

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年8月17日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【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】	グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型 グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型 グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型 グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型
【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】	グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型 3兆円を上限とします。 グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型 3兆円を上限とします。 グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型 3兆円を上限とします。 グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型 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】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2022年2月16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。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に変更がありますので本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

## 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

## (3) ファンドの仕組み

## &lt; 更新後 &gt;

委託会社の概況(2022年6月末現在)

## ・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・ 資本金の額

17,180百万円

## ・ 会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

## ・ 大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

## 2 投資方針

## (5) 投資制限

## &lt; 訂正前 &gt;

運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定します。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

- ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。
- ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### 投資する株式等の範囲(信託約款)

- ( ) 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ( ) 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### 信用取引の指図範囲(信託約款)

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

#### 先物取引等の運用指図(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をする委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- ( ) 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

- ( ) 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ( ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( ) 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ( ) 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( ) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 公社債の借入れ(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。
- ( ) 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ( ) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ( ) 第1項の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券（外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。）への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約取引の指図（信託約款）

- ( ) 委託者は、信託財産に属する外貨建資産（外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額に各マザーファンドの信

託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額の合計額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ( ) 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 資金の借入れ(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産に属する外貨建資産(外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。))を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

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

- ( ) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

同一の法人の発行する株式について、次の( )の数が( )の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( ) 委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数  
( ) 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

#### <訂正後>

##### 運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定します。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

- ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。
- ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### 投資する株式等の範囲(信託約款)

- ( ) 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ( ) 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### 信用取引の指図範囲(信託約款)

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

#### 先物取引等の運用指図(信託約款)

- ( ) 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。))。
- ( ) 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( ) 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに

外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができません。

#### スワップ取引の運用指図(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ( ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( ) 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ( ) 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( ) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 公社債の借入れ(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。
- ( ) 前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ( ) 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ( ) 第1項の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券(外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。)への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約取引の指図(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産に属する外貨建資産(外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。)と各マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する各マザーファンド受益証券の時価総額に各マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額の合計額をいいます。)と



の合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ( ) 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 資金の借入れ(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

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

- ( ) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

同一の法人の発行する株式について、次の( )の数が( )の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( ) 委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数  
( ) 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

### 3 投資リスク

<更新後>



# 投資リスク

## ■ リスクの定量的比較 (2017年7月末～2022年6月末：月次)

### I (為替ヘッジあり) 年2回決算型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	11.4	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 15.8	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.5	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	△ 0.4	9.0	16.7	11.1	0.1	3.7	3.0

- \* 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す。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2021年11月から2022年6月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

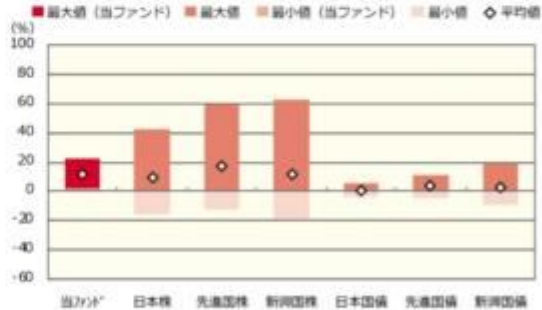
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年7月から2022年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2022年6月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### II (為替ヘッジなし) 年2回決算型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	22.3	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	2.0	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.5	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	11.5	9.0	16.7	11.1	0.1	3.7	3.0

- \* 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す。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2021年11月から2022年6月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年7月から2022年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2022年6月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。



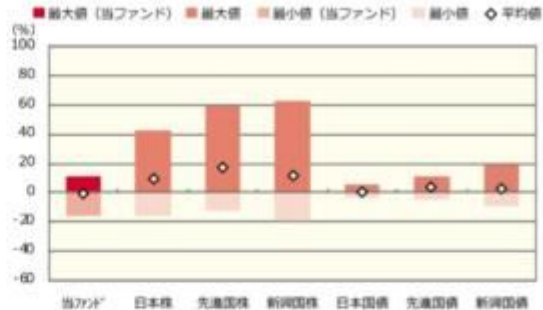
# 投資リスク

## I (為替ヘッジあり) 隔月分配型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	11.4	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△15.9	△16.0	△12.4	△19.4	△3.5	△4.5	△9.4
平均値 (%)	△0.4	9.0	16.7	11.1	0.1	3.7	3.0

- \* 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す。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2021年11月から2022年6月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

