,444,396.320	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	809,408	7.782	6,298,813.050	
KERING	10,730	427.950	4,591,903.500	
ACCIONA S.A.	4,432	120.600	534,499.200	
FORTUM OYJ	54,194	11.375	616,456.750	
AGEAS	24,086	39.200	944,171.200	
UCB SA	16,732	80.140	1,340,902.480	
NEMETSCHEK SE	9,878	62.980	622,116.440	
CARREFOUR SA	90,116	15.910	1,433,745.560	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.340	465,612.180	
NOKIA OYJ	745,504	3.447	2,569,752.280	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	135,770	18.050	2,450,648.500	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,944	121.300	4,238,707.200	
SANOFI	158,432	103.320	16,369,194.240	
STMICROELECTRONICS NV	99,472	42.380	4,215,623.360	
ELISA OYJ	20,242	45.010	911,092.420	

BANCO SANTANDER SA	2,306,214	3.610	8,325,432.540	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	67,925	15.055	1,022,610.870	
QIAGEN N.V.	34,306	37.710	1,293,679.260	
DEUTSCHE BANK AG-REG	276,499	10.164	2,810,335.830	
BMW VORZUG	7,821	90.350	706,627.350	
ENEL SPA	1,130,734	5.781	6,536,773.250	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	454,011	20.550	9,329,926.050	
SARTORIUS AG	3,651	320.800	1,171,240.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	186,083	32.710	6,086,774.930	
RATIONAL AG	976	593.500	579,256.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	79.540	387,041.640	
BECHTLE AG	14,521	44.880	651,702.480	
KONINKLIJKE KPN NV	504,342	3.157	1,592,207.690	
EUROFINS SCIENTIFIC	17,824	51.940	925,778.560	
TELEPERFORMANCE	7,845	119.350	936,300.750	
DEUTSCHE BOERSE AG	27,549	162.400	4,473,957.600	
EURAZEO	5,673	56.350	319,673.550	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,918	71.620	925,187.160	
HEINEKEN HOLDING NV-A	17,690	72.300	1,278,987.000	
INDITEX	158,488	34.620	5,486,854.560	
ESSILORLUXOTTICA	40,566	166.520	6,755,050.320	
SNAM SPA	255,861	4.520	1,156,491.720	
CREDIT AGRICOLE SA	166,921	11.678	1,949,303.430	
ENAGAS	38,270	16.210	620,356.700	
WENDEL	5,449	74.900	408,130.100	
TENARIS SA	73,186	15.285	1,118,648.010	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.271	246,145.500	
TERNA SPA	207,655	7.274	1,510,482.470	
BIOMERIEUX	4,870	90.860	442,488.200	
GRIFOLS SA	31,982	12.040	385,063.280	
NESTE OYJ	56,094	31.020	1,740,035.880	
RECORDATI SPA	17,680	45.260	800,196.800	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	52,583	11.235	590,770.000	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	170.950	1,246,909.300	
KONE OYJ	49,300	39.640	1,954,252.000	
ELIA GROUP	4,078	92.150	375,787.700	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,855	228.900	882,409.500	
ENGIE	257,314	14.732	3,790,749.840	
ALSTOM	47,494	13.405	636,657.070	
IPSEN SA	5,964	121.500	724,626.000	
ARKEMA SA	6,874	91.240	627,183.760	
WACKER-CHEMIE GMBH	2,991	126.750	379,109.250	
LEGRAND SA	34,487	87.600	3,021,061.200	
AMPLIFON SPA	20,249	27.140	549,557.860	
ADP	3,975	107.900	428,902.500	
ORION OYJ	13,559	39.040	529,343.360	

