

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月2日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券に係るファ ンドの名称】	ハイブリッド証券ファンド米ドルコース ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース ハイブリッド証券ファンド中国元コース ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券の金額】	ハイブリッド証券ファンド米ドルコース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンド中国元コース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース 3兆円を上限とします。 ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

2022年12月28日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について、「ハイブリッド証券ファンド」を構成するファンドのうち、「ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース」が2023年3月6日付で繰上償還することに伴う記載の変更、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

**2【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

&lt;訂正前&gt;

ファンドの正式名称	略 称	
ハイブリッド証券ファンド米ドルコース	米ドルコース	各通貨 コース
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース	豪ドルコース	
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース	ブラジルリアルコース	
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース	ロシアルーブルコース	
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース	インドルピーコース	
ハイブリッド証券ファンド中国元コース	中国元コース	
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース	南アフリカランドコース	
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース	メキシコペソコース	
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース	トルコリラコース	
ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド	マネープールファンド	

それぞれのファンドを「ファンド」または「当ファンド」あるいは「各ファンド」という場合があります。また、ファンドについて、それぞれ上記に対応する表中の略称を使用する場合、「米ドルコース」「豪ドルコース」「ブラジルリアルコース」「ロシアルーブルコース」「インドルピーコース」「中国元コース」「南アフリカランドコース」「メキシコペソコース」「トルコリラコース」を総称して「各通貨コース」という場合があります。

(略)

&lt;訂正後&gt;

ファンドの正式名称	略 称	
ハイブリッド証券ファンド米ドルコース	米ドルコース	各通貨 コース
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース	豪ドルコース	
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース	ブラジルリアルコース	
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース	インドルピーコース	
ハイブリッド証券ファンド中国元コース	中国元コース	
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース	南アフリカランドコース	
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース	メキシコペソコース	
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース	トルコリラコース	
ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド	マネープールファンド	

それぞれのファンドを「ファンド」または「当ファンド」あるいは「各ファンド」という場合があります。また、ファンドについて、それぞれ上記に対応する表中の略称を使用する場合、「米ドルコース」「豪ドルコース」「ブラジルリアルコース」「インドルピーコース」「中国元コース」「南アフリカランドコース」「メキシコペソコース」「トルコリラコース」を総称して「各通貨コース」という場合があります。

(略)

## (7)【申込期間】

## &lt;訂正前&gt;

2023年1月13日から2024年1月12日までです。(注)

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(注) ロシアルールコースにおいて繰上償還(信託終了)が決定した場合には、当該コースの購入の申込期間は2023年3月1日までとなります。

## &lt;訂正後&gt;

2023年1月13日から2024年1月12日までです。

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

## (12)【その他】

## &lt;訂正前&gt;

(略)

## (八) 振替受益権について

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

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

## &lt;繰上償還(信託終了)の予定について&gt;

ロシアルールコースは、信託契約を解約し、繰上償還(信託終了)するための手続きを行います。

## 1. 繰上償還(信託終了)を行う理由

ロシアルールコースは2009年11月16日に設定し、ケイマン諸島籍外国投資信託 グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト・RUBクラス 円建受益証券(以下、「組入外国籍投信」といいます。)への投資を通じて、主として世界の金融機関が発行する債券や優先証券に実質的に投資を行うとともに、ロシアルールに関する為替取引(米ドル売り、ロシアルール買い)を活用することにより、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行ってまいりました。

しかしながら、ロシアを取り巻く国際的な情勢および同国の信用力やロシアルールの流動性の状況等を鑑み、組入外国籍投信の運用会社は、その裁量により、一時的な対応として、組入外国籍投信のロシアルールに関する為替取引の解消および対円での為替ヘッジを行い、2022年3月22日以降、ロシアルールコースは為替変動の影響が軽減された状況となりました。

その後、弊社ならびに組入外国籍投信の運用会社は、ロシアルールの市況動向等を注視してまいりましたが、2022年10月3日付で、組入外国籍投信の運用会社から、ロシアルールの流動性は依然として低水準にあり、今後も回復の見通しが立たない状態が続いていることから、組入外国籍投信におけるロシアルールに関する為替取引については再開する予定はない旨の連絡を受けました。これを受け、弊社としては、ロシアルールコースの商品性を継続的に維持することが難しく、やむを得ない事情が発生したと判断し、信託約款の規定に基づき繰上償還(信託終了)を行う予定です。

なお、本手続きにおいて、繰上償還が否決された場合、ロシアルーブルコースの運用は継続しますが、組入外国籍投信におけるロシアルーブルに関する為替取引が再開されない場合は、ロシアルーブルコースは、引き続き、ロシアルーブルへの投資効果を楽しむことができない状況が継続することになりますので、ご注意ください。

## 2. 繰上償還(信託終了)の日程

受益者の確定日	2022年12月29日
書面による議決権の行使期限	2023年2月6日まで
書面決議の日(繰上償還(信託終了)の可否が決定される日)	2023年2月7日
繰上償還(信託終了)予定日	2023年3月6日

## 3. 書面による決議(書面決議)について

- ・書面による議決権の行使については、2022年12月29日現在の受益者の皆さまを対象としております。2022年12月30日以降に取得された受益権口数(2022年12月28日以降に取得申込みをされた受益権口数)は書面決議の手続きの対象とはなりませんので、ご了承ください。
- ・書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上の賛成をもって可決されます。また、書面決議において否決された場合には、ロシアルーブルコースの繰上償還(信託終了)は行いません。

書面決議の結果は、2023年2月7日(書面決議の日)以降、委託会社のホームページ(<http://www.am-one.co.jp/>)でご覧いただくか、委託会社または販売会社へお問い合わせいただければご確認いただけます。

<訂正後>

(略)

### (八) 振替受益権について

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

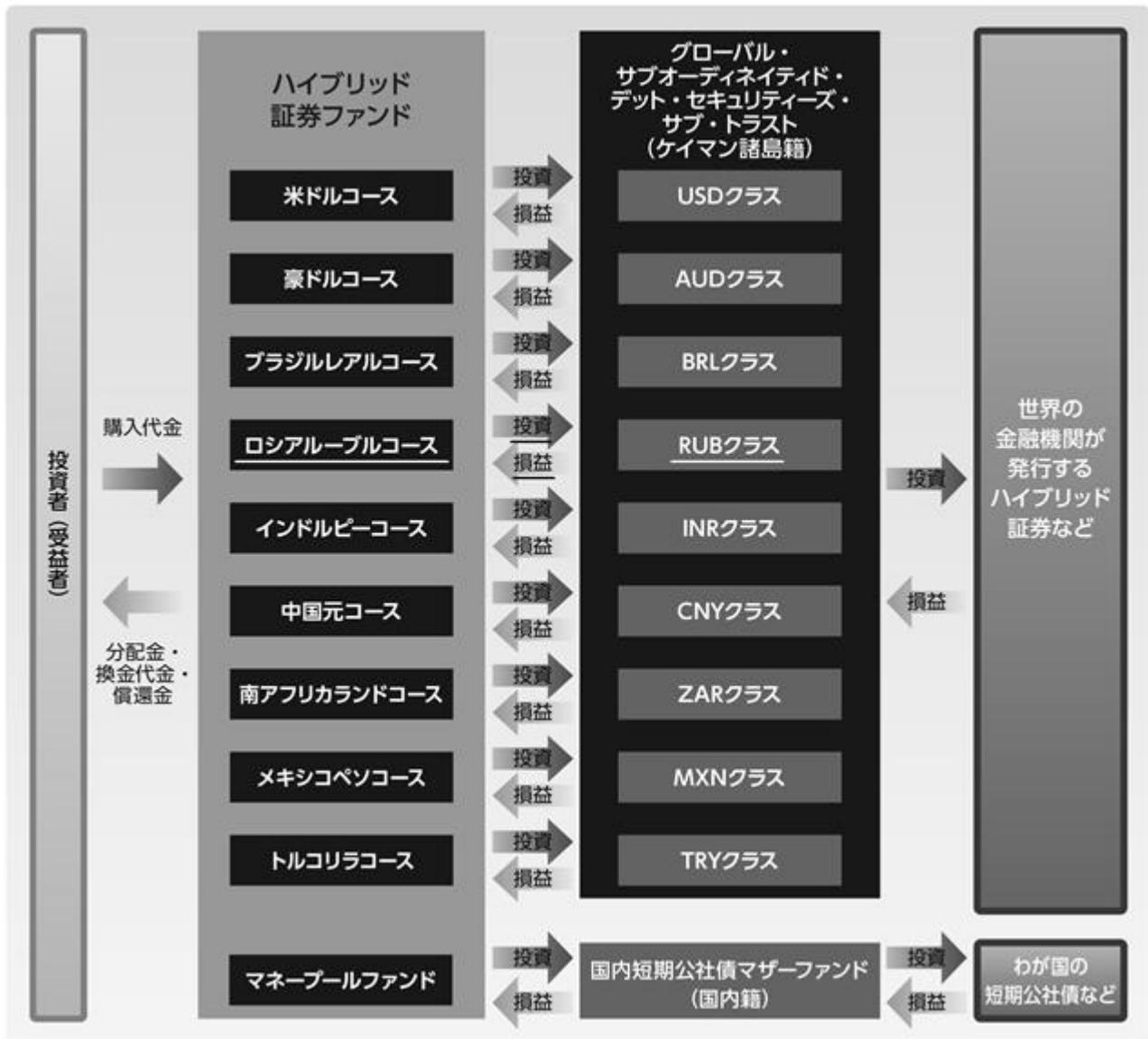
<訂正前>

a. ファンドの目的及び基本的性格

(略)

ファンドの仕組み

(略)



(略)

## b. ファンドの特色

(略)

**2** 投資対象とする外国投資信託における為替取引の対象通貨や決算頻度の違いにより、10の通貨コースとその他にマネープールファンドがあります。また、各通貨コースおよびマネープールファンド間でのスイッチングが可能です。

●通貨コースは以下の10コースから選択できます。



(略)

## ■ 分配方針

## 【各通貨コース】

原則として、毎月12日(休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

●円コース/米ドルコース/豪ドルコース/ブラジルリアルコース/ロシアルーブルコース/インドルピーコース/中国元コース/南アフリカランドコース

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に安定した分配を行うことを目標に委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

「原則として、利子・配当等収益を中心に安定分配を行う」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移することなどを示唆するものではありません。また、基準価額水準、運用の状況などによっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

(略)

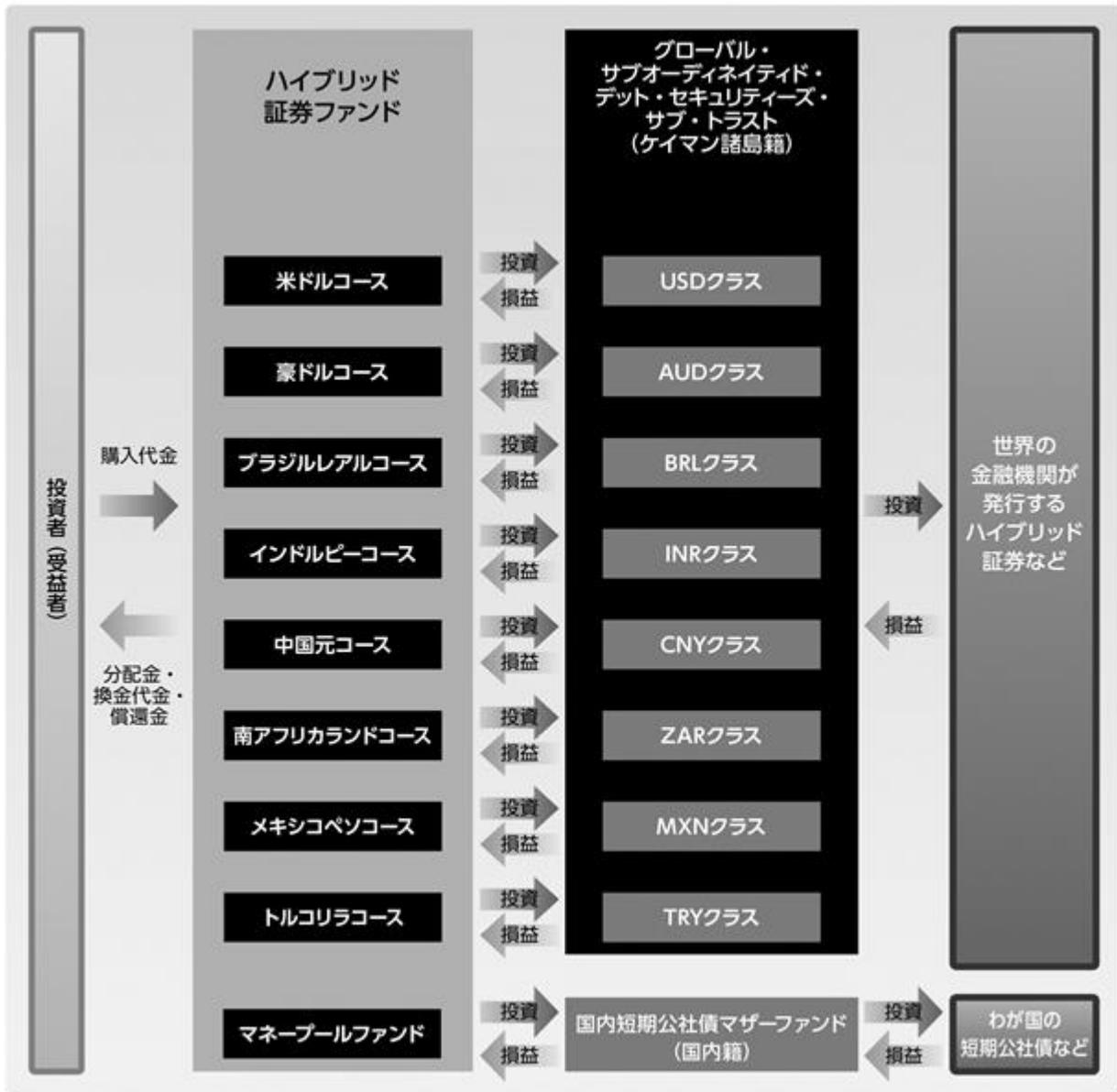
&lt; 訂正後 &gt;

a. ファンドの目的及び基本的性格

(略)

ファンドの仕組み

(略)



(略)

## b. ファンドの特色

(略)

**2** 投資対象とする外国投資信託における為替取引の対象通貨や決算頻度の違いにより、9の通貨コースとその他にマネープールファンドがあります。また、各通貨コースおよびマネープールファンド間でのスイッチングが可能です。

●通貨コースは以下の9コースから選択できます。



(略)

## ■ 分配方針

## 【各通貨コース】

原則として、毎月12日(休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

●円コース/米ドルコース/豪ドルコース/ブラジルリアルコース/インドルピーコース/中国元コース/南アフリカランドコース

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に安定した分配を行うことを目標に委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

〔原則として、利子・配当等収益を中心に安定分配を行う〕方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移することなどを示唆するものではありません。また、基準価額水準、運用の状況などによっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

(略)

## (2) 【ファンドの沿革】

## &lt;訂正前&gt;

米ドルコース / 豪ドルコース / ブラジルリアルコース / ロシアルーブルコース / インドルピーコース / 中国元コース / 南アフリカランドコース / マネープールファンド

2009年11月16日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年1月15日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2015年7月13日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2019年1月12日	信託期間を2024年10月15日までに変更

(略)

## &lt;訂正後&gt;

米ドルコース / 豪ドルコース / ブラジルリアルコース / インドルピーコース / 中国元コース / 南アフリカランドコース / マネープールファンド

2009年11月16日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年1月15日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2015年7月13日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2019年1月12日	信託期間を2024年10月15日までに変更
2023年3月6日	<u>「ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース」の繰上償還(予定)</u>

(略)

## (3)【ファンドの仕組み】

&lt;訂正前&gt;

a. ファンドの仕組み

各通貨コース

図中の\*1、\*2には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

*1	米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	
*2	USDクラス	AUDクラス	BRLクラス	
*1	<u>ロシアルーブルコース</u>	インドルピーコース	中国元コース	南アフリカランドコース
*2	<u>RUBクラス</u>	INRクラス	CNYクラス	ZARクラス
*1	メキシコペソコース	トルコリラコース		
*2	MXNクラス	TRYクラス		

(略)

&lt;訂正後&gt;

a. ファンドの仕組み

各通貨コース

図中の\*1、\*2には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

*1	米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	
*2	USDクラス	AUDクラス	BRLクラス	
*1	インドルピーコース	中国元コース	南アフリカランドコース	
*2	INRクラス	CNYクラス	ZARクラス	
*1	メキシコペソコース	トルコリラコース		
*2	MXNクラス	TRYクラス		

(略)

## 2【投資方針】

## &lt;訂正前&gt;

各通貨コースが投資する外国投資信託の\*には下記表をあてはめてご覧ください。

各通貨コース	外国投資信託 グローバル・サブオーディネイティド・ デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト-
米ドルコース	USDクラス
豪ドルコース	AUDクラス
ブラジルリアルコース	BRLクラス
ロシアルーブルコース	RUBクラス
インドルピーコース	INRクラス
中国元コース	CNYクラス
南アフリカランドコース	ZARクラス
メキシコペソコース	MXNクラス
トルコリラコース	TRYクラス

(注) 各通貨コースが組み入れる外国投資信託の各クラスの運用方針につきましては、後述の「各ファンドが投資する投資信託証券の概要」をご参照ください。

## &lt;訂正後&gt;

各通貨コースが投資する外国投資信託の\*には下記表をあてはめてご覧ください。

各通貨コース	外国投資信託 グローバル・サブオーディネイティド・ デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト-
米ドルコース	USDクラス
豪ドルコース	AUDクラス
ブラジルリアルコース	BRLクラス
インドルピーコース	INRクラス
中国元コース	CNYクラス
南アフリカランドコース	ZARクラス
メキシコペソコース	MXNクラス
トルコリラコース	TRYクラス