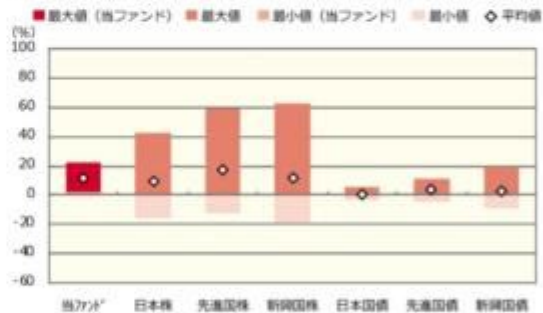
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年7月から2022年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2022年6月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## I (為替ヘッジなし) 隔月分配型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	22.5	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	2.1	△16.0	△12.4	△19.4	△3.5	△4.5	△9.4
平均値 (%)	11.6	9.0	16.7	11.1	0.1	3.7	3.0

- \* 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す。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2021年11月から2022年6月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2017年7月から2022年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2022年6月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。



## 投資リスク

### <代表的な資産クラスの指数>

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

### ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。
  - MSCI-KOKUSAI 指数（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（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（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（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI 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。
  - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、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、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
  - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、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。
  - JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価値を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると思われる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMSLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSTI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

（出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他）

## 4 手数料等及び税金

### （5）課税上の取扱い

## &lt;更新後&gt;

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

## &lt;収益分配金に対する課税&gt;

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（国税（所得税及び復興特別所得税）15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除は適用されません。

## &lt;換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税&gt;

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（国税15.315%および地方税5%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

## 損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>（注2）</sup>	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> <li>・特定公社債<sup>（注1）</sup>の利子</li> <li>・公募公社債投資信託の収益分配金</li> </ul>	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> <li>・譲渡益</li> <li>・譲渡損</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・上場株式の配当</li> <li>・公募株式投資信託の収益分配金</li> </ul>

（注1）「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

（注2）株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（国税15.315%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。



## 換金（解約）時および償還時の課税について

## 〔個人の投資家の場合〕

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

## 〔法人の投資家の場合〕

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

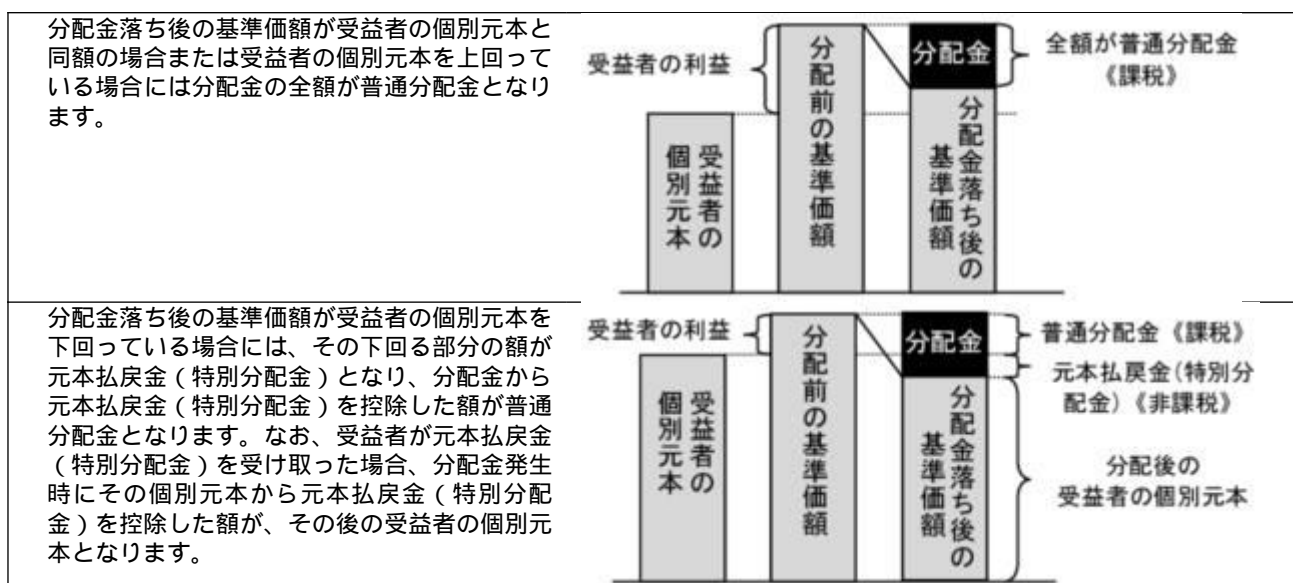
## 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

## 分配金の課税について

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



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

\* 外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

\* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2022年6月末現在）が変更になる場合があります。

## 5 運用状況

以下は2022年6月30日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## （１）投資状況

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年２回決算型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	8,272,862,598	99.72
現金・預金・その他資産（負債控除後）		23,035,663	0.27
合計（純資産総額）		8,295,898,261	100.00