METSO CORPORATION	106,064	9.730	1,032,002.720	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	14.135	839,703.810	
SYMRISE AG	19,815	92.540	1,833,680.100	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	40,316	31.840	1,283,661.440	
PRYSMIAN SPA	38,343	36.930	1,416,006.990	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	85.500	207,679.500	
CAIXABANK	565,553	3.846	2,175,116.830	
BUREAU VERITAS SA	39,729	23.760	943,961.040	
GETLINK	39,460	14.955	590,124.300	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	14.990	594,923.120	
AMADEUS IT GROUP SA	59,813	57.700	3,451,210.100	
BRENTAG SE	21,559	71.700	1,545,780.300	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	17.260	426,097.620	
EDENRED	35,618	53.580	1,908,412.440	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	137,436	1.713	235,427.860	
TALANX AG	11,451	60.050	687,632.550	
LEG IMMOBILIEN SE	11,915	62.580	745,640.700	
VONOVIA SE	107,034	23.150	2,477,837.100	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	160,579	9.452	1,517,792.700	
KNORR-BREMSE AG	10,342	56.680	586,184.560	
OCI NV	12,329	26.300	324,252.700	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	39,737	47.890	1,903,004.930	
FERRARI NV	17,998	291.600	5,248,216.800	
ASR NEDERLAND NV	18,181	36.870	670,333.470	
CNH INDUSTRIAL NV	143,842	11.420	1,642,675.640	
AIB GROUP PLC	226,914	4.232	960,300.040	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	30.880	534,007.840	
MONCLER SPA	29,763	53.900	1,604,225.700	
NEXI SPA	83,576	5.822	486,579.470	
PROSUS NV	210,283	28.755	6,046,687.660	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	90.120	1,367,480.880	
JDE PEET'S BV	14,385	26.880	386,668.800	
EXOR NV	14,142	85.220	1,205,181.240	
SIEMENS ENERGY AG	74,892	12.200	913,682.400	
EURONEXT NV	14,089	67.850	955,938.650	
IMCD NV	8,848	117.600	1,040,524.800	
WORLDLINE SA	36,232	24.240	878,263.680	
NN GROUP NV	36,289	31.640	1,148,183.960	
FINECOBANK SPA	93,118	11.065	1,030,350.670	
ARGENX SE	8,116	474.600	3,851,853.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	114,291	25.330	2,894,991.030	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	71,674	31.430	2,252,713.820	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	24.900	244,567.800	
DSM-FIRMENICH AG	24,488	78.360	1,918,879.680	

	ZALANDO SE	31,321	22.160	694,073.360	
	STELLANTIS NV	302,619	18.938	5,730,998.620	
	FERROVIAL SE	75,279	29.220	2,199,652.380	
	AENA SME SA	9,989	139.700	1,395,463.300	
	CELLNEX TELECOM SAU	83,586	30.160	2,520,953.760	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	13.535	715,121.720	
	SCOUT24 SE	10,048	66.020	663,368.960	
	COVESTRO AG	27,558	49.810	1,372,663.980	
	HELLOFRESH SE	17,856	26.420	471,755.520	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	123,927	51.330	6,361,172.910	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.820	578,289.980	
	AMUNDI SA	12,553	53.700	674,096.100	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	10.630	445,173.770	
	ADYEN NV	3,145	745.300	2,343,968.500	
	DELIVERY HERO SE	22,564	28.485	642,735.540	
ユーロ 小計		24,601,498		632,182,925.250 (100,219,959,140)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	10.760	2,765,320.000	
	CLP HOLDINGS LTD	241,796	57.200	13,830,731.200	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	37.400	3,489,943.600	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	165,591	292.000	48,352,572.000	
	MTR CORP	287,941	31.100	8,954,965.100	
	HANG SENG BANK LTD	120,396	96.450	11,612,194.200	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	20.800	3,556,217.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	212,820	37.700	8,023,314.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	5.610	8,619,237.660	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	322,904	45.800	14,789,003.200	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	498,995	21.600	10,778,292.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	15.080	2,609,835.280	
	SINO LAND CO	659,200	8.750	5,768,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	204,565	85.100	17,408,481.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	54.650	2,897,543.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	204,656	74.350	15,216,173.600	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	9.650	1,717,700.000	
	AIA GROUP LTD	1,610,316	68.800	110,789,740.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	8.230	3,811,609.280	
	SANDS CHINA LTD	335,800	22.600	7,589,080.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	12.600	1,764,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	16.120	3,249,792.000	

WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	256,135	29.850	7,645,629.750	
ESR GROUP LTD	204,800	11.000	2,252,800.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	15.580	4,128,700.000	
WH GROUP LTD	906,000	4.310	3,904,860.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	369,445	41.250	15,239,606.250	
CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	41.600	11,073,712.000	
香港・ドル 小計	10,399,069		351,839,054.020 (6,713,089,151)	
合計	159,403,439		1,062,956,630,858 (1,062,956,630,858)	