(注) 各通貨コースが組み入れる外国投資信託の各クラスの運用方針につきましては、後述の「各ファンドが投資する投資信託証券の概要」をご参照ください。

## (2) 【投資対象】

&lt;訂正前&gt;

(略)

## 各ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - USDクラス / AUDクラス / BRLクラス / RUBクラス / INRクラス / CNYクラス / ZARクラス / MXNクラス / TRYクラス (以下、当概要において、個別クラスを「クラス」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	<p>主に世界の金融機関が発行する劣後債および普通社債等に投資しつつ、優先証券やCoCo債などにも分散投資を行うことにより、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行うことを目的とします。なお、金融機関以外の事業法人の発行する普通社債や劣後債にも投資を行うことがあります。</p> <p>原則として、買付時において、投資適格(BBB-格)相当以上の格付けを有する証券に投資します。</p> <p>米ドル以外の通貨建債券へ投資した場合、原則として債券の発行通貨売り / 米ドル買いの為替取引を行います。そのうえで、クラスごとに以下の為替取引を行います。</p> <p>USDクラス：原則として、為替取引は行いません。</p> <p>AUDクラス：原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。</p> <p>BRLクラス：原則として、米ドル売り、ブラジルリアル買いの為替取引を行います。</p> <p>RUBクラス：原則として、米ドル売り、ロシアルーブル買いの為替取引を行います。</p> <p>INRクラス：原則として、米ドル売り、インドルピー買いの為替取引を行います。</p> <p>CNYクラス：原則として、米ドル売り、中国元買いの為替取引を行います。</p> <p>ZARクラス：原則として、米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行います。</p> <p>MXNクラス：原則として、米ドル売り、メキシコペソ買いの為替取引を行います。</p> <p>TRYクラス：原則として、米ドル売り、トルコリラ買いの為替取引を行います。</p>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・同一発行体の証券への投資割合は、原則として純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・金融機関以外の事業法人が発行する普通社債や劣後性証券への投資割合の合計は、原則として純資産総額の20%以下とします。</li> <li>・他ファンドへの投資は、純資産総額の5%以内とします。</li> <li>・有価証券の空売りは行わないものとします。</li> <li>・純資産総額の10%を超える借り入れは行わないものとします。</li> <li>・流動性に欠ける資産への投資は、純資産総額の15%以内とします。</li> <li>・通常の場合において、日本において有価証券に属する証券に純資産総額の50%以上を投資します。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年3月31日

関係法人	<p>投資顧問会社：ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー</p> <p>副投資顧問会社：ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社 ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル</p> <p>受託会社：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド</p> <p>管理事務代行会社兼保管受託銀行：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー</p>
信託報酬等	<p>純資産総額に対し年率0.55%</p> <p>上記料率には、投資顧問会社、副投資顧問会社、受託会社、管理事務代行会社兼保管受託銀行への報酬が含まれます。</p> <p>この他に、株式登録機関兼名義書換事務代行会社の報酬、監査報酬、弁護士費用、当初設定にかかる諸費用などが投資信託財産から支払われます。</p>
収益分配方針	原則として、毎月、分配を行います。
設定日	<p>2009年11月16日（USDクラス/AUDクラス/BRLクラス/RUBクラス/INRクラス/CNYクラス/ZARクラス）</p> <p>2013年7月11日（MXNクラス/TRYクラス）</p>

（略）

また、各概要は2022年12月28日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

<訂正後>

（略）

各ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	<p>グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト</p> <p>- USDクラス/AUDクラス/BRLクラス/INRクラス/CNYクラス/ZARクラス/MXNクラス/TRYクラス</p> <p>（以下、当概要において、個別クラスを「クラス」といいます。）</p>
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託/円建受益証券

運用方針	<p>主に世界の金融機関が発行する劣後債および普通社債等に投資しつつ、優先証券やCoCo債などにも分散投資を行うことにより、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行うことを目的とします。なお、金融機関以外の事業法人の発行する普通社債や劣後債にも投資を行うことがあります。</p> <p>原則として、買付時において、投資適格（BBB - 格）相当以上の格付けを有する証券に投資します。</p> <p>米ドル以外の通貨建債券へ投資した場合、原則として債券の発行通貨売り / 米ドル買いの為替取引を行います。そのうえで、クラスごとに以下の為替取引を行います。</p> <p>USDクラス：原則として、為替取引は行いません。</p> <p>AUDクラス：原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。</p> <p>BRLクラス：原則として、米ドル売り、ブラジルリアル買いの為替取引を行います。</p> <p>INRクラス：原則として、米ドル売り、インドルピー買いの為替取引を行います。</p> <p>CNYクラス：原則として、米ドル売り、中国元買いの為替取引を行います。</p> <p>ZARクラス：原則として、米ドル売り、南アフリカランド買いの為替取引を行います。</p> <p>MXNクラス：原則として、米ドル売り、メキシコペソ買いの為替取引を行います。</p> <p>TRYクラス：原則として、米ドル売り、トルコリラ買いの為替取引を行います。</p>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・同一発行体の証券への投資割合は、原則として純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・金融機関以外の事業法人が発行する普通社債や劣後性証券への投資割合の合計は、原則として純資産総額の20%以下とします。</li> <li>・他ファンドへの投資は、純資産総額の5%以内とします。</li> <li>・有価証券の空売りは行わないものとします。</li> <li>・純資産総額の10%を超える借入れは行わないものとします。</li> <li>・流動性に欠ける資産への投資は、純資産総額の15%以内とします。</li> <li>・通常の状態において、日本において有価証券に属する証券に純資産総額の50%以上を投資します。</li> </ul>
信託期間	無期限
決算日	毎年3月31日
関係法人	<p>投資顧問会社：ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー</p> <p>副投資顧問会社：ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社 ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル</p> <p>受託会社：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド</p> <p>管理事務代行会社兼保管受託銀行：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー</p>

信託報酬等	純資産総額に対し年率0.55% 上記料率には、投資顧問会社、副投資顧問会社、受託会社、管理事務代行会社兼保管受託銀行への報酬が含まれます。 この他に、株式登録機関兼名義書換事務代行会社の報酬、監査報酬、弁護士費用、当初設定にかかる諸費用などが投資信託財産から支払われます。
収益分配方針	原則として、毎月、分配を行います。
設定日	2009年11月16日(USDクラス/AUDクラス/BRLクラス/INRクラス/CNYクラス/ZARクラス) 2013年7月11日(MXNクラス/TRYクラス)

(略)

また、各概要は2023年3月2日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

## 3【投資リスク】

(略)

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

&lt;更新・訂正後&gt;

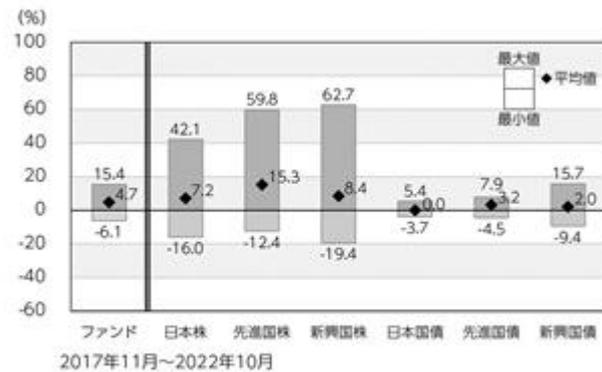
## &lt;参考情報&gt;

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

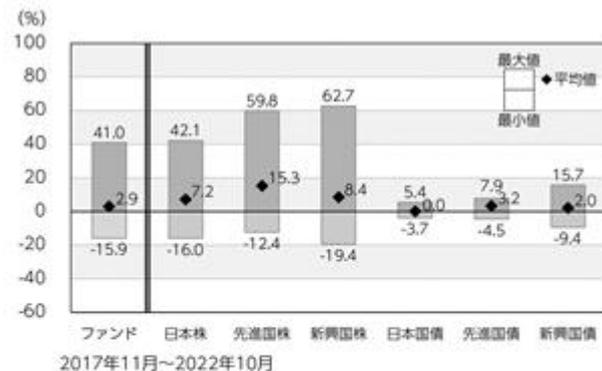
## 米ドルコース



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



## 豪ドルコース



\*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。

## <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

#### ブラジルリアルコース



#### インドルピーコース



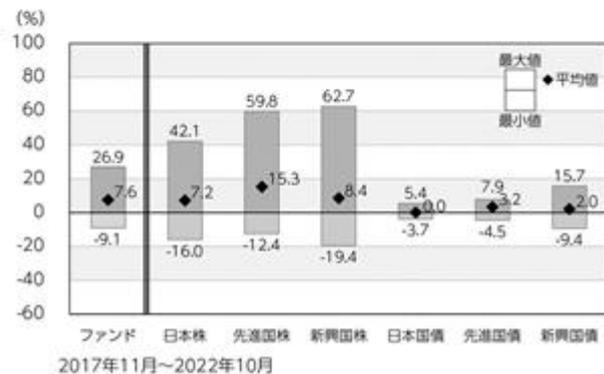
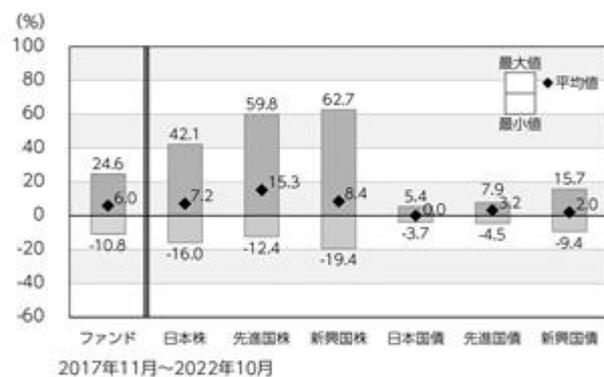
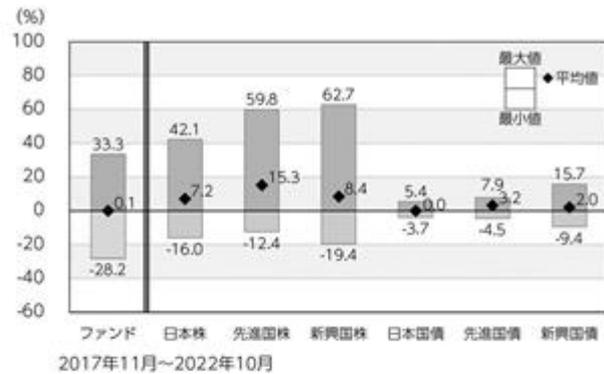
#### 中国元コース



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

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## <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

#### 南アフリカランドコース



#### メキシコペソコース

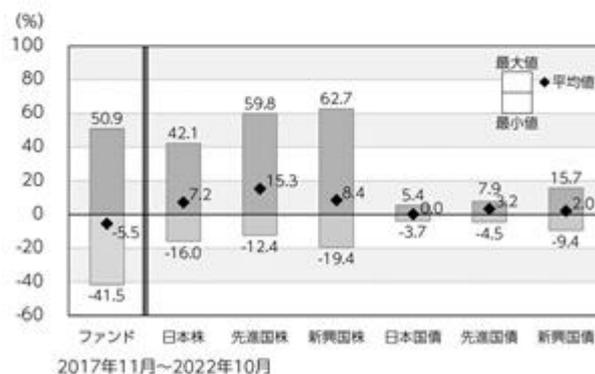
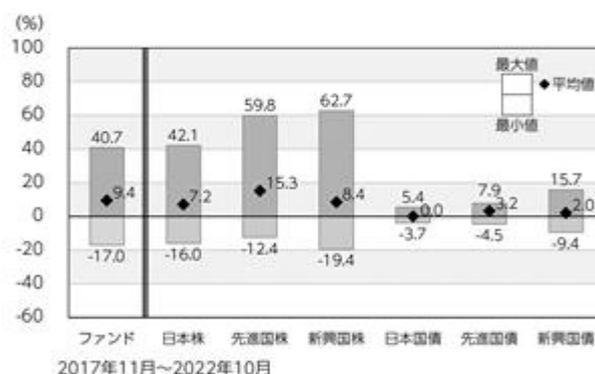
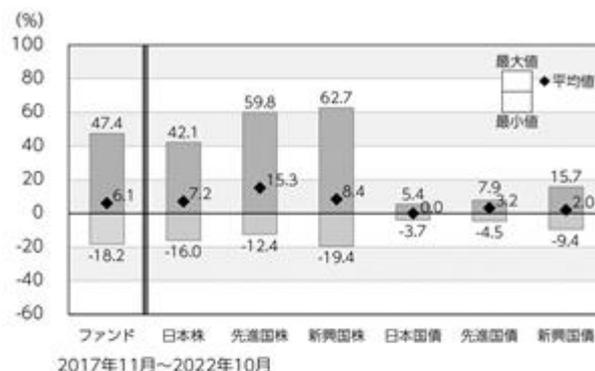


#### トルコリラコース



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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



- \*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- \*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

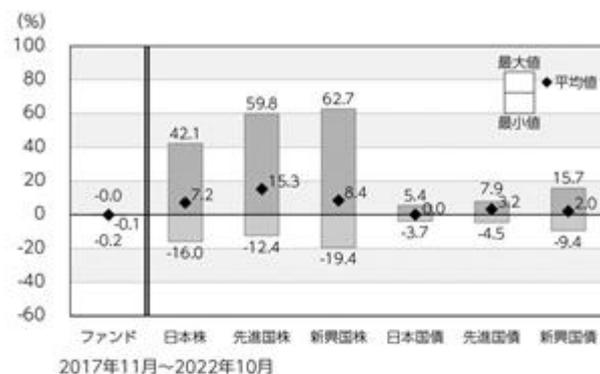
## <参考情報>

### 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

#### マネープールファンド



### 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リサーチまたは株式会社JPMリサーチの関連会社(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	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 5【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	1,727,382,571	98.02
内 ケイマン諸島	1,727,382,571	98.02
親投資信託受益証券	3,414,098	0.19
内 日本	3,414,098	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	31,466,311	1.79
純資産総額	1,762,262,980	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。

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	1,078,675,424	97.32
内 ケイマン諸島	1,078,675,424	97.32
親投資信託受益証券	4,519,333	0.41
内 日本	4,519,333	0.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	25,139,324	2.27
純資産総額	1,108,334,081	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。

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,400,964,316	96.64
内 ケイマン諸島	3,400,964,316	96.64
親投資信託受益証券	16,282,438	0.46
内 日本	16,282,438	0.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	102,055,413	2.90
純資産総額	3,519,302,167	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。

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	353,345,244	94.98
内 ケイマン諸島	353,345,244	94.98
親投資信託受益証券	2,242,838	0.60
内 日本	2,242,838	0.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	16,421,097	4.41

純資産総額	372,009,179	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。

#### ハイブリッド証券ファンド中国元コース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	427,946,332	96.21
内 ケイマン諸島	427,946,332	96.21
親投資信託受益証券	1,138,035	0.26
内 日本	1,138,035	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,706,900	3.53
純資産総額	444,791,267	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。

#### ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	76,352,084	94.20
内 ケイマン諸島	76,352,084	94.20
親投資信託受益証券	238,262	0.29
内 日本	238,262	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,464,960	5.51
純資産総額	81,055,306	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。

#### ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	714,097,223	96.06
内 ケイマン諸島	714,097,223	96.06
親投資信託受益証券	8,085,870	1.09
内 日本	8,085,870	1.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	21,190,234	2.85
純資産総額	743,373,327	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。

#### ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	550,690,540	96.44
内 ケイマン諸島	550,690,540	96.44
親投資信託受益証券	1,097,671	0.19
内 日本	1,097,671	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	19,227,087	3.37
純資産総額	571,015,298	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。

## ハイブリッド証券ファンドマネーブルファンド

2022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	961,546	96.86
内 日本	961,546	96.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	31,173	3.14
純資産総額	992,719	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）

## 国内短期公社債マザーファンド

2022年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	178,734,296	100.00
純資産総額	178,734,296	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。

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

2022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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト・USDクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	1,575,503,987	1.0773  1,697,447,995	1.0964  1,727,382,571	-  -	98.02
2	国内短期公社債マザーファ ンド  日本	親投資 信託受 益証券	3,391,713	1.0066  3,414,437	1.0066  3,414,098	-  -	0.19

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	98.02
親投資信託受益証券	0.19
合計	98.21

（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。

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

2022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	グローバル・サブオーデ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - AUDクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	1,504,218,971	0.6916  1,040,468,262	0.7171  1,078,675,424	-  -	97.32
2	国内短期公社債マザーファ ンド  日本	親投資 信託受 益証券	4,489,701	1.0066  4,519,781	1.0066  4,519,333	-  -	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	97.32
親投資信託受益証券	0.41
合計	97.73

(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。

#### ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

2022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	グローバル・サブオーデ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - BRLクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	12,081,578,389	0.2818  3,405,796,947	0.2815  3,400,964,316	-  -	96.64
2	国内短期公社債マザーファ ンド  日本	親投資 信託受 益証券	16,175,679	1.0066  16,284,056	1.0066  16,282,438	-  -	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.64
親投資信託受益証券	0.46
合計	97.10

(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。

#### ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

2022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	グローバル・サブオーデ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - I N Rクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	682,528,963	0.5076  346,519,954	0.5177  353,345,244	-  -	94.98
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,228,133	1.0066  2,243,061	1.0066  2,242,838	-  -	0.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	94.98
親投資信託受益証券	0.60
合計	95.59