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年２回決算型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	77,390,189,136	98.87
現金・預金・その他資産（負債控除後）		881,566,024	1.12
合計（純資産総額）		78,271,755,160	100.00

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	760,474,494	99.72
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,102,055	0.27
合計（純資産総額）		762,576,549	100.00

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,659,956,076	99.00
現金・預金・その他資産（負債控除後）		47,049,737	0.99
合計（純資産総額）		4,707,005,813	100.00

## （参考）ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	1,169,209,700	5.25
	アメリカ	11,337,919,375	50.94
	カナダ	2,112,693,462	9.49
	メキシコ	98,636,548	0.44
	ブラジル	565,479,087	2.54

	ドイツ	117,094,365	0.52
	イタリア	189,176,411	0.85
	フランス	396,969,708	1.78
	オランダ	385,760,059	1.73
	スペイン	556,519,725	2.50
	ベルギー	287,796,506	1.29
	フィンランド	124,008,407	0.55
	イギリス	158,709,544	0.71
	スイス	344,980,920	1.55
	スウェーデン	293,015,736	1.31
	ノルウェー	487,843,122	2.19
	オーストラリア	662,968,619	2.97
	ニュージーランド	109,601,467	0.49
	香港	443,529,760	1.99
	韓国	142,600,199	0.64
	台湾	525,006,948	2.35
	小計	20,509,519,668	92.16
投資信託受益証券	アメリカ	217,185,024	0.97
投資証券	日本	142,163,700	0.63
	アメリカ	535,142,270	2.40
	カナダ	129,317,371	0.58
	イギリス	107,496,410	0.48
	小計	914,119,751	4.10
現金・預金・その他資産（負債控除後）		612,558,953	2.75
合計（純資産総額）		22,253,383,396	100.00

## （参考）米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アメリカ	29,951,618,264	92.47
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,438,288,834	7.52
合計（純資産総額）		32,389,907,098	100.00

## （参考）米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	10,422,111,602	75.63
特殊債券	アメリカ	1,159,492,978	8.41
社債券	アメリカ	1,658,479,504	12.03
現金・預金・その他資産（負債控除後）		539,683,460	3.91
合計（純資産総額）		13,779,767,544	100.00



## （参考）ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	328,368,600	1.44
	アメリカ	40,925,957	0.18
	カナダ	87,401,729	0.38
	スペイン	116,394,359	0.51
	ベルギー	74,435,561	0.32
	イギリス	376,930,423	1.66
	オーストラリア	127,092,316	0.56
	香港	184,925,538	0.81
	シンガポール	597,924,601	2.63
	小計	1,934,399,084	8.53
投資証券	日本	1,362,771,900	6.01
	アメリカ	15,949,285,112	70.38
	カナダ	166,364,825	0.73
	イギリス	726,374,716	3.20
	オーストラリア	1,030,598,429	4.54
	香港	511,333,005	2.25
	シンガポール	469,843,279	2.07
	小計	20,216,571,266	89.21
現金・預金・その他資産（負債控除後）		509,051,567	2.24
合計（純資産総額）		22,660,021,917	100.00

## （2）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	2,619,324,811	1.0643	2,787,917,181	1.1067	2,898,806,768	34.94
2	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	1,426,747,264	1.4624	2,086,475,199	1.4532	2,073,349,124	24.99
3	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバル小型 株マザーファンド	1,783,890,245	1.1823	2,109,093,437	1.1581	2,065,923,292	24.90
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド	1,092,825,396	1.0920	1,193,449,828	1.1299	1,234,783,414	14.88

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
----	---------

親投資信託受益証券	99.72
合 計	99.72

## グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)年2回決算型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG先進国社債マ ザーファンド	24,883,268,309	1.0640	26,475,797,481	1.1067	27,538,313,037	35.18
2	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバルREI T マザーファンド	13,258,459,598	1.4641	19,411,773,476	1.4532	19,267,193,487	24.61
3	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバル小型 株 マザーファンド	16,292,068,875	1.1845	19,298,765,245	1.1581	18,867,844,964	24.10
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG新興国国債マ ザーファンド	10,369,800,556	1.0916	11,319,674,287	1.1299	11,716,837,648	14.96

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.87
合 計	98.87

## グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG先進国社債マ ザーファンド	240,732,308	1.0642	256,201,824	1.1067	266,418,445	34.93
2	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバルREI T マザーファンド	131,176,488	1.4647	192,134,202	1.4532	190,625,672	24.99
3	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバル小型 株 マザーファンド	164,015,228	1.1837	194,144,826	1.1581	189,946,035	24.90
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG新興国国債マ ザーファンド	100,437,510	1.0919	109,674,841	1.1299	113,484,342	14.88