(2) 株式以外の有価証券

2023年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	2,968.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計		2,968.000	0.000 (0)	
新株予約権証券 合計			2,968	0 (0)	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,188,920.250	
		GOODMAN GROUP	254,170.000	5,622,240.400	
		GPT GROUP	219,223.000	852,777.470	
		MIRVAC GROUP	474,881.000	1,001,998.910	
		SCENTRE GROUP	595,674.000	1,501,098.480	
		STOCKLAND	369,843.000	1,434,990.840	
	VICINITY CENTRES	545,645.000	960,335.200		
	オーストラリア・ドル 小計		2,623,425.000	12,562,361.550 (1,203,222,988)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,424,888.110	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	452,278.000	1,216,627.820	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		474,100.000	749,078.000		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		405,500.000	555,535.000		
シンガポール・ドル 小計		2,119,109.000	3,946,128.930 (432,219,502)		
投資信託受益証券 合計			4,742,534	1,635,442,490 (1,635,442,490)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,059.000	2,441,026.140	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,482,099.780	
		AMERICAN TOWER CORP	64,773.000	10,727,704.260	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	76,762.000	1,388,624.580	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,014.000	3,373,463.880	
	BOSTON PROPERTIES INC	24,257.000	1,382,406.430	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	12,823.000	1,249,216.660	
	CROWN CASTLE INC	59,438.000	5,619,268.520	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	42,218.000	5,252,763.560	
	EQUINIX INC	13,394.000	10,105,237.240	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,598.000	1,738,977.240	
	EQUITY RESIDENTIAL	52,518.000	3,189,943.320	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,774.000	2,172,760.200	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	30,987.000	3,788,160.750	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	34,797.000	1,642,766.370	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,831.000	977,003.170	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	86,248.000	1,564,538.720	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,484,034.090	
	INVITATION HOMES INC	86,531.000	2,849,465.830	
	IRON MOUNTAIN INC	39,185.000	2,383,623.550	
	KIMCO REALTY	94,921.000	1,651,625.400	
	MID AMERICA	17,377.000	2,328,865.540	
	PROLOGIS INC	128,697.000	14,465,542.800	
	PUBLIC STORAGE	21,773.000	6,004,557.940	
	REALTY INCOME CORP	93,882.000	4,783,287.900	
	REGENCY CENTERS CORP	20,773.000	1,245,756.810	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	14,329.000	2,888,726.400	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	46,844.000	5,074,610.520	
	SUN COMMUNITIES INC	18,505.000	2,015,194.500	
	UDR INC	41,516.000	1,528,203.960	
	VENTAS INC	52,346.000	2,256,636.060	
	VICI PROPERTIES INC	140,502.000	4,125,138.720	
	WELLTOWER INC	70,141.000	6,018,799.210	
	WEYERHAEUSER CO	102,315.000	3,135,954.750	
	WP CAREY INC	26,416.000	1,437,558.720	
アメリカ・ドル	小計	1,792,498.000	123,773,543.520 (18,474,439,105)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	61,971.000	377,527.330	
	SEGRO PLC	165,081.000	1,229,853.450	
イギリス・ポンド	小計	227,052.000	1,607,380.780 (295,436,587)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	404,700.800	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	266,267.040	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	670,967.840 (73,712,527)	

ユーロ	COVIVIO	5,066.000	207,706.000	
	GECINA SA	4,647.000	450,759.000	
	KLEPIERRE	25,279.000	578,636.310	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	18,477.000	855,854.640	
	WAREHOUSES DE PAUW	20,146.000	478,266.040	
ユーロ 小計		73,615.000	2,571,221.990 (407,615,822)	
香港・ドル	LINK REIT	349,516.000	13,176,753.200	
香港・ドル 小計		349,516.000	13,176,753.200 (251,412,451)	
投資証券 合計		2,465,827	19,502,616,492 (19,502,616,492)	
合計			21,138,058,982 (21,138,058,982)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証券 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 605銘柄	71.80	-	-	-	74.74
	投資証券 35銘柄	-	-	-	1.68	
イギリス・ポンド	株式 81銘柄	4.30	-	-	-	4.40
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	1.95	-	-	-	2.09
	投資信託受益証券 7銘柄	-	-	0.11	-	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.30	-	-	-	3.37
	新株予約権証券 1銘柄	-	0.00	-	-	
	投資証券 2銘柄	-	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.32	-	-	-	0.37
	投資信託受益証券 4銘柄	-	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.83	-	-	-	2.87
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	0.89	-	-	-	0.90
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.95	-	-	-	0.96
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.05	-	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.21	-	-	-	0.21
ユーロ	株式 222銘柄	9.09	-	-	-	9.28