(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。

#### ハイブリッド証券ファンド中国元コース

2022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	グローバル・サブオーデ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - C N Yクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	502,402,363	0.8469  425,534,801	0.8518  427,946,332	-  -	96.21
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,130,574	1.0066  1,138,148	1.0066  1,138,035	-  -	0.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.21
親投資信託受益証券	0.26
合計	96.47

(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。

#### ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

2022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	グローバル・サブオーデ ィネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - ZARクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	168,436,100	0.4446 74,903,533	0.4533 76,352,084	- -	94.20
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	236,700	1.0066 238,285	1.0066 238,262	- -	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	94.20
親投資信託受益証券	0.29
合計	94.49

(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。

#### ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

2022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	グローバル・サブオーデ ィネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - MXNクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	1,027,182,427	0.6754 693,779,009	0.6952 714,097,223	- -	96.06
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	8,032,854	1.0066 8,086,674	1.0066 8,085,870	- -	1.09

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.06
親投資信託受益証券	1.09
合計	97.15

(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。

#### ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

2022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	グローバル・サブオーディ ネイティド・デット・セ キュリティーズ・サブ・ト ラスト - TRYクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	4,245,879,260	0.1261  535,829,962	0.1297  550,690,540	-  -	96.44
2	国内短期公社債マザーファ ンド  日本	親投資 信託受 益証券	1,090,474	1.0066  1,097,780	1.0066  1,097,671	-  -	0.19

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.44
親投資信託受益証券	0.19
合計	96.63

(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。

#### ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

2022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	国内短期公社債マザーファ ンド  日本	親投資 信託受 益証券	955,242	1.0066  961,642	1.0066  961,546	-  -	96.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	96.86
合計	96.86

(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)

#### 国内短期公社債マザーファンド

該当事項はありません。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### 【投資不動産物件】

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド中国元コース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドマネーボールファンド

該当事項はありません。

（参考）

国内短期公社債マザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド中国元コース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース  
該当事項はありません。

ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド  
該当事項はありません。

(参考)

国内短期公社債マザーファンド  
該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

直近日(2022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7特定期間末 (2013年 4月12日)	1,792	1,800	1.0993	1.1038
第8特定期間末 (2013年10月15日)	2,574	2,585	1.0663	1.0708
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	2,787	2,805	1.1001	1.1071
第10特定期間末 (2014年10月14日)	3,751	3,774	1.1353	1.1423
第11特定期間末 (2015年 4月13日)	4,202	4,225	1.2438	1.2508
第12特定期間末 (2015年10月13日)	3,610	3,631	1.1914	1.1984
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	2,498	2,515	1.0438	1.0508
第14特定期間末 (2016年10月12日)	2,130	2,145	0.9983	1.0053
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	1,827	1,839	1.0236	1.0306
第16特定期間末 (2017年10月12日)	2,067	2,081	1.0438	1.0508
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	1,827	1,841	0.9441	0.9511
第18特定期間末 (2018年10月12日)	1,641	1,654	0.9309	0.9379
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	1,259	1,266	0.9491	0.9541
第20特定期間末 (2019年10月15日)	1,137	1,143	0.9439	0.9489

第21特定期間末 (2020年4月13日)	1,068	1,074	0.8946	0.8996
第22特定期間末 (2020年10月12日)	1,009	1,014	0.9078	0.9128
第23特定期間末 (2021年4月12日)	1,430	1,438	0.9244	0.9294
第24特定期間末 (2021年10月12日)	1,577	1,586	0.9178	0.9228
第25特定期間末 (2022年4月12日)	1,690	1,695	0.9328	0.9353
第26特定期間末 (2022年10月12日)	1,738	1,742	0.9678	0.9703
2021年10月末日	1,611	-	0.9276	-
11月末日	1,643	-	0.9178	-
12月末日	1,656	-	0.9268	-
2022年1月末日	1,634	-	0.9101	-
2月末日	1,615	-	0.8883	-
3月末日	1,667	-	0.9198	-
4月末日	1,715	-	0.9402	-
5月末日	1,692	-	0.9300	-
6月末日	1,732	-	0.9624	-
7月末日	1,797	-	0.9673	-
8月末日	1,781	-	0.9822	-
9月末日	1,744	-	0.9685	-
10月末日	1,762	-	0.9839	-

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

直近日(2022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7特定期間末 (2013年 4月12日)	7,617	7,658	1.3119	1.3189
第8特定期間末 (2013年10月15日)	5,624	5,658	1.1444	1.1514
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	5,523	5,560	1.1812	1.1892
第10特定期間末 (2014年10月14日)	5,691	5,731	1.1444	1.1524
第11特定期間末 (2015年 4月13日)	5,671	5,712	1.1149	1.1229
第12特定期間末 (2015年10月13日)	4,826	4,864	1.0184	1.0264
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	3,531	3,562	0.9189	0.9269
第14特定期間末 (2016年10月12日)	3,166	3,195	0.8647	0.8727
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	3,053	3,081	0.8711	0.8791

第16特定期間末 (2017年10月12日)	3,056	3,083	0.9136	0.9216
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	2,651	2,677	0.8153	0.8233
第18特定期間末 (2018年10月12日)	2,127	2,151	0.7246	0.7326
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	1,958	1,977	0.7201	0.7271
第20特定期間末 (2019年10月15日)	1,653	1,671	0.6599	0.6669
第21特定期間末 (2020年4月13日)	1,278	1,294	0.5552	0.5622
第22特定期間末 (2020年10月12日)	1,328	1,335	0.6416	0.6451
第23特定期間末 (2021年4月12日)	1,355	1,362	0.6886	0.6921
第24特定期間末 (2021年10月12日)	1,231	1,238	0.6577	0.6612
第25特定期間末 (2022年4月12日)	1,285	1,289	0.6765	0.6785
第26特定期間末 (2022年10月12日)	1,072	1,075	0.5908	0.5928
2021年10月末日	1,316	-	0.6851	-
11月末日	1,234	-	0.6406	-
12月末日	1,269	-	0.6590	-
2022年1月末日	1,191	-	0.6234	-
2月末日	1,194	-	0.6280	-
3月末日	1,285	-	0.6759	-
4月末日	1,223	-	0.6520	-
5月末日	1,210	-	0.6482	-
6月末日	1,199	-	0.6446	-
7月末日	1,201	-	0.6554	-
8月末日	1,192	-	0.6553	-
9月末日	1,105	-	0.6092	-
10月末日	1,108	-	0.6115	-

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

直近日(2022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7特定期間末 (2013年 4月12日)	53,724	54,396	0.8793	0.8903
第8特定期間末 (2013年10月15日)	41,236	41,842	0.7480	0.7590
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	36,359	36,891	0.7521	0.7631
第10特定期間末 (2014年10月14日)	29,584	30,043	0.7088	0.7198

第11特定期間末 (2015年 4月13日)	23,463	23,891	0.6037	0.6147
第12特定期間末 (2015年10月13日)	16,704	17,098	0.4665	0.4775
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	14,109	14,376	0.4224	0.4304
第14特定期間末 (2016年10月12日)	13,798	13,985	0.4434	0.4494
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	13,556	13,730	0.4691	0.4751
第16特定期間末 (2017年10月12日)	13,225	13,392	0.4766	0.4826
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	10,432	10,590	0.3954	0.4014
第18特定期間末 (2018年10月12日)	8,299	8,446	0.3394	0.3454
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	7,642	7,722	0.3325	0.3360
第20特定期間末 (2019年10月15日)	6,610	6,687	0.3027	0.3062
第21特定期間末 (2020年4月13日)	4,606	4,677	0.2263	0.2298
第22特定期間末 (2020年10月12日)	4,021	4,049	0.2105	0.2120
第23特定期間末 (2021年4月12日)	3,745	3,772	0.2092	0.2107
第24特定期間末 (2021年10月12日)	3,495	3,519	0.2151	0.2166
第25特定期間末 (2022年4月12日)	4,017	4,033	0.2628	0.2638
第26特定期間末 (2022年10月12日)	3,547	3,561	0.2570	0.2580
2021年10月末日	3,463	-	0.2142	-
11月末日	3,413	-	0.2123	-
12月末日	3,401	-	0.2136	-
2022年1月末日	3,473	-	0.2212	-
2月末日	3,528	-	0.2273	-
3月末日	3,925	-	0.2562	-
4月末日	3,773	-	0.2494	-
5月末日	3,930	-	0.2639	-
6月末日	3,663	-	0.2496	-
7月末日	3,666	-	0.2529	-
8月末日	3,824	-	0.2662	-
9月末日	3,431	-	0.2480	-
10月末日	3,519	-	0.2565	-

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

直近日(2022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7特定期間末 (2013年 4月12日)	861	868	0.9921	0.9991
第8特定期間末 (2013年10月15日)	739	745	0.8719	0.8789
第9特定期間末 (2014年 4月14日)	618	623	0.9433	0.9503
第10特定期間末 (2014年10月14日)	624	628	0.9827	0.9897
第11特定期間末 (2015年 4月13日)	792	797	1.0811	1.0881
第12特定期間末 (2015年10月13日)	789	795	1.0221	1.0291
第13特定期間末 (2016年 4月12日)	593	597	0.8926	0.8996
第14特定期間末 (2016年10月12日)	475	478	0.8646	0.8716
第15特定期間末 (2017年 4月12日)	690	695	0.9258	0.9328
第16特定期間末 (2017年10月12日)	1,309	1,319	0.9492	0.9562
第17特定期間末 (2018年 4月12日)	1,316	1,326	0.8736	0.8806
第18特定期間末 (2018年10月12日)	1,078	1,088	0.7772	0.7842
第19特定期間末 (2019年 4月12日)	1,089	1,098	0.8496	0.8566
第20特定期間末 (2019年10月15日)	619	625	0.8290	0.8360
第21特定期間末 (2020年4月13日)	453	457	0.7283	0.7353
第22特定期間末 (2020年10月12日)	449	453	0.7726	0.7796
第23特定期間末 (2021年4月12日)	406	409	0.7679	0.7749
第24特定期間末 (2021年10月12日)	435	439	0.7598	0.7668
第25特定期間末 (2022年4月12日)	412	414	0.7665	0.7705
第26特定期間末 (2022年10月12日)	364	366	0.7344	0.7384
2021年10月末日	440	-	0.7726	-
11月末日	404	-	0.7609	-
12月末日	413	-	0.7742	-
2022年1月末日	405	-	0.7562	-
2月末日	396	-	0.7370	-
3月末日	408	-	0.7579	-

4月末日	412	-	0.7665	-
5月末日	402	-	0.7499	-
6月末日	384	-	0.7630	-
7月末日	375	-	0.7598	-
8月末日	381	-	0.7713	-
9月末日	368	-	0.7421	-
10月末日	372	-	0.7476	-

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

直近日(2022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7特定期間末 (2013年4月12日)	1,896	1,905	1.1168	1.1223
第8特定期間末 (2013年10月15日)	1,544	1,551	1.1004	1.1059
第9特定期間末 (2014年4月14日)	1,323	1,332	1.1275	1.1355
第10特定期間末 (2014年10月14日)	1,186	1,194	1.1769	1.1849
第11特定期間末 (2015年4月13日)	1,275	1,283	1.3018	1.3098
第12特定期間末 (2015年10月13日)	1,129	1,136	1.2138	1.2218
第13特定期間末 (2016年4月12日)	980	987	1.0763	1.0843
第14特定期間末 (2016年10月12日)	701	707	0.9969	1.0049
第15特定期間末 (2017年4月12日)	655	660	1.0113	1.0193
第16特定期間末 (2017年10月12日)	681	686	1.0894	1.0974
第17特定期間末 (2018年4月12日)	644	649	1.0444	1.0524
第18特定期間末 (2018年10月12日)	577	581	0.9433	0.9513
第19特定期間末 (2019年4月12日)	580	585	0.9722	0.9802
第20特定期間末 (2019年10月15日)	523	527	0.9128	0.9208
第21特定期間末 (2020年4月13日)	430	435	0.8548	0.8628
第22特定期間末 (2020年10月12日)	466	470	0.9010	0.9090
第23特定期間末 (2021年4月12日)	498	502	0.9279	0.9359
第24特定期間末 (2021年10月12日)	504	509	0.9303	0.9383

第25特定期間末 (2022年4月12日)	517	519	0.9584	0.9624
第26特定期間末 (2022年10月12日)	442	444	0.8867	0.8907
2021年10月末日	518	-	0.9505	-
11月末日	513	-	0.9389	-
12月末日	517	-	0.9523	-
2022年1月末日	511	-	0.9361	-
2月末日	504	-	0.9208	-
3月末日	512	-	0.9499	-
4月末日	486	-	0.9373	-
5月末日	462	-	0.9123	-
6月末日	476	-	0.9431	-
7月末日	474	-	0.9413	-
8月末日	465	-	0.9310	-
9月末日	445	-	0.8925	-
10月末日	444	-	0.8910	-

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

直近日(2022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7特定期間末 (2013年4月12日)	498	504	0.8754	0.8849
第8特定期間末 (2013年10月15日)	471	477	0.7445	0.7540
第9特定期間末 (2014年4月14日)	298	301	0.7261	0.7341
第10特定期間末 (2014年10月14日)	241	244	0.7059	0.7139
第11特定期間末 (2015年4月13日)	247	250	0.7182	0.7262
第12特定期間末 (2015年10月13日)	193	195	0.6163	0.6243
第13特定期間末 (2016年4月12日)	146	148	0.4798	0.4878
第14特定期間末 (2016年10月12日)	130	131	0.4741	0.4791
第15特定期間末 (2017年4月12日)	130	131	0.5116	0.5166
第16特定期間末 (2017年10月12日)	134	135	0.5388	0.5438
第17特定期間末 (2018年4月12日)	129	130	0.5554	0.5604
第18特定期間末 (2018年10月12日)	100	101	0.4565	0.4615
第19特定期間末 (2019年4月12日)	92	93	0.4814	0.4864

第20特定期間末 (2019年10月15日)	88	89	0.4466	0.4516
第21特定期間末 (2020年4月13日)	68	69	0.3470	0.3520
第22特定期間末 (2020年10月12日)	73	74	0.3832	0.3862
第23特定期間末 (2021年4月12日)	82	83	0.4423	0.4453
第24特定期間末 (2021年10月12日)	152	153	0.4379	0.4409
第25特定期間末 (2022年4月12日)	339	341	0.4567	0.4597
第26特定期間末 (2022年10月12日)	79	79	0.3696	0.3726
2021年10月末日	174	-	0.4374	-
11月末日	150	-	0.4050	-
12月末日	151	-	0.4174	-
2022年1月末日	184	-	0.4164	-
2月末日	224	-	0.4191	-
3月末日	246	-	0.4552	-
4月末日	88	-	0.4123	-
5月末日	88	-	0.4175	-
6月末日	87	-	0.4137	-
7月末日	86	-	0.4055	-
8月末日	85	-	0.4022	-
9月末日	79	-	0.3732	-
10月末日	81	-	0.3761	-

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

直近日(2022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1特定期間末 (2013年10月15日)	589	593	0.9664	0.9724
第2特定期間末 (2014年4月14日)	629	632	1.0104	1.0164
第3特定期間末 (2014年10月14日)	680	684	1.0292	1.0352
第4特定期間末 (2015年4月13日)	585	589	1.0163	1.0223
第5特定期間末 (2015年10月13日)	484	488	0.9103	0.9163
第6特定期間末 (2016年4月12日)	392	395	0.7457	0.7517
第7特定期間末 (2016年10月12日)	352	355	0.6698	0.6758
第8特定期間末 (2017年4月12日)	2,486	2,508	0.6924	0.6984

第9特定期間末 (2017年10月12日)	6,978	7,036	0.7216	0.7276
第10特定期間末 (2018年 4月12日)	6,281	6,336	0.6863	0.6923
第11特定期間末 (2018年10月12日)	3,403	3,433	0.6616	0.6676
第12特定期間末 (2019年 4月12日)	2,599	2,622	0.6831	0.6891
第13特定期間末 (2019年10月15日)	1,941	1,959	0.6667	0.6727
第14特定期間末 (2020年4月13日)	1,290	1,305	0.5229	0.5289
第15特定期間末 (2020年10月12日)	1,131	1,143	0.5813	0.5873
第16特定期間末 (2021年4月12日)	953	962	0.6165	0.6225
第17特定期間末 (2021年10月12日)	857	866	0.5936	0.5996
第18特定期間末 (2022年4月12日)	720	724	0.6286	0.6321
第19特定期間末 (2022年10月12日)	686	690	0.6614	0.6649
2021年10月末日	859	-	0.6131	-
11月末日	776	-	0.5677	-
12月末日	803	-	0.6071	-
2022年1月末日	691	-	0.5884	-
2月末日	678	-	0.5871	-
3月末日	720	-	0.6263	-
4月末日	689	-	0.6214	-
5月末日	713	-	0.6433	-
6月末日	705	-	0.6485	-
7月末日	696	-	0.6465	-
8月末日	707	-	0.6658	-
9月末日	680	-	0.6559	-
10月末日	743	-	0.6802	-

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

直近日(2022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1特定期間末 (2013年10月15日)	12	12	1.0017	1.0087
第2特定期間末 (2014年 4月14日)	12	12	1.0040	1.0110
第3特定期間末 (2014年10月14日)	327	329	0.9968	1.0038
第4特定期間末 (2015年 4月13日)	63	64	1.0039	1.0109