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.72
合 計	99.72

## グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG先進国社債マ ザーファンド	1,523,709,926	1.0640	1,621,227,362	1.1067	1,686,289,775	35.82

2	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバル小型 株 マザーファンド	975,403,429	1.1846	1,155,500,972	1.1581	1,129,614,711	23.99
3	日本	親投資信託 受益証券	ACI ESGグローバルREI T マザーファンド	776,876,782	1.4638	1,137,246,475	1.4532	1,128,957,339	23.98
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てESG新興国債 マ ザーファンド	632,882,779	1.0916	690,854,842	1.1299	715,094,251	15.19

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.00
合 計	99.00

## (参考) ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	カナダ	株式	WHITECAP RESOURCES INC	石油・ガス・消耗 燃料	383,125	795.00	304,584,375	966.72	370,374,600	1.66
2	アメリカ	株式	WINTRUST FINANCIAL CORP	銀行	31,858	12,769.37	406,806,853	11,023.24	351,178,444	1.57
3	アメリカ	株式	NOW INC/DE	商社・流 通業	258,789	1,296.97	335,643,523	1,316.22	340,625,431	1.53
4	アメリカ	投資証券	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		32,262	11,860.16	382,632,698	10,402.71	335,612,385	1.50
5	カナダ	株式	DEFINITY FINANCIAL CORP-W/I	保険	92,273	2,905.57	268,106,100	3,508.60	323,749,048	1.45
6	ブラジル	株式	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	不動産管 理・開発	544,800	579.93	315,950,041	591.76	322,395,495	1.44
7	アメリカ	株式	TENABLE HOLDINGS INC	ソフト ウェア	48,075	7,178.38	345,100,712	6,384.32	306,926,319	1.37
8	ベルギー	株式	D'IETEREN GROUP	販売	14,419	22,849.58	329,468,108	19,959.53	287,796,506	1.29
9	アメリカ	株式	CLEAN HARBORS INC	商業サー ビス・用 品	23,745	14,110.17	335,046,066	11,970.43	284,237,965	1.27
10	アメリカ	株式	OLLIE S BARGAIN OUTLET HOLDI	複合小売 り	34,191	7,348.70	251,259,678	8,244.53	281,888,985	1.26
11	アメリカ	株式	BJ'S WHOLESALE CLUB HOLDINGS	食品・生 活必需品 小売り	32,689	8,740.41	285,715,589	8,586.23	280,675,521	1.26
12	カナダ	株式	VERMILION ENERGY INC	石油・ガス・消耗 燃料	99,070	2,751.36	272,577,288	2,724.20	269,886,494	1.21
13	アメリカ	株式	WINS HOLDINGS LTD-ADR	情報技術 サービス	25,720	11,791.48	303,276,943	10,141.65	260,843,392	1.17
14	アメリカ	株式	MGP INGREDIENTS INC	飲料	19,424	10,935.49	212,411,142	13,311.26	258,558,015	1.16
15	フランス	株式	NEXANS SA	電気設備	23,306	12,635.79	294,489,791	11,092.59	258,523,961	1.16
16	アメリカ	株式	SELECTIVE INSURANCE GROUP	保険	21,921	11,422.46	250,391,907	11,646.50	255,302,988	1.14
17	アメリカ	株式	COMMERCIAL METALS CO	金属・鋁 業	54,419	5,133.67	279,369,331	4,682.65	254,825,500	1.14
18	台湾	株式	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	機械	52,928	4,374.61	231,539,450	4,695.05	248,500,135	1.11
19	アメリカ	株式	PAYCOR HCM INC	ソフト ウェア	67,717	4,118.46	278,890,296	3,660.29	247,863,885	1.11
20	スペイン	株式	ACCIONA S.A.	電力	9,621	23,806.45	229,041,884	25,109.91	241,582,540	1.08