	投資証券	5銘柄	-	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.61	-	-	-	0.64
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.02	

(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10月31日現在

資産総額	26,763,222,678円
負債総額	17,329,083円
純資産総額(-)	26,745,893,595円
発行済数量	3,643,867,958口
1口当たり純資産額(/)	7.3400円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産総額	1,058,737,462,984円
負債総額	1,004,455,722円
純資産総額(-)	1,057,733,007,262円
発行済数量	151,680,858,460口
1口当たり純資産額(/)	6.9734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10月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2023年10月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,479,197,039,659
追加型株式投資信託	780	14,682,815,646,282
単位型公社債投資信託	21	35,110,885,684
単位型株式投資信託	208	1,060,283,148,398
合計	1,035	17,257,406,720,023

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38期事業年度（自2022年4月1日至2023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39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,109	1,001
器具備品	158	118
リース資産	-	7
無形固定資産		
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産		
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位:百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(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	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
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	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

（単位：百万円）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）		第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	1	559	1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		-
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		-		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		-		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		-
投資有価証券売却益		-		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		-
オフィス再編費用	2	509		-
関係会社株式評価損		-		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

（ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

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	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

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							12,360	12,360	12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			12,360
当期純利益			13,821
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	1,461
当期末残高	0	0	79,034

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(リース資産を除く) 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(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)に基づく定額法を採用しております。</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、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2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。）を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、（金融商品会計）注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27 - 3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	-	1

（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37期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
受取配当金	543	2,393

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

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					

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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
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

2023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
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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	-

第38期（2023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	29,184	29,184	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,186	29,186	-

(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	-	-

第38期（2023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	33,770	-	-	-
(2) 金銭の信託	29,184	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,279	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,307	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	82,540	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

第37期（2022年3月31日現在）

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。

第38期（2023年3月31日現在）

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	-	29,184	-	29,184
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

（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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023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	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円)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 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 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。

第38期(2023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 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 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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	14	31
退職給付の支払額	185	191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

（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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	35	44
未認識過去勤務費用	33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	3	4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

(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20百万円、当事業年度において24百万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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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% ~ 3.56%

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97百万円、当事業年度103百万円であります。

（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37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額（一括償却資産）	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額（税法上）	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,092	2,895
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

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

	第37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
法定実効税率	-	30.62 %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	3.69 %
その他	-	0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	26.87 %

（注）前事業年度は、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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

(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	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

(2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,429百万円	8,039百万円
経常利益	8,429百万円	8,039百万円
税引前当期純利益	8,429百万円	8,039百万円
当期純利益	7,015百万円	6,744百万円
1株当たり当期純利益	175,380円68銭	168,617円97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	4,618百万円	4,228百万円

（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

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）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬（注）	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023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。

（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。

(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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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	7,474	未払 手数料	1,579
	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	13,932	未払 手数料	2,404

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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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	15,499百万円	13,821百万円
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39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,013
金銭の信託		28,384
未収委託者報酬		17,669
未収運用受託報酬		3,747
未収投資助言報酬		305
未収収益		13
前払費用		1,318
その他		2,504
	流動資産計	81,956
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	947
器具備品	1	100
リース資産	1	6
無形固定資産		
ソフトウェア		4,959
ソフトウェア仮勘定		2,954
電話加入権		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		8,557
関係会社株式		184
長期差入保証金		4,888
長期差入保証金		772
繰延税金資産		2,592
その他		120
	固定資産計	14,572
資産合計		96,529