第5特定期間末 (2015年10月13日)	111	112	0.9054	0.9124
第6特定期間末 (2016年 4月12日)	75	76	0.8473	0.8543
第7特定期間末 (2016年10月12日)	44	44	0.7688	0.7758
第8特定期間末 (2017年 4月12日)	74	75	0.6693	0.6763
第9特定期間末 (2017年10月12日)	3,233	3,265	0.7121	0.7191
第10特定期間末 (2018年 4月12日)	4,810	4,867	0.5925	0.5995
第11特定期間末 (2018年10月12日)	3,354	3,410	0.4202	0.4272
第12特定期間末 (2019年 4月12日)	4,154	4,216	0.4725	0.4795
第13特定期間末 (2019年10月15日)	4,043	4,102	0.4794	0.4864
第14特定期間末 (2020年4月13日)	3,066	3,120	0.3966	0.4036
第15特定期間末 (2020年10月12日)	2,041	2,061	0.3645	0.3680
第16特定期間末 (2021年4月12日)	1,533	1,547	0.3760	0.3795
第17特定期間末 (2021年10月12日)	1,184	1,195	0.3660	0.3695
第18特定期間末 (2022年4月12日)	646	655	0.2426	0.2461
第19特定期間末 (2022年10月12日)	554	562	0.2222	0.2257
2021年10月末日	1,110	-	0.3519	-
11月末日	808	-	0.2627	-
12月末日	757	-	0.2708	-
2022年1月末日	685	-	0.2526	-
2月末日	629	-	0.2343	-
3月末日	637	-	0.2393	-
4月末日	627	-	0.2433	-
5月末日	580	-	0.2253	-
6月末日	600	-	0.2365	-
7月末日	562	-	0.2217	-
8月末日	569	-	0.2286	-
9月末日	551	-	0.2212	-
10月末日	571	-	0.2280	-

## ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

直近日(2022年10月末日)、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7計算期間末 (2013年 4月12日)	101	101	1.0011	1.0011
第8計算期間末 (2013年10月15日)	95	95	1.0011	1.0011
第9計算期間末 (2014年 4月14日)	70	70	1.0011	1.0011
第10計算期間末 (2014年10月14日)	70	70	1.0009	1.0009
第11計算期間末 (2015年 4月13日)	70	70	1.0007	1.0007
第12計算期間末 (2015年10月13日)	72	72	1.0004	1.0004
第13計算期間末 (2016年 4月12日)	74	74	0.9999	0.9999
第14計算期間末 (2016年10月12日)	73	73	0.9997	0.9997
第15計算期間末 (2017年 4月12日)	73	73	0.9992	0.9992
第16計算期間末 (2017年10月12日)	70	70	0.9985	0.9985
第17計算期間末 (2018年 4月12日)	95	95	0.9979	0.9979
第18計算期間末 (2018年10月12日)	97	97	0.9971	0.9971
第19計算期間末 (2019年 4月12日)	72	72	0.9963	0.9963
第20計算期間末 (2019年10月15日)	72	72	0.9957	0.9957
第21計算期間末 (2020年4月13日)	2	2	0.9941	0.9941
第22計算期間末 (2020年10月12日)	0.993755	0.993755	0.9938	0.9938
第23計算期間末 (2021年4月12日)	0.993573	0.993573	0.9936	0.9936
第24計算期間末 (2021年10月12日)	0.993294	0.993294	0.9933	0.9933
第25計算期間末 (2022年4月12日)	0.993112	0.993112	0.9931	0.9931
第26計算期間末 (2022年10月12日)	0.992834	0.992834	0.9928	0.9928
2021年10月末日	0.993277	-	0.9933	-
11月末日	0.993245	-	0.9932	-
12月末日	0.993215	-	0.9932	-
2022年1月末日	0.993183	-	0.9932	-
2月末日	0.993155	-	0.9932	-
3月末日	0.993124	-	0.9931	-
4月末日	0.993096	-	0.9931	-
5月末日	0.992968	-	0.9930	-
6月末日	0.992938	-	0.9929	-

7月末日	0.992909	-	0.9929	-
8月末日	0.992876	-	0.9929	-
9月末日	0.992846	-	0.9928	-
10月末日	0.992719	-	0.9927	-

## 【分配の推移】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

	1口当たりの分配金(円)	
第7特定期間		0.0270
第8特定期間		0.0270
第9特定期間		0.0395
第10特定期間		0.0420
第11特定期間		0.0420
第12特定期間		0.0420
第13特定期間		0.0420
第14特定期間		0.0420
第15特定期間		0.0420
第16特定期間		0.0420
第17特定期間		0.0420
第18特定期間		0.0420
第19特定期間		0.0300
第20特定期間		0.0300
第21特定期間		0.0300
第22特定期間		0.0300
第23特定期間		0.0300
第24特定期間		0.0300
第25特定期間		0.0175
第26特定期間		0.0150

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

	1口当たりの分配金(円)	
第7特定期間		0.0420
第8特定期間		0.0420
第9特定期間		0.0470
第10特定期間		0.0480
第11特定期間		0.0480
第12特定期間		0.0480
第13特定期間		0.0480
第14特定期間		0.0480
第15特定期間		0.0480
第16特定期間		0.0480
第17特定期間		0.0480
第18特定期間		0.0480
第19特定期間		0.0420
第20特定期間		0.0420
第21特定期間		0.0420
第22特定期間		0.0210
第23特定期間		0.0210
第24特定期間		0.0210
第25特定期間		0.0135

第26特定期間	0.0120
---------	--------

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

	1口当たりの分配金（円）
第7特定期間	0.0660
第8特定期間	0.0660
第9特定期間	0.0660
第10特定期間	0.0660
第11特定期間	0.0660
第12特定期間	0.0660
第13特定期間	0.0480
第14特定期間	0.0380
第15特定期間	0.0360
第16特定期間	0.0360
第17特定期間	0.0360
第18特定期間	0.0360
第19特定期間	0.0210
第20特定期間	0.0210
第21特定期間	0.0210
第22特定期間	0.0090
第23特定期間	0.0090
第24特定期間	0.0090
第25特定期間	0.0065
第26特定期間	0.0060

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

	1口当たりの分配金（円）
第7特定期間	0.0420
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0420
第10特定期間	0.0420
第11特定期間	0.0420
第12特定期間	0.0420
第13特定期間	0.0420
第14特定期間	0.0420
第15特定期間	0.0420
第16特定期間	0.0420
第17特定期間	0.0420
第18特定期間	0.0420
第19特定期間	0.0420
第20特定期間	0.0420
第21特定期間	0.0420
第22特定期間	0.0420
第23特定期間	0.0420
第24特定期間	0.0420
第25特定期間	0.0270
第26特定期間	0.0240

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

	1口当たりの分配金（円）
--	--------------

第7特定期間	0.0330
第8特定期間	0.0330
第9特定期間	0.0455
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0480
第13特定期間	0.0480
第14特定期間	0.0480
第15特定期間	0.0480
第16特定期間	0.0480
第17特定期間	0.0480
第18特定期間	0.0480
第19特定期間	0.0480
第20特定期間	0.0480
第21特定期間	0.0480
第22特定期間	0.0480
第23特定期間	0.0480
第24特定期間	0.0480
第25特定期間	0.0280
第26特定期間	0.0240

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

	1口当たりの分配金（円）
第7特定期間	0.0570
第8特定期間	0.0570
第9特定期間	0.0495
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0480
第12特定期間	0.0480
第13特定期間	0.0480
第14特定期間	0.0330
第15特定期間	0.0300
第16特定期間	0.0300
第17特定期間	0.0300
第18特定期間	0.0300
第19特定期間	0.0300
第20特定期間	0.0300
第21特定期間	0.0300
第22特定期間	0.0180
第23特定期間	0.0180
第24特定期間	0.0180
第25特定期間	0.0180
第26特定期間	0.0180

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0120
第2特定期間	0.0360
第3特定期間	0.0360
第4特定期間	0.0360

第5特定期間	0.0360
第6特定期間	0.0360
第7特定期間	0.0360
第8特定期間	0.0360
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0360
第11特定期間	0.0360
第12特定期間	0.0360
第13特定期間	0.0360
第14特定期間	0.0360
第15特定期間	0.0360
第16特定期間	0.0360
第17特定期間	0.0360
第18特定期間	0.0235
第19特定期間	0.0210

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0140
第2特定期間	0.0420
第3特定期間	0.0420
第4特定期間	0.0420
第5特定期間	0.0420
第6特定期間	0.0420
第7特定期間	0.0420
第8特定期間	0.0420
第9特定期間	0.0420
第10特定期間	0.0420
第11特定期間	0.0420
第12特定期間	0.0420
第13特定期間	0.0420
第14特定期間	0.0420
第15特定期間	0.0210
第16特定期間	0.0210
第17特定期間	0.0210
第18特定期間	0.0210
第19特定期間	0.0210

## ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

	1口当たりの分配金（円）
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
第16計算期間	0.0000

第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000
第26計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

	収益率(%)
第7特定期間	32.7
第8特定期間	0.5
第9特定期間	6.9
第10特定期間	7.0
第11特定期間	13.3
第12特定期間	0.8
第13特定期間	8.9
第14特定期間	0.3
第15特定期間	6.7
第16特定期間	6.1
第17特定期間	5.5
第18特定期間	3.1
第19特定期間	5.2
第20特定期間	2.6
第21特定期間	2.0
第22特定期間	4.8
第23特定期間	5.1
第24特定期間	2.5
第25特定期間	3.5
第26特定期間	5.4

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

	収益率(%)
第7特定期間	37.9
第8特定期間	9.6
第9特定期間	7.3
第10特定期間	0.9
第11特定期間	1.6
第12特定期間	4.4
第13特定期間	5.1
第14特定期間	0.7
第15特定期間	6.3
第16特定期間	10.4
第17特定期間	5.5

第18特定期間	5.2
第19特定期間	5.2
第20特定期間	2.5
第21特定期間	9.5
第22特定期間	19.3
第23特定期間	10.6
第24特定期間	1.4
第25特定期間	4.9
第26特定期間	10.9

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

	収益率（％）
第7特定期間	38.6
第8特定期間	7.4
第9特定期間	9.4
第10特定期間	3.0
第11特定期間	5.5
第12特定期間	11.8
第13特定期間	0.8
第14特定期間	14.0
第15特定期間	13.9
第16特定期間	9.3
第17特定期間	9.5
第18特定期間	5.1
第19特定期間	4.2
第20特定期間	2.6
第21特定期間	18.3
第22特定期間	3.0
第23特定期間	3.7
第24特定期間	7.1
第25特定期間	25.2
第26特定期間	0.1

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

	収益率（％）
第7特定期間	32.5
第8特定期間	7.9
第9特定期間	13.0
第10特定期間	8.6
第11特定期間	14.3
第12特定期間	1.6
第13特定期間	8.6
第14特定期間	1.6
第15特定期間	11.9
第16特定期間	7.1
第17特定期間	3.5

第18特定期間	6.2
第19特定期間	14.7
第20特定期間	2.5
第21特定期間	7.1
第22特定期間	11.8
第23特定期間	4.8
第24特定期間	4.4
第25特定期間	4.4
第26特定期間	1.1

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンド中国元コース

	収益率(%)
第7特定期間	34.4
第8特定期間	1.5
第9特定期間	6.6
第10特定期間	8.6
第11特定期間	14.7
第12特定期間	3.1
第13特定期間	7.4
第14特定期間	2.9
第15特定期間	6.3
第16特定期間	12.5
第17特定期間	0.3
第18特定期間	5.1
第19特定期間	8.2
第20特定期間	1.2
第21特定期間	1.1
第22特定期間	11.0
第23特定期間	8.3
第24特定期間	5.4
第25特定期間	6.0
第26特定期間	5.0

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

	収益率(%)
第7特定期間	32.6
第8特定期間	8.4
第9特定期間	4.2
第10特定期間	3.8
第11特定期間	8.5
第12特定期間	7.5
第13特定期間	14.4
第14特定期間	5.7
第15特定期間	14.2
第16特定期間	11.2
第17特定期間	8.6

第18特定期間	12.4
第19特定期間	12.0
第20特定期間	1.0
第21特定期間	15.6
第22特定期間	15.6
第23特定期間	20.1
第24特定期間	3.1
第25特定期間	8.4
第26特定期間	15.1

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

	収益率(%)
第1特定期間	2.2
第2特定期間	8.3
第3特定期間	5.4
第4特定期間	2.2
第5特定期間	6.9
第6特定期間	14.1
第7特定期間	5.4
第8特定期間	8.7
第9特定期間	9.4
第10特定期間	0.1
第11特定期間	1.6
第12特定期間	8.7
第13特定期間	2.9
第14特定期間	16.2
第15特定期間	18.1
第16特定期間	12.2
第17特定期間	2.1
第18特定期間	9.9
第19特定期間	8.6

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

	収益率(%)
第1特定期間	1.6
第2特定期間	4.4
第3特定期間	3.5
第4特定期間	4.9
第5特定期間	5.6
第6特定期間	1.8
第7特定期間	4.3
第8特定期間	7.5
第9特定期間	12.7
第10特定期間	10.9
第11特定期間	22.0
第12特定期間	22.4

第13特定期間	10.3
第14特定期間	8.5
第15特定期間	2.8
第16特定期間	8.9
第17特定期間	2.9
第18特定期間	28.0
第19特定期間	0.2

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

#### ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

	収益率(%)
第7計算期間	0.02
第8計算期間	0.00
第9計算期間	0.00
第10計算期間	0.02
第11計算期間	0.02
第12計算期間	0.03
第13計算期間	0.05
第14計算期間	0.02
第15計算期間	0.05
第16計算期間	0.07
第17計算期間	0.06
第18計算期間	0.08
第19計算期間	0.08
第20計算期間	0.06
第21計算期間	0.16
第22計算期間	0.03
第23計算期間	0.02
第24計算期間	0.03
第25計算期間	0.02
第26計算期間	0.03

(注) 収益率は期間騰落率です。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

##### ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

	設定口数	解約口数
第7特定期間	592,494,028	294,482,016
第8特定期間	941,593,189	158,218,490
第9特定期間	549,086,314	429,635,416
第10特定期間	1,589,637,442	818,900,694
第11特定期間	530,282,202	456,350,083
第12特定期間	625,774,290	974,203,105
第13特定期間	145,921,708	782,282,084
第14特定期間	106,596,997	366,272,051
第15特定期間	250,038,112	598,953,665
第16特定期間	398,690,501	202,881,263
第17特定期間	154,448,885	199,373,858
第18特定期間	68,642,438	240,732,335
第19特定期間	14,554,792	451,230,663

第20特定期間	131,129,868	253,322,120
第21特定期間	64,122,495	74,338,346
第22特定期間	8,505,698	91,794,735
第23特定期間	597,999,270	162,262,829
第24特定期間	248,220,795	76,315,422
第25特定期間	130,379,357	37,134,427
第26特定期間	135,980,085	152,339,581

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

	設定口数	解約口数
第7特定期間	917,339,792	1,781,457,479
第8特定期間	202,242,188	1,094,484,806
第9特定期間	462,742,702	701,423,851
第10特定期間	954,263,528	656,937,490
第11特定期間	343,972,081	230,162,160
第12特定期間	208,308,547	555,946,274
第13特定期間	68,379,077	964,159,260
第14特定期間	63,303,545	244,997,153
第15特定期間	128,635,312	284,723,915
第16特定期間	244,089,464	404,584,214
第17特定期間	130,893,401	224,180,000
第18特定期間	19,490,266	335,308,658
第19特定期間	32,528,706	249,467,335
第20特定期間	10,451,305	223,563,237
第21特定期間	13,752,452	216,869,172
第22特定期間	7,130,820	239,883,662
第23特定期間	9,466,414	110,705,416
第24特定期間	34,916,705	130,916,168
第25特定期間	66,115,574	38,500,676
第26特定期間	3,490,269	89,404,397

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

	設定口数	解約口数
第7特定期間	9,292,913,236	7,327,324,395
第8特定期間	2,185,065,819	8,152,259,953
第9特定期間	1,723,140,971	8,508,820,705
第10特定期間	1,902,725,366	8,512,107,773
第11特定期間	1,618,667,591	4,486,117,179
第12特定期間	2,206,669,418	5,264,456,264
第13特定期間	1,589,379,845	3,993,056,719
第14特定期間	1,119,212,162	3,404,238,062
第15特定期間	784,231,764	3,003,363,255
第16特定期間	1,185,690,318	2,336,777,201
第17特定期間	507,360,362	1,877,547,045
第18特定期間	552,121,852	2,484,114,108
第19特定期間	169,890,629	1,633,583,250
第20特定期間	161,862,408	1,310,432,816
第21特定期間	170,847,983	1,652,277,900

第22特定期間	108,300,612	1,362,631,633
第23特定期間	109,167,159	1,304,143,774
第24特定期間	98,923,039	1,757,838,056
第25特定期間	50,401,041	1,008,010,067
第26特定期間	36,747,299	1,520,259,730

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

	設定口数	解約口数
第7特定期間	248,005,913	515,864,470
第8特定期間	40,914,420	61,555,468
第9特定期間	45,655,539	237,833,096
第10特定期間	81,881,126	102,707,986
第11特定期間	122,884,893	24,936,434
第12特定期間	79,628,268	39,958,969
第13特定期間	32,692,095	141,028,085
第14特定期間	78,375,389	193,504,468
第15特定期間	232,636,933	36,667,630
第16特定期間	804,479,267	170,010,328
第17特定期間	239,578,963	112,886,176
第18特定期間	51,609,817	170,638,154
第19特定期間	60,911,326	166,154,780
第20特定期間	39,522,305	573,979,186
第21特定期間	44,862,742	170,432,220
第22特定期間	37,958,257	78,640,235
第23特定期間	44,101,104	96,750,683
第24特定期間	55,436,008	11,403,113
第25特定期間	19,658,765	54,830,345
第26特定期間	9,495,772	50,526,490