21	アメリカ	株式	HARMONY BIOSCIENCES HOLDINGS	医薬品	34,973	5,284.85	184,827,198	6,899.60	241,299,935	1.08
22	オランダ	株式	ASR NEDERLAND NV	保険	43,489	5,776.12	251,198,002	5,534.16	240,675,489	1.08
23	アメリカ	株式	GLACIER BANCORP INC	銀行	36,665	7,820.82	286,750,718	6,496.40	238,190,521	1.07
24	アメリカ	株式	R1 RCM INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	80,387	3,411.53	274,242,888	2,890.78	232,381,293	1.04
25	日本	株式	アシックス	その他製品	94,500	2,537.84	239,825,903	2,453.00	231,808,500	1.04
26	アメリカ	株式	KINSALE CAPITAL GROUP INC	保険	7,562	29,531.82	223,319,640	30,409.93	229,959,915	1.03
27	アメリカ	株式	DRIVEN BRANDS HOLDINGS INC	商業サービス・用品	59,387	4,235.01	251,504,808	3,831.14	227,519,935	1.02
28	アメリカ	株式	SOVOS BRANDS INC	食品	106,234	2,056.22	218,441,140	2,098.03	222,882,969	1.00
29	香港	株式	GDS HOLDINGS LIMITED	情報技術サービス	394,900	544.35	214,965,150	563.21	222,413,011	0.99
30	日本	株式	日本瓦斯	小売業	112,300	1,569.49	176,254,036	1,924.00	216,065,200	0.97

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	0.63
		食料品	0.82
		電気機器	0.76
		その他製品	1.04
		小売業	1.59
		不動産業	0.37
	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.52
		不動産管理・開発	2.64
		エネルギー設備・サービス	0.85
		石油・ガス・消耗燃料	3.83
		化学	1.10
		建設資材	1.01
		容器・包装	1.52
		金属・鉱業	4.49
		建設関連製品	0.43
		電気設備	1.66
		機械	4.31
		商社・流通業	3.72
		商業サービス・用品	3.17
		運送インフラ	0.57
		自動車部品	1.08
		繊維・アパレル・贅沢品	1.05
		ホテル・レストラン・レジャー	4.74
販売	1.29		
インターネット販売・通信販売	0.21		

	複合小売り	1.26
	専門小売り	0.87
	食品・生活必需品小売り	3.18
	飲料	2.38
	食品	2.63
	パーソナル用品	1.18
	ヘルスケア機器・用品	0.86
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	3.07
	バイオテクノロジー	0.05
	医薬品	1.08
	銀行	5.30
	保険	6.79
	情報技術サービス	3.34
	ソフトウェア	5.21
	コンピュータ・周辺機器	0.52
	電子装置・機器・部品	1.31
	半導体・半導体製造装置	3.49
	電力	1.57
	各種消費者サービス	1.80
	ヘルスケア・テクノロジー	0.75
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.97
	専門サービス	0.89
投資信託受益証券		0.97
投資証券		4.10
合 計		97.24

## (参考) 米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	社債券	CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	5,000,000	14,914.90	745,745,412	12,859.31	642,965,751	3.85	2027/11/15	1.98
2	アメリカ	社債券	RALPH LAUREN CORP	5,200,000	14,229.37	739,927,565	12,038.59	626,006,816	2.95	2030/6/15	1.93
3	アメリカ	社債券	STARBUCKS CORP	5,300,000	13,912.20	737,346,819	11,628.32	616,301,046	2.55	2030/11/15	1.90
4	アメリカ	社債券	ASHTAD CAPITAL INC	4,600,000	14,304.39	658,002,282	12,316.66	566,566,543	4	2028/5/1	1.74
5	アメリカ	社債券	HEALTHPEAK PROPERTIES	4,800,000	14,107.82	677,175,680	11,758.79	564,422,225	2.875	2031/1/15	1.74
6	アメリカ	社債券	NXP BV/NXP FDG/NXP USA	4,600,000	14,523.27	668,070,655	12,205.30	561,443,919	3.4	2030/5/1	1.73
7	アメリカ	社債券	HP INC	4,700,000	14,355.79	674,722,523	11,932.61	560,832,843	3.4	2030/6/17	1.73
8	アメリカ	社債券	NEXTERA ENERGY CAPITAL	4,800,000	13,560.69	650,913,569	11,456.48	549,911,270	2.25	2030/6/1	1.69
9	アメリカ	社債券	FEDEX CORP	4,700,000	15,369.81	722,381,421	11,488.89	539,978,292	4.05	2048/2/15	1.66
10	アメリカ	社債券	SCENTRE GROUP TRUST 2	4,400,000	14,503.66	638,161,107	12,247.74	538,900,936	4.75	2080/9/24	1.66