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	418
リース債務	1
未払金	7,850
未払収益分配金	1
未払償還金	0
未払手数料	7,654
その他未払金	193
未払費用	7,452
未払法人税等	2,372
未払消費税等	1,076
契約負債	20
賞与引当金	861
役員賞与引当金	26
流動負債計	20,081
固定負債	
リース債務	5
退職給付引当金	2,701
時効後支払損引当金	72
固定負債計	2,780
負債合計	22,861
(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	52,115
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,991
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,311
株主資本計	73,668
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	73,668
負債・純資産合計	96,529

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	49,984	
運用受託報酬	8,063	
投資助言報酬	1,082	
その他営業収益	13	
		営業収益計 59,144
営業費用		
支払手数料	21,623	
広告宣伝費	107	
公告費	0	
調査費	17,657	
調査費	6,728	
委託調査費	10,928	
委託計算費	280	
営業雑経費	372	
通信費	17	
印刷費	253	
協会費	33	
諸会費	29	
支払販売手数料	38	
		営業費用計 40,042
一般管理費		
給料	4,831	
役員報酬	77	
給料・手当	4,735	
賞与	19	
交際費	14	
寄付金	3	
旅費交通費	63	
租税公課	175	
不動産賃借料	508	
退職給付費用	206	
固定資産減価償却費	1 749	
福利厚生費	17	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	861	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	1,714	
事務用消耗品費	24	
器具備品費	0	
諸経費	120	
		一般管理費計 9,319
営業利益		9,782

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	3	
受取配当金	3	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	35	
雑収入	10	
営業外収益計		53
営業外費用		
為替差損	7	
金銭の信託運用損	785	
早期割増退職金	0	
雑損失	3	
営業外費用計		797
経常利益		9,038
特別損失		
固定資産除却損	2	
関係会社株式評価損	922	
特別損失計		924
税引前中間純利益		8,113
法人税、住民税及び事業税		2,136
法人税等調整額		303
法人税等合計		2,440
中間純利益		5,673

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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	25,678
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,040
中間純利益							5,673
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	-	-	-	-	-	-	5,366
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,311

	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	57,481	79,034	0	0	79,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,040	11,040			11,040
中間純利益	5,673	5,673			5,673
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	5,366	5,366	0	0	5,366
当中間期末残高	52,115	73,668	0	0	73,668

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。</p> <p>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)に基づく定額法を採用しております。</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. 収益及び費用の計上基準

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。

(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。

(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。

(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。

(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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第39期中間会計期間末 （2023年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	577百万円
	器具備品	...	764百万円
	リース資産	...	2百万円

（中間損益計算書関係）

項目	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	71百万円
	無形固定資産	...	678百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19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39期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023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	28,384	28,384	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,386	28,386	-

（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	-	28,384	-	28,384
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,386	-	28,386

（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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（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	182
関係会社株式	
非上場株式	4,888

（有価証券関係）

第39期中間会計期間末

（2023年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額4,888百万円）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

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182百万円）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

2023年4月1日から2023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	65,400百万円
資産合計	65,400百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	3,358百万円
負債合計	3,358百万円
純資産	62,041百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額49,546百万円及び顧客関連資産の金額19,028百万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	3,824百万円
経常利益	3,824百万円
税引前中間純利益	3,824百万円
中間純利益	3,237百万円
1株当たり中間純利益	80,925円14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1,918百万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39期中間会計期間
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

委託者報酬	49,984百万円
運用受託報酬	7,464百万円
投資助言報酬	1,082百万円
成功報酬(注)	599百万円
その他営業収益	13百万円
合計	59,144百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬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)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,841,700円33銭
1株当たり中間純利益金額	141,837円37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39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益金額	5,673百万円
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	5,673百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

(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（2023年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
水戸証券株式会社	12,272	「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2023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)募集販売の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【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
2023年1月12日	有価証券報告書
2023年1月12日	有価証券届出書
2023年7月12日	半期報告書
2023年7月12日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

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

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2023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。

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12月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM外国株式パッシブ・ファンドの2022年10月13日から2023年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAM外国株式パッシブ・ファンドの2023年10月12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

2023年11月22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 森重 俊寛指定有限責任社員
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2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間(2023年4月1日から2023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2023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(2023年4月1日から2023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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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データは監査の対象には含まれておりません。