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンド中国元コース

	設定口数	解約口数
第7特定期間	22,515,991	315,238,232
第8特定期間	4,470,861	299,174,197
第9特定期間	51,287,855	280,647,612
第10特定期間	4,825,008	170,589,896
第11特定期間	15,587,776	43,737,308
第12特定期間	1,893,117	51,685,933
第13特定期間	23,634,440	43,060,132
第14特定期間	1,288,534	208,007,869
第15特定期間	1,327,288	57,382,884
第16特定期間	7,558,491	30,014,115
第17特定期間	3,691,064	11,989,939
第18特定期間	5,876,473	11,300,175
第19特定期間	1,890,445	16,116,575
第20特定期間	2,227,269	26,606,266
第21特定期間	2,885,771	71,904,841
第22特定期間	24,662,775	11,350,524
第23特定期間	32,140,471	12,320,221

第24特定期間	27,136,039	21,753,910
第25特定期間	19,459,620	22,159,967
第26特定期間	7,304,275	47,945,560

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

	設定口数	解約口数
第7特定期間	262,570,721	229,247,328
第8特定期間	192,289,462	128,492,342
第9特定期間	22,448,990	245,360,488
第10特定期間	21,915,540	90,560,936
第11特定期間	13,892,785	11,318,441
第12特定期間	1,524,709	32,595,799
第13特定期間	17,972,257	27,090,103
第14特定期間	7,138,880	37,488,486
第15特定期間	8,615,254	27,529,613
第16特定期間	2,881,885	9,085,696
第17特定期間	12,505,301	28,566,662
第18特定期間	4,014,345	16,741,556
第19特定期間	21,710,240	49,365,743
第20特定期間	10,399,371	5,696,517
第21特定期間	8,501,798	8,186,832
第22特定期間	5,772,856	11,818,657
第23特定期間	6,077,731	11,023,724
第24特定期間	166,484,039	4,291,953
第25特定期間	543,161,152	148,499,512
第26特定期間	14,175,198	543,305,035

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

#### ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	610,300,742	0
第2特定期間	19,556,911	7,154,702
第3特定期間	40,891,068	2,166,466
第4特定期間	15,069,563	100,171,157
第5特定期間	249,822	44,003,339
第6特定期間	115,115	6,237,145
第7特定期間	275,176	0
第8特定期間	3,169,087,312	104,257,171
第9特定期間	6,877,718,744	798,671,437
第10特定期間	415,328,724	932,556,728
第11特定期間	174,904,911	4,184,297,130
第12特定期間	195,475,771	1,534,446,897
第13特定期間	166,643,197	1,059,427,086
第14特定期間	75,089,897	519,832,520
第15特定期間	34,400,816	555,656,650
第16特定期間	14,940,827	415,215,276
第17特定期間	59,256,016	160,471,966
第18特定期間	22,455,073	320,739,390
第19特定期間	9,829,054	117,992,554

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

#### ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	12,000,000	0
第2特定期間	70,929	50,000
第3特定期間	316,613,323	36,817
第4特定期間	30,485,960	295,639,210
第5特定期間	68,009,516	7,902,516
第6特定期間	8,971,477	43,073,094
第7特定期間	8,864,396	40,879,664
第8特定期間	55,568,897	1,090,868
第9特定期間	4,487,010,344	57,933,276
第10特定期間	3,869,083,775	291,965,681
第11特定期間	1,002,289,783	1,136,887,180
第12特定期間	1,873,585,871	1,063,947,316
第13特定期間	1,477,090,825	1,836,184,689
第14特定期間	1,343,986,375	2,047,789,865
第15特定期間	287,558,512	2,415,939,930
第16特定期間	68,654,471	1,592,746,133
第17特定期間	33,391,466	874,256,242
第18特定期間	64,115,709	636,550,153
第19特定期間	78,374,686	249,346,021

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

#### ハイブリッド証券ファンドマネーブルファンド

	設定口数	解約口数
第7計算期間	10,606,236	43,752,291
第8計算期間	32,347,448	38,698,273
第9計算期間	31,973,730	56,084,642
第10計算期間	0	0
第11計算期間	0	0
第12計算期間	113,564,929	112,470,708
第13計算期間	3,124,176	1,094,221
第14計算期間	0	0
第15計算期間	0	0
第16計算期間	0	3,124,176
第17計算期間	25,153,162	0
第18計算期間	1,924,057	0
第19計算期間	0	25,153,162
第20計算期間	0	0
第21計算期間	0	69,892,679
第22計算期間	0	1,924,057
第23計算期間	0	0
第24計算期間	0	0
第25計算期間	0	0
第26計算期間	0	0

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

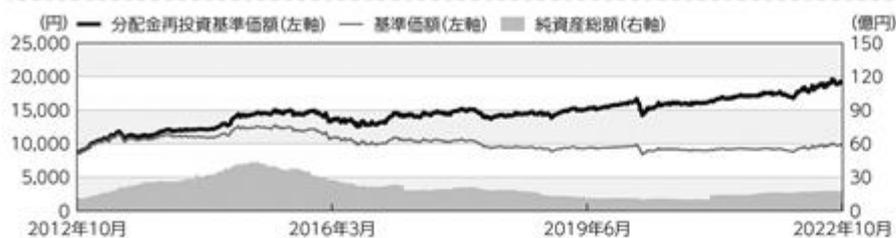


## 参考情報

データの基準日:2022年10月31日

## 米ドルコース

## 基準価額・純資産の推移(2012年10月31日~2022年10月31日)



## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	25円
2022年 7月	25円
2022年 8月	25円
2022年 9月	25円
2022年10月	25円
直近1年間累計	325円
設定来累計	8,370円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイテッド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラストーUSDクラス	98.02
2	国内短期公社債マザーファンド	0.19

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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11月16日)  
 ※分配金は1万口当たりです。

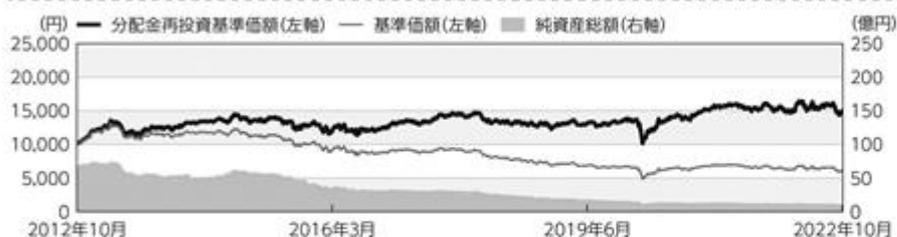
※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。  
 ※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。  
 ※各ファンドにはベンチマークはありません。

- 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。

データの基準日:2022年10月31日

## 豪ドルコース

基準価額・純資産の推移(2012年10月31日~2022年10月31日)



分配の推移(税引前)

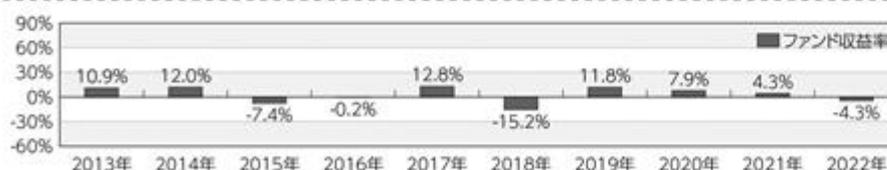
2022年6月	20円
2022年7月	20円
2022年8月	20円
2022年9月	20円
2022年10月	20円
直近1年間累計	255円
設定来累計	10,155円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

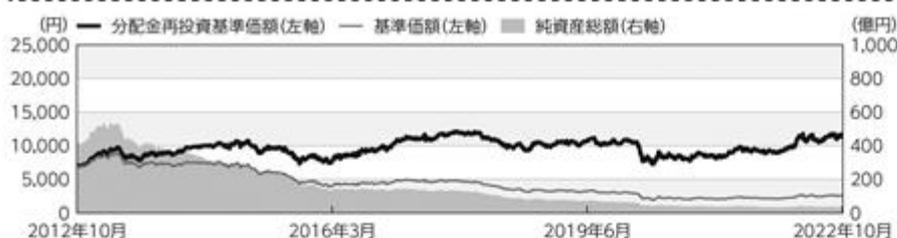
順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-AUDクラス	97.32
2	国内短期公社債マザーファンド	0.41

年間収益率の推移(暦年ベース)



## ブラジルリアルコース

基準価額・純資産の推移(2012年10月31日~2022年10月31日)



分配の推移(税引前)

2022年6月	10円
2022年7月	10円
2022年8月	10円
2022年9月	10円
2022年10月	10円
直近1年間累計	125円
設定来累計	11,025円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブトラスト-BRLクラス	96.64
2	国内短期公社債マザーファンド	0.46

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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11月16日)

※分配金は1万口当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

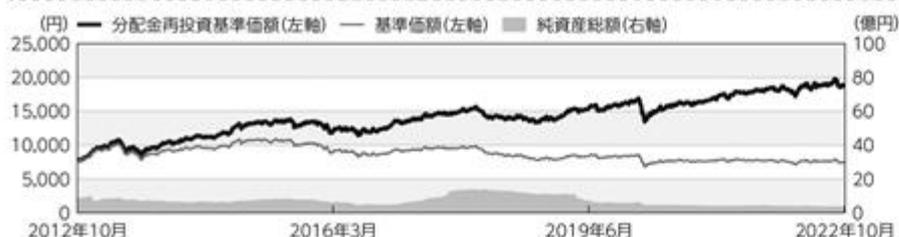
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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。

データの基準日:2022年10月31日

## インドルピーコース

## 基準価額・純資産の推移(2012年10月31日～2022年10月31日)



## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	40円
2022年 7月	40円
2022年 8月	40円
2022年 9月	40円
2022年10月	40円
直近1年間累計	510円
設定来累計	10,450円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

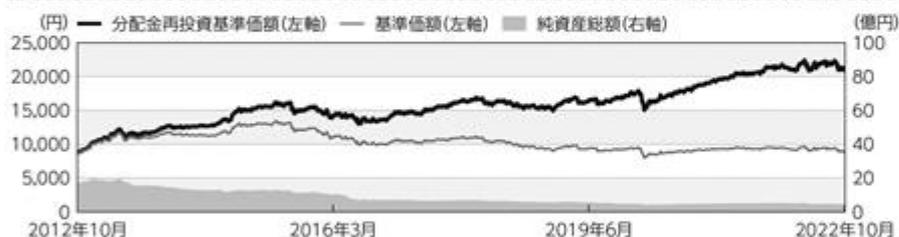
順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイテッド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト-INRクラス	94.98
2	国内短期公社債マザーファンド	0.60

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



## 中国元コース

## 基準価額・純資産の推移(2012年10月31日～2022年10月31日)



## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	40円
2022年 7月	40円
2022年 8月	40円
2022年 9月	40円
2022年10月	40円
直近1年間累計	520円
設定来累計	10,705円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイテッド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト-CNYクラス	96.21
2	国内短期公社債マザーファンド	0.26

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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11月16日)  
 ※分配金は1万口当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。  
 ※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。  
 ※各ファンドにはベンチマークはありません。

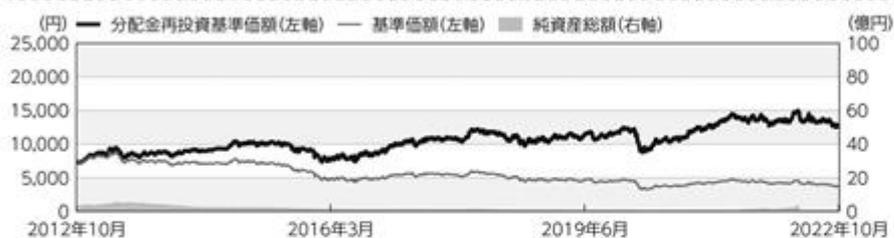
○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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。

データの基準日:2022年10月31日

## 南アフリカランドコース

## 基準価額・純資産の推移（2012年10月31日～2022年10月31日）



## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	30円
2022年 7月	30円
2022年 8月	30円
2022年 9月	30円
2022年10月	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	10,115円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト-ZARクラス	94.20
2	国内短期公社債マザーファンド	0.29

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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11月16日)  
 ※分配金は1万口当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。  
 ※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。  
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

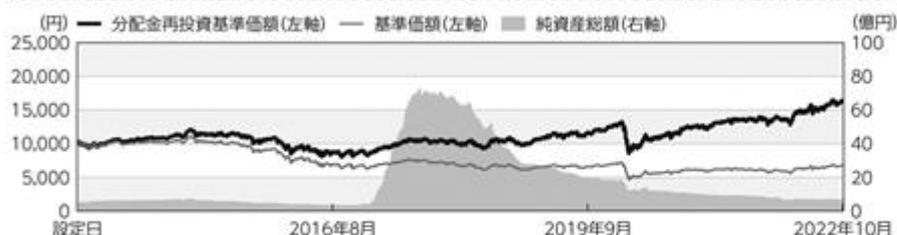
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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。

データの基準日:2022年10月31日

## メキシコペソコース

## 基準価額・純資産の推移(2013年7月11日~2022年10月31日)



## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	35円
2022年 7月	35円
2022年 8月	35円
2022年 9月	35円
2022年10月	35円
直近1年間累計	445円
設定来累計	6,325円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

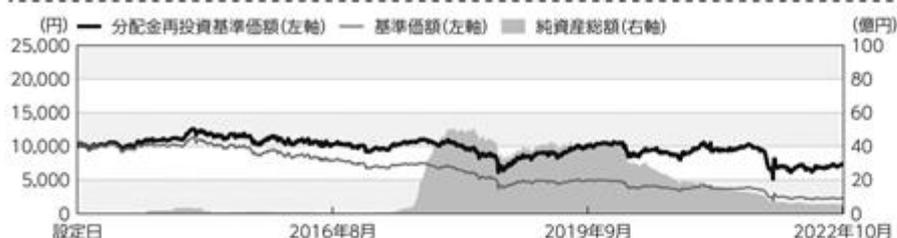
順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト・MXNクラス	96.06
2	国内短期公社債マザーファンド	1.09

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



## トルコリラコース

## 基準価額・純資産の推移(2013年7月11日~2022年10月31日)



## 分配の推移(税引前)

2022年 6月	35円
2022年 7月	35円
2022年 8月	35円
2022年 9月	35円
2022年10月	35円
直近1年間累計	420円
設定来累計	6,650円

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト・TRYクラス	96.44
2	国内短期公社債マザーファンド	0.19

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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、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:2013年7月11日)

※分配金は1万口当たりです。

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

※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。

※2013年は設定日から年末までの収益率、および2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

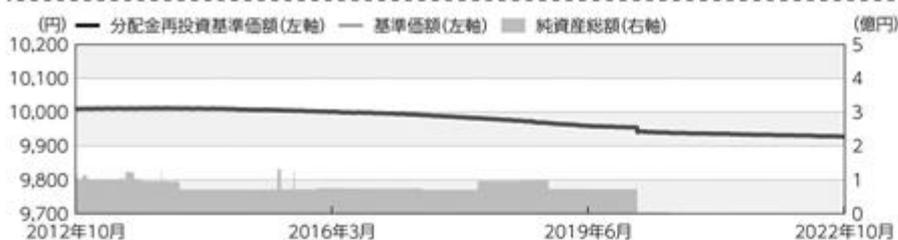
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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。

データの基準日:2022年10月31日

## マネーブルファンド

## 基準価額・純資産の推移（2012年10月31日～2022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11月16日)

## 分配の推移(税引前)

年月	分配金 (円)
2020年10月	0円
2021年4月	0円
2021年10月	0円
2022年4月	0円
2022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	国内短期公社債マザーファンド	96.86

## ■国内短期公社債マザーファンド

※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。

## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	100.00
合計(純資産総額)	100.00

## 組入銘柄

該当事項はありません。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2022年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

## ■グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト(2022年10月11日現在)

※ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントからの情報を基に作成しています。

※比率(%)は、グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラストの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	業種	通貨	国/地域	クーポン(%)	比率(%)
1	CREDIT AGRICOLE SA	銀行	米ドル	フランス	4.37500	4.1
2	BARCLAYS PLC	銀行	米ドル	イギリス	5.20000	3.1
3	BNP PARIBAS	銀行	米ドル	フランス	4.37500	3.0
4	COOPERATIEVE RABOBANK UA	銀行	米ドル	オランダ	3.75000	2.7
5	CLOVERIE PLC ZURICH INS	保険	米ドル	アイルランド	5.62500	2.3
6	SOCIETE GENERALE	銀行	米ドル	フランス	4.25000	2.2
7	ABN AMRO BANK NV	銀行	米ドル	オランダ	4.75000	2.1
8	TORONTO-DOMINION BANK	銀行	米ドル	カナダ	8.12500	2.1
9	BANK OF AMERICA CORP	銀行	米ドル	アメリカ	4.18300	1.9
10	ASSICURAZIONI GENERALI	保険	ユーロ	イタリア	5.50000	1.9

○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】

&lt;訂正前&gt;

（略）

（ロ）「分配金再投資コース」での取得申込者は販売会社との間で「ハイブリッド証券ファンド\*自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

・上記\*には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	
ロシアルーブルコース	インドルピーコース	中国元コース	南アフリカランドコース
メキシコペソコース	トルコリラコース	マネープールファンド	

（ハ）取得およびスイッチングの申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

なお、各通貨コースについては申込日が以下のいずれかに該当する日には、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

ただし、次の4つのコースでは、以下に該当する日についても、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

ブラジルリアルコース：サンパウロの銀行の休業日

ロシアルーブルコース：ロシアの銀行の休業日

インドルピーコース：インドの銀行の休業日

中国元コース：中国の銀行の休業日

（略）

<訂正後>

（略）

（ロ）「分配金再投資コース」での取得申込者は販売会社との間で「ハイブリッド証券ファンド\*自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