11	アメリカ	社債券	HOME DEPOT INC	4,000,000	17,384.36	695,374,535	13,262.13	530,485,478	4.5	2048/12/6	1.63
12	アメリカ	社債券	SYSCO CORPORATION	3,562,000	17,186.26	612,174,617	14,570.45	518,999,436	5.95	2030/4/1	1.60
13	アメリカ	社債券	AES CORP/THE	4,200,000	14,708.51	617,757,516	12,353.27	518,837,553	3.95	2030/7/15	1.60
14	アメリカ	社債券	MCDONALD'S CORP	4,000,000	15,017.43	600,697,502	12,958.27	518,331,072	3.6	2030/7/1	1.60
15	アメリカ	社債券	ENEL FINANCE INTL NV	5,550,000	13,230.52	734,293,941	9,229.76	512,251,975	2.875	2041/7/12	1.58
16	アメリカ	社債券	INGERSOLL-RAND LUX FINAN	4,000,000	14,988.69	599,547,900	12,788.01	511,520,472	3.8	2029/3/21	1.57
17	アメリカ	社債券	AVANGRID INC	4,000,000	15,025.05	601,002,011	12,755.43	510,217,419	3.8	2029/6/1	1.57
18	アメリカ	社債券	DELL INT LLC / EMC CORP	3,550,000	16,526.13	586,677,682	14,256.41	506,102,705	6.1	2027/7/15	1.56
19	アメリカ	社債券	ELECTRICITE DE FRANCE SA	4,000,000	14,512.68	580,507,295	12,611.60	504,464,284	5.625	2099/1/22	1.55
20	アメリカ	社債券	WALGREENS BOOTS ALLIANCE	4,000,000	14,437.26	577,490,549	12,108.42	484,337,006	3.2	2030/4/15	1.49
21	アメリカ	社債券	RAYTHEON TECH CORP	4,600,000	13,906.92	639,718,738	10,478.46	482,009,354	3.125	2050/7/1	1.48
22	アメリカ	社債券	AMERICAN ELECTRIC POWER	4,400,000	13,728.67	604,061,577	10,766.90	473,743,661	3.875	2062/2/15	1.46
23	アメリカ	社債券	E.ON INTL FINANCE BV	3,150,000	19,318.12	608,520,819	14,940.00	470,610,047	6.65	2038/4/30	1.45
24	アメリカ	社債券	UDR INC	4,000,000	13,844.81	553,792,671	11,623.84	464,953,705	3	2031/8/15	1.43
25	アメリカ	社債券	WELLTOWER INC	4,000,000	13,969.90	558,796,061	11,542.77	461,710,835	2.75	2031/1/15	1.42
26	アメリカ	社債券	HP ENTERPRISE CO	3,300,000	18,371.49	606,259,475	13,975.81	461,202,052	6.35	2045/10/15	1.42
27	アメリカ	社債券	KROGER CO	4,200,000	12,537.91	526,592,437	10,870.34	456,554,429	1.7	2031/1/15	1.40
28	アメリカ	社債券	HASBRO INC	3,600,000	15,003.90	540,140,646	12,537.10	451,335,899	3.9	2029/11/19	1.39
29	アメリカ	社債券	MOLSON COORS BREWING CO	4,000,000	15,156.42	606,256,831	11,265.57	450,623,026	4.2	2046/7/15	1.39
30	アメリカ	社債券	VOLKSWAGEN GROUP AMERICA	3,600,000	13,441.33	483,888,122	12,248.97	440,963,232	1.25	2025/11/24	1.36

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	92.47
合計	92.47

## (参考)米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	3,440,000	19,108.88	657,345,556	15,361.84	528,447,568	5.75	2042/1/20	3.83
2	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	3,820,000	16,262.18	621,215,521	12,671.60	484,055,227	4.125	2047/10/11	3.51
3	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	3,200,000	14,673.58	469,554,845	12,994.30	415,817,737	3.125	2030/4/16	3.01
4	アメリカ	社債券	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	3,060,000	15,994.63	489,435,717	12,151.70	371,842,252	5.375	2030/4/24	2.69
5	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	2,080,000	21,499.59	447,191,603	17,282.28	359,471,477	8.5	2035/10/12	2.60
6	アメリカ	社債券	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	2,600,000	15,554.69	404,422,179	13,612.30	353,919,876	5.375	2029/1/25	2.56

7	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	2,620,000	14,198.31	371,995,942	13,406.94	351,261,859	4.875	2025/2/1	2.54
8	アメリカ	国債証券	MEXICO GLOBAL	2,250,000	18,024.78	405,557,580	14,842.47	333,955,653	6.75	2034/9/27	2.42
9	アメリカ	国債証券	KINGDOM OF BAHRAIN	2,340,000	15,239.82	356,611,789	14,112.33	330,228,593	7	2026/1/26	2.39
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	2,800,000	13,309.40	372,663,214	11,590.56	324,535,748	2.45	2031/1/31	2.35
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,600,000	14,228.38	369,938,088	11,688.80	303,908,830	4.5	2029/3/15	2.20
12	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,700,000	19,392.46	329,671,887	17,660.72	300,232,323	9.5	2030/2/2	2.17
13	アメリカ	国債証券	PANAMA GLOBAL	1,860,000	18,439.15	342,968,323	16,057.37	298,667,210	8.875	2027/9/30	2.16
14	アメリカ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	2,200,000	14,089.71	309,973,838	13,088.06	287,937,408	5.95	2027/1/25	2.08
15	アメリカ	特殊債券	EXPORT IMPORT BANK CHINA	2,200,000	16,894.06	371,669,449	12,924.94	284,348,692	4	2047/11/28	2.06
16	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,040,000	15,102.95	308,100,202	13,169.12	268,650,230	4.5	2029/4/22	1.94
17	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,120,000	13,751.86	291,539,533	12,255.90	259,825,140	4.5	2029/5/30	1.88
18	アメリカ	国債証券	PANAMA GLOBAL	1,700,000	18,196.82	309,345,999	14,720.71	250,252,106	6.7	2036/1/26	1.81
19	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,800,000	14,000.58	252,010,584	13,104.19	235,875,510	4.75	2026/6/15	1.71
20	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	1,600,000	18,302.81	292,845,101	14,344.67	229,514,806	5.103	2048/4/23	1.66
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,300,000	21,087.15	274,133,062	17,201.47	223,619,170	8.75	2033/11/21	1.62
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000	13,476.20	242,571,737	11,853.53	213,363,576	4.85	2029/9/30	1.54
23	アメリカ	国債証券	PERU GLOBAL	1,430,000	18,486.44	264,356,212	14,774.18	211,270,811	6.55	2037/3/14	1.53
24	アメリカ	国債証券	COLOMBIA GLOBAL	1,690,000	16,520.32	279,193,461	12,483.20	210,966,247	7.375	2037/9/18	1.53
25	アメリカ	特殊債券	PETROLIAM NASIONAL BERHD	1,310,000	17,344.69	227,215,465	15,625.49	204,694,025	7.625	2026/10/15	1.48
26	アメリカ	国債証券	BRAZIL GLOBAL	1,350,000	17,825.42	240,643,250	14,857.02	200,569,885	8.25	2034/1/20	1.45
27	アメリカ	特殊債券	EXPORT IMPORT BANK CHINA	1,400,000	14,647.30	205,062,313	13,771.54	192,801,663	3.625	2024/7/31	1.39
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,600,000	13,990.01	223,840,289	11,986.21	191,779,513	3.875	2027/4/25	1.39
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,500,000	13,953.66	209,304,918	12,635.38	189,530,739	4.85	2027/9/27	1.37
30	アメリカ	国債証券	CHINA GOVT INTL BOND	1,600,000	13,140.07	210,241,154	11,730.85	187,693,612	1.2	2030/10/21	1.36

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	75.63
特殊債券	8.41
社債券	12.03
合計	96.08

## (参考) ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
----	----------	----	-----	----	----	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC		119,306	18,304.85	2,183,879,385	16,170.61	1,929,250,892	8.51
2	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE		26,556	48,213.29	1,280,352,282	42,515.68	1,129,046,419	4.98
3	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC		11,209	98,996.97	1,109,657,119	88,773.66	995,063,955	4.39
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC		82,139	11,792.02	968,584,794	11,375.87	934,403,112	4.12
5	アメリカ	投資証券	AGREE REALTY CORP		77,040	9,295.04	716,090,124	10,003.60	770,678,053	3.40
6	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST		40,306	21,922.10	883,592,372	18,304.18	737,768,505	3.25
7	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		71,553	10,390.62	743,480,145	9,727.51	696,032,924	3.07
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC		39,491	21,149.49	835,214,663	17,413.03	687,658,047	3.03
9	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC		139,778	5,516.40	771,072,030	4,871.27	680,897,105	3.00
10	アメリカ	投資証券	UDR INC		97,260	7,751.12	753,874,204	6,326.91	615,355,967	2.71
11	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP		60,075	8,770.17	526,868,493	9,480.12	569,518,497	2.51
12	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP		204,607	3,258.45	666,701,925	2,758.20	564,347,519	2.49
13	アメリカ	投資証券	KITE REALTY GROUP TRUST		221,280	2,989.19	661,448,317	2,454.77	543,192,125	2.39
14	香港	投資証券	LINK REIT		451,500	1,191.71	538,058,152	1,132.52	511,333,005	2.25
15	アメリカ	投資証券	VENTAS INC		71,093	7,394.84	525,721,679	7,047.22	501,008,068	2.21
16	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		22,674	19,766.96	448,196,174	19,755.72	447,941,359	1.97
17	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC		200,782	2,443.83	490,678,762	2,145.87	430,853,275	1.90
18	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC		65,374	6,667.66	435,892,235	6,585.24	430,503,637	1.89
19	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP		239,270	2,136.63	511,233,345	1,708.98	408,907,645	1.80
20	アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		50,942	9,499.26	483,911,303	7,913.77	403,143,373	1.77
21	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券		1,193	324,469	387,092,268	335,000	399,655,000	1.76
22	オーストラリア	投資証券	VICINITY CENTRES		2,093,476	176.23	368,934,177	180.28	377,428,601	1.66
23	イギリス	株式	GRAINGER PLC	不動産管理・開発	786,528	500.44	393,613,375	479.23	376,930,423	1.66
24	シンガポール	投資証券	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		1,727,500	207.84	359,059,376	217.78	376,218,405	1.66
25	シンガポール	株式	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	不動産管理・開発	958,900	361.48	346,627,250	379.64	364,043,508	1.60
26	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券		1,975	183,743	362,893,886	184,200	363,795,000	1.60
27	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP		47,115	7,335.99	345,635,390	7,565.23	356,436,188	1.57
28	イギリス	投資証券	SEGRO PLC		203,513	2,021.67	411,436,179	1,684.44	342,805,874	1.51
29	アメリカ	投資証券	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		115,990	3,523.47	408,688,337	2,955.02	342,752,955	1.51
30	日本	株式	東急不動産ホールディングス	不動産業	459,900	650.59	299,210,070	714.00	328,368,600	1.44