・上記\*には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース
インドルピーコース	中国元コース	南アフリカランドコース
メキシコペソコース	トルコリラコース	マネープールファンド

（ハ）取得およびスイッチングの申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

なお、各通貨コースについては申込日が以下のいずれかに該当する日には、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

ただし、次の3つのコースでは、以下に該当する日についても、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

ブラジルリアルコース：サンパウロの銀行の休業日

インドルピーコース：インドの銀行の休業日

中国元コース：中国の銀行の休業日

（略）

## 2【換金(解約)手続等】

&lt;訂正前&gt;

(略)

(へ) 委託者は、各通貨コースについて以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

ただし、次の4つのコースでは、以下に該当する日についても、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ブラジルリアルコース：サンパウロの銀行の休業日

ロシアルーブルコース：ロシアの銀行の休業日

インドルピーコース：インドの銀行の休業日

中国元コース：中国の銀行の休業日

(略)

&lt;訂正後&gt;

(略)

(へ) 委託者は、各通貨コースについて以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

ただし、次の3つのコースでは、以下に該当する日についても、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

ブラジルリアルコース：サンパウロの銀行の休業日

インドルピーコース：インドの銀行の休業日

中国元コース：中国の銀行の休業日

(略)

### 3【資産管理等の概要】

#### (3)【信託期間】

<訂正前>

##### 各ファンド共通

各ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2024年10月15日までです。(注)

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(注) ロシアループルコースにおいて繰上償還(信託終了)が決定した場合には、当該コースの信託期間は2023年3月6日までとなります。

<訂正後>

各ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2024年10月15日までです。

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

ハイブリッド証券ファンド米ドルコース  
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース  
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース  
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース  
ハイブリッド証券ファンド中国元コース  
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース  
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース  
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2022年4月13日から2022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。

#### ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（2022年4月13日から2022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】

## 【ハイブリッド証券ファンド米ドルコース】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	38,363,464	43,508,051
投資信託受益証券	1,635,961,705	1,697,447,995
親投資信託受益証券	3,414,776	3,414,437
未収入金	19,000,000	-
流動資産合計	1,696,739,945	1,744,370,483
資産合計	1,696,739,945	1,744,370,483
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,531,121	4,490,222
未払解約金	320	-
未払受託者報酬	43,525	47,990
未払委託者報酬	1,480,052	1,631,990
その他未払費用	3,861	4,258
流動負債合計	6,058,879	6,174,460
負債合計	6,058,879	6,174,460
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,812,448,599	1,796,089,103
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	121,767,533	57,893,080
（分配準備積立金）	5,766,158	40,322,406
元本等合計	1,690,681,066	1,738,196,023
純資産合計	1,690,681,066	1,738,196,023
負債純資産合計	1,696,739,945	1,744,370,483

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	当期 自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	40,356,179	50,839,707
有価証券売買等損益	27,776,430	48,485,951
営業収益合計	68,132,609	99,325,658
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,127	5,530
受託者報酬	269,084	288,264
委託者報酬	9,150,414	9,802,891
その他費用	23,859	25,567
営業費用合計	9,446,484	10,122,252
営業利益又は営業損失( )	58,686,125	89,203,406
経常利益又は経常損失( )	58,686,125	89,203,406
当期純利益又は当期純損失( )	58,686,125	89,203,406
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( )	420,604	646,911
期首剰余金又は期首欠損金( )	141,349,836	121,767,533
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,626,623	5,802,857
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,626,623	5,802,857
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,924,332	4,643,472
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,924,332	4,643,472
分配金	31,385,509	27,135,249
期末剰余金又は期末欠損金( )	121,767,533	57,893,080

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、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。  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。
2. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	1,719,203,669円	1,812,448,599円
期中追加設定元本額	130,379,357円	135,980,085円
期中一部解約元本額	37,134,427円	152,339,581円
2. 受益権の総数	1,812,448,599口	1,796,089,103口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は121,767,533円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は57,893,080円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	(自2021年10月13日 至2021年11月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,140,341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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(573,299,249円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は579,439,590円(1万口当たり3,274.82円)であり、うち8,846,866円(1万口当たり50円)を分配金額としております。	(自2022年4月13日 至2022年5月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,794,183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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(587,480,755円)及び分配準備積立金(5,743,573円)より分配対象収益は600,018,511円(1万口当たり3,294.34円)であり、うち4,553,393円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2021年11月13日 至2021年12月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,171,918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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(576,034,627円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は581,206,545円(1万口当たり3,253.78円)であり、うち4,465,618円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,993,678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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(576,784,339円)及び分配準備積立金(706,237円)より分配対象収益は583,484,254円(1万口当たり3,262.31円)であり、うち4,471,396円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,110,918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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(579,193,849円)及び分配準備積立金(2,228,442円)より分配対象収益は586,533,209円(1万口当たり3,265.77円)であり、うち4,490,003円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2022年2月15日 至2022年3月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,373,470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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(590,925,803円)及び分配準備積立金(2,849,357円)より分配対象収益は599,148,630円(1万口当たり3,270.10円)であり、うち4,580,505円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2022年5月13日 至2022年6月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,141,870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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(587,151,042円)及び分配準備積立金(7,954,015円)より分配対象収益は602,246,927円(1万口当たり3,308.58円)であり、うち4,550,641円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,230,856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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(579,833,446円)及び分配準備積立金(10,349,910円)より分配対象収益は597,414,212円(1万口当たり3,323.81円)であり、うち4,493,442円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,255,254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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(587,416,984円)及び分配準備積立金(12,523,500円)より分配対象収益は607,195,738円(1万口当たり3,339.58円)であり、うち4,545,445円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自2022年8月13日 至2022年9月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,070,957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(17,041,521円)、信託約款に規定される収益調整金(581,828,367円)及び分配準備積立金(15,076,345円)より分配対象収益は623,017,190円(1万口当たり3,459.58円)であり、うち4,502,106円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

	(自2022年3月15日 至2022年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,695,521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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(584,556,143円)及び分配準備積立金(3,601,758円)より分配対象収益は594,853,422円(1万口当たり3,282.04円)であり、うち4,531,121円(1万口当たり25円)を分配金額としております。	(自2022年9月13日 至2022年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,239,897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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(580,309,748円)及び分配準備積立金(36,572,731円)より分配対象収益は625,122,376円(1万口当たり3,480.46円)であり、うち4,490,222円(1万口当たり25円)を分配金額としております。
--	--	--

## (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	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	86,211,277	52,621,833
親投資信託受益証券	-	-
合計	86,211,277	52,621,833

## （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）

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.9328円	0.9678円
（1万口当たり純資産額）	(9,328円)	(9,678円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - U SDクラス	1,575,503,987	1,697,447,995	
投資信託受益証券 合計		1,575,503,987	1,697,447,995	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	3,391,713	3,414,437	
親投資信託受益証券 合計		3,391,713	3,414,437	
合計			1,700,862,432	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	46,483,746	32,231,783
投資信託受益証券	1,240,474,301	1,040,468,262
親投資信託受益証券	4,520,230	4,519,781
流動資産合計	1,291,478,277	1,077,219,826
資産合計	1,291,478,277	1,077,219,826
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,801,377	3,629,549
未払解約金	687,808	303,020
未払受託者報酬	33,093	30,993
未払委託者報酬	1,125,454	1,054,131
その他未払費用	2,926	2,745
流動負債合計	5,650,658	5,020,438
負債合計	5,650,658	5,020,438
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,900,688,937	1,814,774,809
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	614,861,318	742,575,421
(分配準備積立金)	1,914,057	9,863,809
元本等合計	1,285,827,619	1,072,199,388
純資産合計	1,285,827,619	1,072,199,388
負債純資産合計	1,291,478,277	1,077,219,826

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自	2021年10月13日	自	2022年4月13日
	至	2022年4月12日	至	2022年10月12日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		29,999,160		34,417,240
有価証券売買等損益		37,286,161		163,006,488
営業収益合計		67,285,321		128,589,248
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,034		3,571
受託者報酬		205,251		197,871
委託者報酬		6,980,590		6,729,670
その他費用		18,181		17,524
営業費用合計		7,206,056		6,948,636
営業利益又は営業損失( )		60,079,265		135,537,884
経常利益又は経常損失( )		60,079,265		135,537,884
当期純利益又は当期純損失( )		60,079,265		135,537,884
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( )		17,589		747,546
期首剰余金又は期首欠損金( )		641,090,622		614,861,318
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,619,170		30,334,232
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,619,170		30,334,232
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		21,600,064		1,207,490
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		21,600,064		1,207,490
分配金		25,851,478		22,050,507
期末剰余金又は期末欠損金( )		614,861,318		742,575,421

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、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。  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。
2. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	1,873,074,039円	1,900,688,937円
期中追加設定元本額	66,115,574円	3,490,269円
期中一部解約元本額	38,500,676円	89,404,397円
2. 受益権の総数	1,900,688,937口	1,814,774,809口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は614,861,318円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は742,575,421円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	(自2021年10月13日 至2021年11月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,663,763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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(492,788,918円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は497,452,681円(1万口当たり2,592.57円)であり、うち6,715,654円(1万口当たり35円)を分配金額としております。	(自2022年4月13日 至2022年5月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,198,259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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(478,305,344円)及び分配準備積立金(1,882,653円)より分配対象収益は484,386,256円(1万口当たり2,590.09円)であり、うち3,740,291円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2021年11月13日 至2021年12月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,975,497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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(493,379,333円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は497,354,830円(1万口当たり2,578.18円)であり、うち3,858,179円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,491,862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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(492,194,492円)及び分配準備積立金(116,998円)より分配対象収益は496,803,352円(1万口当たり2,581.52円)であり、うち3,848,913円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,776,070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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(488,800,829円)及び分配準備積立金(754,488円)より分配対象収益は493,331,387円(1万口当たり2,581.28円)であり、うち3,822,374円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年2月15日 至2022年3月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,831,083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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(486,576,819円)及び分配準備積立金(704,718円)より分配対象収益は491,112,620円(1万口当たり2,581.41円)であり、うち3,804,981円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年5月13日 至2022年6月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,037,171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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(477,155,469円)及び分配準備積立金(2,334,280円)より分配対象収益は484,526,920円(1万口当たり2,597.09円)であり、うち3,731,293円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,317,039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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(468,948,359円)及び分配準備積立金(3,576,496円)より分配対象収益は476,841,894円(1万口当たり2,600.64円)であり、うち3,667,103円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,556,703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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(465,835,960円)及び分配準備積立金(4,196,848円)より分配対象収益は475,589,511円(1万口当たり2,611.15円)であり、うち3,642,753円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自2022年8月13日 至2022年9月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,676,340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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(465,424,112円)及び分配準備積立金(6,103,534円)より分配対象収益は477,203,986円(1万口当たり2,622.34円)であり、うち3,639,518円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

	(自2022年3月15日 至2022年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,985,560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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(486,116,213円)及び分配準備積立金(729,874円)より分配対象収益は491,831,647円(1万口当たり2,587.64円)であり、うち3,801,377円(1万口当たり20円)を分配金額としております。	(自2022年9月13日 至2022年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,377,605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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(464,151,578円)及び分配準備積立金(8,115,753円)より分配対象収益は477,644,936円(1万口当たり2,631.97円)であり、うち3,629,549円(1万口当たり20円)を分配金額としております。
--	--	---

## (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	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	81,358,988	128,309,878
親投資信託受益証券	-	-
合計	81,358,988	128,309,878

## （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）

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022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)	0.6765円 (6,765円)	0.5908円 (5,908円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - A UDクラス	1,504,218,971	1,040,468,262	
投資信託受益証券 合計		1,504,218,971	1,040,468,262	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	4,489,701	4,519,781	
親投資信託受益証券 合計		4,489,701	4,519,781	
合計			1,044,988,043	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	119,151,320	145,926,060
投資信託受益証券	3,907,836,945	3,405,796,947
親投資信託受益証券	16,285,673	16,284,056
流動資産合計	4,043,273,938	3,568,007,063
資産合計	4,043,273,938	3,568,007,063
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	15,290,040	13,806,528
未払解約金	6,701,522	3,025,730
未払受託者報酬	100,402	98,488
未払委託者報酬	3,413,815	3,348,861
その他未払費用	8,925	8,751
流動負債合計	25,514,704	20,288,358
負債合計	25,514,704	20,288,358
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	15,290,040,538	13,806,528,107
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,272,281,304	10,258,809,402
（分配準備積立金）	47,962,851	193,037,138
元本等合計	4,017,759,234	3,547,718,705
純資産合計	4,017,759,234	3,547,718,705
負債純資産合計	4,043,273,938	3,568,007,063

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	当期 自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	156,909,874	257,638,396
有価証券売買等損益	701,788,578	237,041,615
営業収益合計	858,698,452	20,596,781
<b>営業費用</b>		
支払利息	5,639	13,113
受託者報酬	580,770	618,149
委託者報酬	19,747,678	21,019,060
その他費用	51,606	54,926
営業費用合計	20,385,693	21,705,248
営業利益又は営業損失( )	838,312,759	1,108,467
経常利益又は経常損失( )	838,312,759	1,108,467
当期純利益又は当期純損失( )	838,312,759	1,108,467
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	3,387,524	48,870
期首剰余金又は期首欠損金( )	12,752,059,977	11,272,281,304
剰余金増加額又は欠損金減少額	786,565,373	1,129,073,507
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	786,565,373	1,129,073,507
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	39,300,113	27,384,703
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	39,300,113	27,384,703
分配金	102,411,822	87,059,565
期末剰余金又は期末欠損金( )	11,272,281,304	10,258,809,402

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、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。  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。
2. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	16,247,649,564円	15,290,040,538円
期中追加設定元本額	50,401,041円	36,747,299円
期中一部解約元本額	1,008,010,067円	1,520,259,730円
2. 受益権の総数	15,290,040,538口	13,806,528,107口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は11,272,281,304円です。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は10,258,809,402円です。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	(自2021年10月13日 至2021年11月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,230,797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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(83,664,915円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は105,895,712円(1万口当たり65.63円)であり、うち24,202,788円(1万口当たり15円)を分配金額としております。	(自2022年4月13日 至2022年5月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(33,290,389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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(76,354,615円)及び分配準備積立金(47,234,380円)より分配対象収益は156,879,384円(1万口当たり104.11円)であり、うち15,067,215円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2021年11月13日 至2021年12月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,657,359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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(81,028,455円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は100,685,814円(1万口当たり62.91円)であり、うち16,003,899円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,663,400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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(80,512,325円)及び分配準備積立金(3,628,462円)より分配対象収益は106,804,187円(1万口当たり67.16円)であり、うち15,901,634円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(25,774,400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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(78,827,221円)及び分配準備積立金(10,167,408円)より分配対象収益は114,769,029円(1万口当たり73.72円)であり、うち15,567,897円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2022年5月13日 至2022年6月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(37,465,177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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(74,881,645円)及び分配準備積立金(64,143,360円)より分配対象収益は176,490,182円(1万口当たり119.48円)であり、うち14,771,085円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(40,752,499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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(74,304,241円)及び分配準備積立金(86,098,548円)より分配対象収益は201,155,288円(1万口当たり137.29円)であり、うち14,650,850円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(42,700,523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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(73,197,382円)及び分配準備積立金(110,423,877円)より分配対象収益は226,321,782円(1万口当たり156.90円)であり、うち14,424,358円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

	<p>(自2022年2月15日 至2022年3月14日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(27,900,023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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(78,216,988円)及び分配準備積立金(20,205,023円)より分配対象収益は126,322,034円(1万口当たり81.78円)であり、うち15,445,564円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自2022年3月15日 至2022年4月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(30,937,367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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(77,445,036円)及び分配準備積立金(32,315,524円)より分配対象収益は140,697,927円(1万口当たり92.01円)であり、うち15,290,040円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年8月13日 至2022年9月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(44,808,290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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(72,815,612円)及び分配準備積立金(137,835,620円)より分配対象収益は255,459,522円(1万口当たり178.15円)であり、うち14,339,529円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自2022年9月13日 至2022年10月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(44,848,256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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(70,161,402円)及び分配準備積立金(161,995,410円)より分配対象収益は277,005,068円(1万口当たり200.63円)であり、うち13,806,528円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>
--	---	--

## (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	前期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	当期 自 2022年4月13日 至 2022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	前期 2022年4月12日現在	当期 2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	457,952,470	155,111,336
親投資信託受益証券	-	-
合計	457,952,470	155,111,336

## (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）

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022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)	0.2628円 (2,628円)	0.2570円 (2,570円)

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ テッド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - B RLクラス	12,081,578,389	3,405,796,947	
投資信託受益証券 合計		12,081,578,389	3,405,796,947	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	16,175,679	16,284,056	
親投資信託受益証券 合計		16,175,679	16,284,056	
合計			3,422,081,003	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	14,970,627	18,347,331
投資信託受益証券	398,392,232	346,519,954
親投資信託受益証券	2,243,284	2,243,061
流動資産合計	415,606,143	367,110,346
資産合計	415,606,143	367,110,346
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,150,941	1,986,818
未払解約金	930,104	46
未払受託者報酬	10,565	10,230
未払委託者報酬	359,496	348,168
その他未払費用	927	899
流動負債合計	3,452,033	2,346,161
負債合計	3,452,033	2,346,161
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	537,735,458	496,704,740
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	125,581,348	131,940,555
(分配準備積立金)	12,776,458	15,569,538
元本等合計	412,154,110	364,764,185
純資産合計	412,154,110	364,764,185
負債純資産合計	415,606,143	367,110,346

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	当期 自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	17,082,389	18,155,831
有価証券売買等損益	4,217,204	19,872,501
営業収益合計	21,299,593	1,716,670
<b>営業費用</b>		
支払利息	757	1,598
受託者報酬	67,609	64,506
委託者報酬	2,300,320	2,194,947
その他費用	5,925	5,655
営業費用合計	2,374,611	2,266,706
営業利益又は営業損失( )	18,924,982	3,983,376
経常利益又は経常損失( )	18,924,982	3,983,376
当期純利益又は当期純損失( )	18,924,982	3,983,376
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( )	574,163	213,589
期首剰余金又は期首欠損金( )	137,636,301	125,581,348
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,001,884	11,872,631
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,001,884	11,872,631
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,768,907	2,250,397
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,768,907	2,250,397
分配金	14,528,843	12,211,654
期末剰余金又は期末欠損金( )	125,581,348	131,940,555

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2022年4月13日	至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. 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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	572,907,038円	537,735,458円
期中追加設定元本額	19,658,765円	9,495,772円
期中一部解約元本額	54,830,345円	50,526,490円
2. 受益権の総数	537,735,458口	496,704,740口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は125,581,348円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は131,940,555円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2021年10月13日 至2021年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,787,750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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(219,214,198円)及び分配準備積立金(12,246,108円)より分配対象収益は234,248,056円(1万口当たり4,304.99円)であり、うち3,808,916円(1万口当たり70円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年4月13日 至2022年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,569,183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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(216,163,353円)及び分配準備積立金(12,702,153円)より分配対象収益は231,434,689円(1万口当たり4,321.46円)であり、うち2,142,186円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

<p>(自2021年11月13日 至2021年12月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,378,224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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(215,057,167円)及び分配準備積立金(10,889,614円)より分配対象収益は228,325,005円(1万口当たり4,279.58円)であり、うち2,134,086円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年5月13日 至2022年6月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,687,602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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(213,298,464円)及び分配準備積立金(12,924,609円)より分配対象収益は228,910,675円(1万口当たり4,332.33円)であり、うち2,113,508円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2021年12月14日 至2022年1月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,712,115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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(216,179,746円)及び分配準備積立金(11,040,133円)より分配対象収益は229,931,994円(1万口当たり4,290.27円)であり、うち2,143,751円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年6月14日 至2022年7月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,554,929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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(203,159,438円)及び分配準備積立金(12,788,895円)より分配対象収益は218,503,262円(1万口当たり4,343.12円)であり、うち2,012,405円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2022年1月13日 至2022年2月14日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,452,850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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(216,015,214円)及び分配準備積立金(11,578,303円)より分配対象収益は230,046,367円(1万口当たり4,296.08円)であり、うち2,141,918円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年7月13日 至2022年8月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,629,075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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(199,480,595円)及び分配準備積立金(13,062,364円)より分配対象収益は215,172,034円(1万口当たり4,356.35円)であり、うち1,975,705円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
<p>(自2022年2月15日 至2022年3月14日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,453,206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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(216,805,942円)及び分配準備積立金(11,876,656円)より分配対象収益は231,135,804円(1万口当たり4,301.73円)であり、うち2,149,231円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年8月13日 至2022年9月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,002,791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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(200,083,061円)及び分配準備積立金(13,692,872円)より分配対象収益は216,778,724円(1万口当たり4,377.08円)であり、うち1,981,032円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

	(自2022年3月15日 至2022年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,782,558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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(217,024,006円)及び分配準備積立金(12,144,841円)より分配対象収益は231,951,405円(1万口当たり4,313.48円)であり、うち2,150,941円(1万口当たり40円)を分配金額としております。	(自2022年9月13日 至2022年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,847,988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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(200,716,941円)及び分配準備積立金(14,708,368円)より分配対象収益は218,273,297円(1万口当たり4,394.42円)であり、うち1,986,818円(1万口当たり40円)を分配金額としております。
--	---	--

## (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	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	24,963,109	23,683,755
親投資信託受益証券	-	-
合計	24,963,109	23,683,755

## （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）

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.7665円	0.7344円
（1万口当たり純資産額）	(7,665円)	(7,344円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - I NRクラス	682,528,963	346,519,954	
投資信託受益証券 合計		682,528,963	346,519,954	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	2,228,133	2,243,061	
親投資信託受益証券 合計		2,228,133	2,243,061	
合計			348,763,015	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンド中国元コース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	21,183,757	18,551,233
投資信託受益証券	498,171,921	425,534,801
親投資信託受益証券	1,138,261	1,138,148
流動資産合計	520,493,939	445,224,182
資産合計	520,493,939	445,224,182
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,159,976	1,997,411
未払解約金	318,515	-
未払受託者報酬	13,279	12,376
未払委託者報酬	451,720	421,008
その他未払費用	1,166	1,088
流動負債合計	2,944,656	2,431,883
負債合計	2,944,656	2,431,883
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	539,994,156	499,352,871
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	22,444,873	56,560,572
(分配準備積立金)	72,809,241	71,016,399
元本等合計	517,549,283	442,792,299
純資産合計	517,549,283	442,792,299
負債純資産合計	520,493,939	445,224,182

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	当期 自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	18,875,238	18,734,090
有価証券売買等損益	14,305,818	40,637,233
営業収益合計	33,181,056	21,903,143
<b>営業費用</b>		
支払利息	807	1,764
受託者報酬	84,173	78,259
委託者報酬	2,863,190	2,662,461
その他費用	7,392	6,880
営業費用合計	2,955,562	2,749,364
営業利益又は営業損失( )	30,225,494	24,652,507
経常利益又は経常損失( )	30,225,494	24,652,507
当期純利益又は当期純損失( )	30,225,494	24,652,507
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( )	13,068	456,997
期首剰余金又は期首欠損金( )	37,829,665	22,444,873
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,510,896	2,637,047
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,510,896	2,637,047
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,110,260	467,261
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,110,260	467,261
分配金	15,254,406	12,089,975
期末剰余金又は期末欠損金( )	22,444,873	56,560,572

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2022年4月13日	至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. 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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	542,694,503円	539,994,156円
期中追加設定元本額	19,459,620円	7,304,275円
期中一部解約元本額	22,159,967円	47,945,560円
2. 受益権の総数	539,994,156口	499,352,871口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は22,444,873円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は56,560,572円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2021年10月13日 至2021年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,021,233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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(55,785,181円)及び分配準備積立金(73,793,694円)より分配対象収益は132,600,108円(1万口当たり2,421.48円)であり、うち4,380,778円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年4月13日 至2022年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,625,747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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(54,418,210円)及び分配準備積立金(69,516,202円)より分配対象収益は126,560,159円(1万口当たり2,449.29円)であり、うち2,066,885円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

(自2021年11月13日 至2021年12月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,681,245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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(56,003,289円)及び分配準備積立金(72,256,690円)より分配対象収益は130,941,224円(1万口当たり2,390.44円)であり、うち2,191,079円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,894,808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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(56,503,253円)及び分配準備積立金(71,744,667円)より分配対象収益は131,142,728円(1万口当たり2,403.58円)であり、うち2,182,455円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,691,891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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(56,826,953円)及び分配準備積立金(72,393,555円)より分配対象収益は131,912,399円(1万口当たり2,412.83円)であり、うち2,186,842円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自2022年2月15日 至2022年3月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,673,565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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(56,229,145円)及び分配準備積立金(71,506,887円)より分配対象収益は130,409,597円(1万口当たり2,422.53円)であり、うち2,153,276円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自2022年5月13日 至2022年6月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,784,045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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(53,433,663円)及び分配準備積立金(68,423,383円)より分配対象収益は124,641,091円(1万口当たり2,464.36円)であり、うち2,023,091円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,846,796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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(53,108,038円)及び分配準備積立金(68,592,269円)より分配対象収益は124,547,103円(1万口当たり2,481.08円)であり、うち2,007,942円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,712,912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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(53,223,380円)及び分配準備積立金(68,704,785円)より分配対象収益は124,641,077円(1万口当たり2,495.41円)であり、うち1,997,922円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自2022年8月13日 至2022年9月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,047,338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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(53,297,357円)及び分配準備積立金(69,273,409円)より分配対象収益は125,618,104円(1万口当たり2,516.48円)であり、うち1,996,724円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

	(自2022年3月15日 至2022年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,018,564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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(56,705,555円)及び分配準備積立金(71,950,653円)より分配対象収益は131,674,772円(1万口当たり2,438.44円)であり、うち2,159,976円(1万口当たり40円)を分配金額としております。	(自2022年9月13日 至2022年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,780,313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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(53,430,425円)及び分配準備積立金(70,233,497円)より分配対象収益は126,444,235円(1万口当たり2,532.16円)であり、うち1,997,411円(1万口当たり40円)を分配金額としております。
--	--	---

## (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	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	24,682,252	27,682,370
親投資信託受益証券	-	-
合計	24,682,252	27,682,370

## （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）

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022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)	0.9584円 (9,584円)	0.8867円 (8,867円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - C NYクラス	502,402,363	425,534,801	
投資信託受益証券 合計		502,402,363	425,534,801	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	1,130,574	1,138,148	
親投資信託受益証券 合計		1,130,574	1,138,148	
合計			426,672,949	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	13,520,774	4,838,589
投資信託受益証券	328,412,399	74,903,533
親投資信託受益証券	238,309	238,285
流動資産合計	342,171,482	79,980,407
資産合計	342,171,482	79,980,407
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,230,729	643,340
未払解約金	99,774	168
未払受託者報酬	6,866	2,226
未払委託者報酬	233,821	75,922
その他未払費用	601	180
流動負債合計	2,571,791	721,836
負債合計	2,571,791	721,836
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	743,576,598	214,446,761
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	403,976,907	135,188,190
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	339,599,691	79,258,571
純資産合計	339,599,691	79,258,571
負債純資産合計	342,171,482	79,980,407

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自	2021年10月13日 至 2022年4月12日	自	2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		7,963,952		4,030,720
有価証券売買等損益		13,108,557		22,508,890
営業収益合計		21,072,509		18,478,170
<b>営業費用</b>				
支払利息		523		522
受託者報酬		31,517		16,358
委託者報酬		1,073,343		557,571
その他費用		2,734		1,343
営業費用合計		1,108,117		575,794
営業利益又は営業損失( )		19,964,392		19,053,964
経常利益又は経常損失( )		19,964,392		19,053,964
当期純利益又は当期純損失( )		19,964,392		19,053,964
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( )		2,028,919		4,502,371
期首剰余金又は期首欠損金( )		196,121,624		403,976,907
剰余金増加額又は欠損金減少額		84,588,409		295,381,483
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		84,588,409		295,381,483
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		305,638,473		8,223,215
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		305,638,473		8,223,215
分配金		8,798,530		3,817,958
期末剰余金又は期末欠損金( )		403,976,907		135,188,190

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2022年4月13日	至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. 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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	348,914,958円	743,576,598円
期中追加設定元本額	543,161,152円	14,175,198円
期中一部解約元本額	148,499,512円	543,305,035円
2. 受益権の総数	743,576,598口	214,446,761口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は403,976,907円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は135,188,190円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2021年10月13日 至2021年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,134,396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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(8,614,111円)及び分配準備積立金(2,074,143円)より分配対象収益は11,822,650円(1万口当たり267.49円)であり、うち1,325,930円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年4月13日 至2022年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(482,883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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,454,541円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は4,937,424円(1万口当たり235.49円)であり、うち628,971円(1万口当たり30円)を分配金額としております。</p>

(自2021年11月13日 至2021年12月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(736,879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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(7,435,820円)及び分配準備積立金(1,266,542円)より分配対象収益は9,439,241円(1万口当たり262.21円)であり、うち1,079,958円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(986,273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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(7,462,799円)及び分配準備積立金(919,454円)より分配対象収益は9,368,526円(1万口当たり259.54円)であり、うち1,082,893円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,174,029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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(10,398,385円)及び分配準備積立金(822,078円)より分配対象収益は12,394,492円(1万口当たり253.57円)であり、うち1,466,388円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2022年2月15日 至2022年3月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,357,451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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,489,916円)及び分配準備積立金(529,505円)より分配対象収益は13,376,872円(1万口当たり248.85円)であり、うち1,612,632円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2022年5月13日 至2022年6月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(598,342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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,327,852円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は4,926,194円(1万口当たり233.95円)であり、うち631,680円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(594,033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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,316,247円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は4,910,280円(1万口当たり232.03円)であり、うち634,855円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(673,337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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,300,677円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は4,974,014円(1万口当たり233.67円)であり、うち638,570円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

(自2022年8月13日 至2022年9月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(606,297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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,315,157円)及び分配準備積立金(34,620円)より分配対象収益は4,956,074円(1万口当たり232.11円)であり、うち640,542円(1万口当たり30円)を分配金額としております。

	(自2022年3月15日 至2022年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,739,953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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(16,009,002円)及び分配準備積立金(274,009円)より分配対象収益は18,022,964円(1万口当たり242.38円)であり、うち2,230,729円(1万口当たり30円)を分配金額としております。	(自2022年9月13日 至2022年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(628,958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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,334,168円)及び分配準備積立金(374円)より分配対象収益は4,963,500円(1万口当たり231.45円)であり、うち643,340円(1万口当たり30円)を分配金額としております。
--	--	---

## (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	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	19,993,058	6,198,449
親投資信託受益証券	-	-
合計	19,993,058	6,198,449

## （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）

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022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)	0.4567円 (4,567円)	0.3696円 (3,696円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - Z A Rクラス	168,436,100	74,903,533	
投資信託受益証券 合計		168,436,100	74,903,533	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	236,700	238,285	
親投資信託受益証券 合計		236,700	238,285	
合計			75,141,818	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	28,983,708	24,196,606
投資信託受益証券	688,290,948	658,779,009
親投資信託受益証券	8,087,477	8,086,674
流動資産合計	725,362,133	691,062,289
資産合計	725,362,133	691,062,289
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,012,591	3,634,018
未払解約金	503	645
未払受託者報酬	18,432	18,898
未払委託者報酬	626,963	642,638
その他未払費用	1,626	1,663
流動負債合計	4,660,115	4,297,862
負債合計	4,660,115	4,297,862
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,146,454,625	1,038,291,125
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	425,752,607	351,526,698
(分配準備積立金)	27,967,664	37,850,270
元本等合計	720,702,018	686,764,427
純資産合計	720,702,018	686,764,427
負債純資産合計	725,362,133	691,062,289

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	当期 自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	34,694,458	38,213,220
有価証券売買等損益	40,407,663	23,487,258
営業収益合計	75,102,121	61,700,478
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,576	2,442
受託者報酬	126,077	116,071
委託者報酬	4,287,746	3,947,750
その他費用	11,131	10,232
営業費用合計	4,426,530	4,076,495
営業利益又は営業損失( )	70,675,591	57,623,983
経常利益又は経常損失( )	70,675,591	57,623,983
当期純利益又は当期純損失( )	70,675,591	57,623,983
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( )	1,946,356	339,058
期首剰余金又は期首欠損金( )	587,192,338	425,752,607
剰余金増加額又は欠損金減少額	127,956,550	42,193,473
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	127,956,550	42,193,473
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,171,489	3,342,232
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,171,489	3,342,232
分配金	29,967,277	22,588,373
期末剰余金又は期末欠損金( )	425,752,607	351,526,698

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2022年4月13日	至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. 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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	1,444,738,942円	1,146,454,625円
期中追加設定元本額	22,455,073円	9,829,054円
期中一部解約元本額	320,739,390円	117,992,554円
2. 受益権の総数	1,146,454,625口	1,038,291,125口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は425,752,607円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は351,526,698円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2021年10月13日 至2021年11月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,056,401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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(122,959,781円)及び分配準備積立金(31,749,351円)より分配対象収益は160,765,533円(1万口当たり1,147.16円)であり、うち8,408,520円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年4月13日 至2022年5月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,088,980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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(97,711,705円)及び分配準備積立金(27,061,160円)より分配対象収益は129,861,845円(1万口当たり1,170.06円)であり、うち3,884,541円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>

(自2021年11月13日 至2021年12月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,443,710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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(120,054,792円)及び分配準備積立金(28,550,257円)より分配対象収益は154,048,759円(1万口当たり1,126.99円)であり、うち4,784,151円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,622,199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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(116,242,014円)及び分配準備積立金(28,227,123円)より分配対象収益は150,091,336円(1万口当たり1,134.49円)であり、うち4,630,444円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,751,618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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(102,710,195円)及び分配準備積立金(25,754,470円)より分配対象収益は133,216,283円(1万口当たり1,140.15円)であり、うち4,089,421円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年2月15日 至2022年3月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,822,321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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(101,537,227円)及び分配準備積立金(26,097,040円)より分配対象収益は132,456,588円(1万口当たり1,146.90円)であり、うち4,042,150円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年5月13日 至2022年6月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,587,575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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(96,993,916円)及び分配準備積立金(28,034,662円)より分配対象収益は130,616,153円(1万口当たり1,185.79円)であり、うち3,855,269円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,686,482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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(95,752,966円)及び分配準備積立金(29,365,780円)より分配対象収益は130,805,228円(1万口当たり1,203.09円)であり、うち3,805,322円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,423,900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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(94,656,324円)及び分配準備積立金(30,870,203円)より分配対象収益は131,950,427円(1万口当たり1,227.87円)であり、うち3,761,173円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年8月13日 至2022年9月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,526,345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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(91,824,243円)及び分配準備積立金(32,509,645円)より分配対象収益は130,860,233円(1万口当たり1,255.49円)であり、うち3,648,050円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

	(自2022年3月15日 至2022年4月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,422,897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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(100,918,098円)及び分配準備積立金(26,557,358円)より分配対象収益は132,898,353円(1万口当たり1,159.21円)であり、うち4,012,591円(1万口当たり35円)を分配金額としております。	(自2022年9月13日 至2022年10月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,466,657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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(91,705,384円)及び分配準備積立金(35,017,631円)より分配対象収益は133,189,672円(1万口当たり1,282.77円)であり、うち3,634,018円(1万口当たり35円)を分配金額としております。
--	---	---

## (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	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	65,122,195	24,225,563
親投資信託受益証券	-	-
合計	65,122,195	24,225,563

## (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)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.6286円	0.6614円
(1万口当たり純資産額)	(6,286円)	(6,614円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - M XNクラス	976,837,203	658,779,009	
投資信託受益証券 合計		976,837,203	658,779,009	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	8,032,854	8,086,674	
親投資信託受益証券 合計		8,032,854	8,086,674	
合計			666,865,683	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	30,522,060	26,358,168
投資信託受益証券	625,887,062	535,829,962
親投資信託受益証券	1,097,889	1,097,780
流動資産合計	657,507,011	563,285,910
資産合計	657,507,011	563,285,910
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	9,325,676	8,727,276
未払解約金	1,158,003	108
未払受託者報酬	16,296	15,326
未払委託者報酬	554,353	521,321
その他未払費用	1,433	1,354
流動負債合計	11,055,761	9,265,385
負債合計	11,055,761	9,265,385
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,664,478,995	2,493,507,660
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,018,027,745	1,939,487,135
(分配準備積立金)	253,573,452	236,103,610
元本等合計	646,451,250	554,020,525
純資産合計	646,451,250	554,020,525
負債純資産合計	657,507,011	563,285,910

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自	2021年10月13日 至 2022年4月12日	自	2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		93,627,667		61,876,400
有価証券売買等損益		416,516,756		58,057,209
営業収益合計		322,889,089		3,819,191
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,829		2,042
受託者報酬		128,216		95,927
委託者報酬		4,360,905		3,263,062
その他費用		11,318		8,449
営業費用合計		4,502,268		3,369,480
営業利益又は営業損失（ ）		327,391,357		449,711
経常利益又は経常損失（ ）		327,391,357		449,711
当期純利益又は当期純損失（ ）		327,391,357		449,711
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（ ）		18,741,753		311,988
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,052,359,613		2,018,027,745
剰余金増加額又は欠損金減少額		449,611,900		191,799,980
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		449,611,900		191,799,980
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		47,517,184		60,383,401
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		47,517,184		60,383,401
分配金		59,113,244		53,013,692
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,018,027,745		1,939,487,135

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、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。  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。
2. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	3,236,913,439円	2,664,478,995円
期中追加設定元本額	64,115,709円	78,374,686円
期中一部解約元本額	636,550,153円	249,346,021円
2. 受益権の総数	2,664,478,995口	2,493,507,660口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,018,027,745円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,939,487,135円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	(自2021年10月13日 至2021年11月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,131,176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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(858,480,842円)及び分配準備積立金(272,167,746円)より分配対象収益は1,151,779,764円(1万口当たり3,665.17円)であり、うち10,998,742円(1万口当たり35円)を分配金額としております。	(自2022年4月13日 至2022年5月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,738,786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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(710,451,966円)及び分配準備積立金(244,361,549円)より分配対象収益は965,552,301円(1万口当たり3,745.13円)であり、うち9,023,533円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年11月13日 至2021年12月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,799,703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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(806,270,160円)及び分配準備積立金

(263,830,142円)より分配対象収益は1,089,900,005円(1万口当たり3,697.37円)であり、うち10,317,189円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2021年12月14日 至2022年1月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,465,300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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(754,435,303円)及び分配準備積立金

(254,127,475円)より分配対象収益は1,021,028,078円(1万口当たり3,707.66円)であり、うち9,638,393円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年1月13日 至2022年2月14日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,226,940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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(742,356,106円)及び分配準備積立金

(251,365,248円)より分配対象収益は1,006,948,294円(1万口当たり3,721.56円)であり、うち9,469,990円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年5月13日 至2022年6月13日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,260,923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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(705,779,173円)及び分配準備積立金

(242,838,294円)より分配対象収益は958,878,390円(1万口当たり3,750.27円)であり、うち8,948,865円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年6月14日 至2022年7月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,739,468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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(701,395,263円)及び分配準備積立金(239,326,437円)より分配対象収益は950,461,168円(1万口当たり3,753.74円)であり、うち8,862,119円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

(自2022年7月13日 至2022年8月12日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,633,810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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(693,066,536円)及び分配準備積立金(235,777,185円)より分配対象収益は938,477,531円(1万口当たり3,757.33円)であり、うち8,742,030円(1万口当たり35円)を分配金額としております。

	<p>(自2022年2月15日 至2022年3月14日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,102,018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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(734,658,087円)及び分配準備積立金(251,579,839円)より分配対象収益は998,339,944円(1万口当たり3,731.81円)であり、うち9,363,254円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p> <p>(自2022年3月15日 至2022年4月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,097,494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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(733,206,081円)及び分配準備積立金(251,801,634円)より分配対象収益は996,105,209円(1万口当たり3,738.46円)であり、うち9,325,676円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2022年8月13日 至2022年9月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,604,745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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(691,365,769円)及び分配準備積立金(234,951,519円)より分配対象収益は935,922,033円(1万口当たり3,760.93円)であり、うち8,709,869円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p> <p>(自2022年9月13日 至2022年10月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,226,876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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(693,461,536円)及び分配準備積立金(235,604,010円)より分配対象収益は938,292,422円(1万口当たり3,762.94円)であり、うち8,727,276円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>
--	---	--

## (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	前期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	当期 自 2022年4月13日 至 2022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	前期 2022年4月12日現在	当期 2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 2022年4月12日現在	当期 2022年10月12日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	65,411,246	22,927,748
親投資信託受益証券	-	-
合計	65,411,246	22,927,748

## (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）

	前期 2022年4月12日現在	当期 2022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)	0.2426円 (2,426円)	0.2222円 (2,222円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	グローバル・サブオーディネイ ティド・デット・セキュリ ティーズ・サブ・トラスト - T R Yクラス	4,245,879,260	535,829,962	
投資信託受益証券 合計		4,245,879,260	535,829,962	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	1,090,474	1,097,780	
親投資信託受益証券 合計		1,090,474	1,097,780	
合計			536,927,742	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第25期 2022年4月12日現在	第26期 2022年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	31,557	31,375
親投資信託受益証券	961,737	961,642
流動資産合計	993,294	993,017
資産合計	993,294	993,017
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払委託者報酬	182	183
流動負債合計	182	183
負債合計	182	183
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,888	7,166
(分配準備積立金)	17,241	17,241
元本等合計	993,112	992,834
純資産合計	993,112	992,834
負債純資産合計	993,294	993,017

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第25期 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	第26期 自 2022年4月13日 至 2022年10月12日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	-	95
<b>営業収益合計</b>	-	95
<b>営業費用</b>		
委託者報酬	182	183
<b>営業費用合計</b>	182	183
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	182	278
経常利益又は経常損失( )	182	278
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	182	278
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( )	-	-
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	6,706	6,888
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
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	-	-
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	-	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
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	-	-
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	6,888	7,166

## (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26期	
	自 2022年4月13日	至 2022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25期	第26期
	2022年4月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	1,000,000口	1,000,000口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,888円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,166円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第25期	第26期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,054円)及び分配準備積立金(17,241円)より分配対象収益は21,295円(1万口当たり212.95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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,054円)及び分配準備積立金(17,241円)より分配対象収益は21,295円(1万口当たり212.95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25期	第26期
	自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	自 2022年4月13日 至 2022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25期 2022年4月12日現在	第26期 2022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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第25期 2022年4月12日現在	第26期 2022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	-	95
合計	-	95

（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25期 2022年4月12日現在	第26期 2022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）	0.9931円 (9,931円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## （2）株式以外の有価証券

2022年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	国内短期公社債マザーファンド	955,242	961,642	
親投資信託受益証券	合計	955,242	961,642	
合計			961,642	

（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）

「ハイブリッド証券ファンド米ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース」、「ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース」、「ハイブリッド証券ファンド中国元コース」、「ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース」、「ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース」、「ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース」は、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - USDクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - AUDクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - BRLクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - INRクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - CNYクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - ZARクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティ

ティーズ・サブ・トラスト - M X Nクラス」投資信託証券、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - T R Yクラス」投資信託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「投資信託受益証券」は、すべてこれらの証券であります。

「ハイブリッド証券ファンド米ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース」、「ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース」、「ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース」、「ハイブリッド証券ファンド中国元コース」、「ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース」、「ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース」、「ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース」、「ハイブリッド証券ファンドマネーボールファンド」は、「国内短期公社債マザーファンド」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。

国内短期公社債マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	178,738,726
流動資産合計	178,738,726
資産合計	178,738,726
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	177,556,900
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,181,826
元本等合計	178,738,726
純資産合計	178,738,726
負債純資産合計	178,738,726

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022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	177,537,033円
同期中追加設定元本額	149,002円
同期中一部解約元本額	129,135円
元本の内訳	
ファンド名	
フロンティア・ワールド・インカム・ファンド	99,744,150円
ハイブリッド証券ファンド円コース	27,208,015円
ハイブリッド証券ファンド米ドルコース	3,391,713円
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース	4,489,701円
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース	16,175,679円
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース	2,324,574円
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース	2,228,133円
ハイブリッド証券ファンド中国元コース	1,130,574円
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース	236,700円
ハイブリッド証券ファンドマネーボールファンド	955,242円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド円コース	1,392,481円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース	99,759円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース	1,193,555円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース	6,365,626円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネーボールファンド	962,972円
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース	8,032,854円
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース	1,090,474円
フロンティア・ワールド・インカム・ファンド（年1回決算型）	494,968円
グローバル・フォーカス（毎月決算型）	39,730円
計	177,556,900円
2. 受益権の総数	177,556,900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4月13日 至 2022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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。
-------------------	--

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 該当事項はありませぬ。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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つた場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022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)	1.0067円 (10,067円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありませぬ。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありませぬ。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありませぬ。

## 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ぬ。

## グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト

「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - USDクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - AUDクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - BRLクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - INRクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - CNYクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - ZARクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - MXNクラス」、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト - TRYクラス」は、「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト」を構成する個別クラスとなっております。

「グローバル・サブオーディネイティド・デット・セキュリティーズ・サブ・トラスト」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

## 財政状態計算書

2021年3月31日現在

グローバル・サブオーディネイティド・  
デット・セキュリティーズ・  
サブ・トラスト  
(米ドル)

資産	
流動資産	
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	466,659,219
債権：	
配当	18,572
利息	5,723,391
ブローカーに対する債権：	
担保	4,560,000
受益証券発行	838,194
現金および現金同等物	18,295,968
資産合計	496,095,344
負債	
流動負債	
純損益を通じて公正価値で測定する金融負債	6,102,880
債務：	
ブローカーに対する債務：	
担保	4,510,000
投資有価証券購入	35
受益証券償還	1,585,406
運用報酬	401,072
管理事務代行会社報酬	47,057
監査報酬	68,106
受託会社報酬	8,693
保管受託銀行サービス報酬	33,707
名義書換事務代行会社報酬	6,913
株主サービス代行会社報酬	1,698
弁護士報酬	12,750
諸報酬	1,550
負債合計（償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産を除きます。）	12,779,867
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産	483,315,477



## 要約投資明細書

2021年3月31日現在

保有高	種類	公正価値 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	債券		
	社債		
	英ポンド		
26,895,000	金融	43,278,700	8.96
	ユーロ		
81,650,000	金融	104,435,909	21.61
	米ドル		
268,319,000	金融	298,513,420	61.76
1,700,000	政府	1,850,413	0.38
	社債合計	448,078,442	92.71
	債券合計	448,078,442	92.71

保有高 / 口数	種類	公正価値 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	投資ファンド*		
	米ドル		
13,059,069	投資ファンド	13,059,069	2.70
	投資ファンド合計	13,059,069	2.70

想定元本	為替予約契約	未実現利益 (米ドル)	純資産 比率 (%)
176,919,162	売買目的為替予約契約	4,556,012	0.94
59,098,457	ヘッジ目的為替予約契約	965,696	0.20
	為替予約契約に係る未実現利益合計	5,521,708	1.14

想定元本	為替予約契約	未実現損失 (米ドル)	純資産 比率 (%)
20,929,212	売買目的為替予約契約	(619,928)	(0.13)
213,046,335	ヘッジ目的為替予約契約	(5,482,952)	(1.13)
	為替予約契約に係る未実現損失合計	(6,102,880)	(1.26)

投資合計	保有高	公正価値 (米ドル)	純資産 比率 (%)
社債	378,564,000	448,078,442	92.71
投資ファンド	13,059,069	13,059,069	2.70
為替予約契約に係る未実現利益	236,017,619	5,521,708	1.14
為替予約契約に係る未実現損失	233,975,547	(6,102,880)	(1.26)
その他の資産および負債		22,759,138	4.71
償還可能参加型受益証券の保有者に帰属する純資産		483,315,477	100.00

\*当該投資ファンドは、関連ファンドであるGoldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund, Class X (Dist.)およびGoldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund, Class I (Dist.)です。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## ハイブリッド証券ファンド米ドルコース

2022年10月31日現在

資産総額	1,763,402,695円
負債総額	1,139,715円
純資産総額( - )	1,762,262,980円
発行済数量	1,791,158,051口
1口当たり純資産額( / )	0.9839円

## ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース

2022年10月31日現在

資産総額	1,110,817,925円
負債総額	2,483,844円
純資産総額( - )	1,108,334,081円
発行済数量	1,812,472,945口
1口当たり純資産額( / )	0.6115円

## ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース

2022年10月31日現在

資産総額	3,527,087,056円
負債総額	7,784,889円
純資産総額( - )	3,519,302,167円
発行済数量	13,722,719,824口
1口当たり純資産額( / )	0.2565円

## ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース

2022年10月31日現在

資産総額	372,232,038円
負債総額	222,859円
純資産総額( - )	372,009,179円
発行済数量	497,580,390口
1口当たり純資産額( / )	0.7476円

## ハイブリッド証券ファンド中国元コース

2022年10月31日現在

資産総額	445,060,652円
負債総額	269,385円
純資産総額( - )	444,791,267円
発行済数量	499,195,995口
1口当たり純資産額( / )	0.8910円

## ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース

2022年10月31日現在

資産総額	81,105,525円
負債総額	50,219円
純資産総額( - )	81,055,306円
発行済数量	215,517,889口
1口当たり純資産額( / )	0.3761円

## ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース

2022年10月31日現在

資産総額	778,824,668円
負債総額	35,451,341円
純資産総額( - )	743,373,327円
発行済数量	1,092,837,395口
1口当たり純資産額( / )	0.6802円

## ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース

2022年10月31日現在

資産総額	571,360,285円
負債総額	344,987円
純資産総額( - )	571,015,298円
発行済数量	2,504,563,911口
1口当たり純資産額( / )	0.2280円

## ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド

2022年10月31日現在

資産総額	992,738円
負債総額	19円
純資産総額( - )	992,719円
発行済数量	1,000,000口
1口当たり純資産額( / )	0.9927円

(参考)

## 国内短期公社債マザーファンド

2022年10月31日現在

資産総額	178,734,296円
負債総額	0円
純資産総額( - )	178,734,296円
発行済数量	177,556,900口
1口当たり純資産額( / )	1.0066円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

## （２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	0	0	73,353

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	4,219
当期末残高	0	0	77,573

## 重要な会計方針

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

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

## （会計上の見積りの変更）

## 第37期

（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

## （会計方針の変更）

## 1. 収益認識に関する会計基準等の適用

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

## 2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

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

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

## （未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

## （1）概要

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

## （2）適用予定日

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

## （3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

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

(損益計算書関係)

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

(百万円)

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

## 2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
2022年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

## (金融商品関係)

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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おります。

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

## 第36期(2021年3月31日現在)

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

## 第37期(2022年3月31日現在)

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

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

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第36期(2021年3月31日現在)

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

## 第37期(2022年3月31日現在)

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

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

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

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

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

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第36期(2021年3月31日現在)

(百万円)

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

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

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

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

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

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

## 第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
投資信託	0	-	0

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

## 第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	-	6

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	4	14
退職給付の支払額	245	185
過去勤務費用の発生額	1	-
その他	1	-
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

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

(百万円)

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

## （資産除去債務関係）

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

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

## （収益認識関係）

## 1. 収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

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

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

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

## （セグメント情報等）

## 1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

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

## (1) サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435	未払 手数料	1,457
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	12,767	未払 手数料	2,524

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	7,789	未払 手数料	1,592
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,373	未払 手数料	2,651

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

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

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

（単位：百万円）

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,360
中間純利益							8,222
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,137
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,079

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

## 重要な会計方針

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

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	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。）を当中間期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当中間財務諸表への影響はありません。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2.配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末(2022年9月30日現在)

## 1.金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## 2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## 金銭の信託

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

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

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

## (有価証券関係)

第38期中間会計期間末

(2022年9月30日現在)

## 1. 子会社株式

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

## 2. その他有価証券

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

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

## (持分法損益等)

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

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2022年4月1日から2022年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

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

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (収益認識関係)

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第38期中間会計期間  
(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

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

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

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

## (セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

## 1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)サービスごとの情報

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

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## (1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド米ドルコースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド米ドルコースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド豪ドルコースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド豪ドルコースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドインドルピーコースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドインドルピーコースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド中国元コースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド中国元コースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドメキシコペソコースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドトルコリラコースの2022年4月13日から2022年10月12日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ハイブリッド証券ファンドトルコリラコースの2022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特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年12月9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 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているハイブリッド証券ファンドマネープールファンドの2022年4月13日から2022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、ハイブリッド証券ファンドマネープールファンドの2022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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年5月26日

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

## 監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

---

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2022年11月24日

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。