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	不動産業	1.44
	国外	不動産管理・開発	6.01
		情報技術サービス	0.56
		各種電気通信サービス	0.51



投資証券		89.21
合 計		97.75

#### 投資不動産物件

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型  
該当事項はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型  
該当事項はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型  
該当事項はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型  
該当事項はありません。

（参考）ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド  
該当事項はありません。

（参考）米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド  
該当事項はありません。

（参考）米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド  
該当事項はありません。

（参考）ACI ESGグローバルREIT 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

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

該当事項はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

該当事項はありません。

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

該当事項はありません。

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

該当事項はありません。

（参考）ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）ACI ESGグローバルREIT 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

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

2022年6月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2021年 5月18日)	6,440	6,446	1.0472	1.0482
第2計算期間 (2021年11月18日)	9,312	9,320	1.1294	1.1304
第3計算期間 (2022年 5月18日)	8,523	8,523	0.9486	0.9486
2021年 6月末日	7,388		1.0812	
7月末日	7,902		1.0976	
8月末日	8,254		1.1101	
9月末日	8,692		1.0885	
10月末日	9,218		1.1188	
11月末日	9,370		1.1121	
12月末日	9,591		1.1274	

2022年 1月末日	9,051		1.0477
2月末日	9,028		1.0342
3月末日	9,242		1.0460
4月末日	8,941		0.9984
5月末日	8,725		0.9667
6月末日	8,295		0.9092

### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

2022年6月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2021年 5月18日)	21,698	21,718	1.1032	1.1042
第2計算期間 (2021年11月18日)	62,601	62,652	1.2337	1.2347
第3計算期間 (2022年 5月18日)	75,701	75,766	1.1591	1.1601
2021年 6月末日	31,638		1.1493	
7月末日	39,976		1.1559	
8月末日	46,264		1.1722	
9月末日	52,478		1.1672	
10月末日	57,652		1.2207	
11月末日	65,161		1.2089	
12月末日	72,519		1.2406	
2022年 1月末日	71,962		1.1550	
2月末日	72,796		1.1412	
3月末日	79,404		1.2215	
4月末日	78,692		1.2174	
5月末日	77,569		1.1742	
6月末日	78,271		1.1699	

### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

2022年6月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間 (2021年 5月18日)	708	709	1.0456	1.0471
第2特定期間 (2021年11月18日)	865	866	1.1247	1.1257
第3特定期間 (2022年 5月18日)	810	810	0.9433	0.9433
2021年 6月末日	789		1.0795	
7月末日	824		1.0943	
8月末日	860		1.1068	
9月末日	863		1.0843	

10月末日	901		1.1142
11月末日	894		1.1074
12月末日	933		1.1227
2022年 1月末日	871		1.0423
2月末日	860		1.0286
3月末日	879		1.0403
4月末日	842		0.9928
5月末日	827		0.9612
6月末日	762		0.9039

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

2022年6月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間 (2021年 5月18日)	1,610	1,613	1.1033	1.1053
第2特定期間 (2021年11月18日)	4,020	4,025	1.2296	1.2311
第3特定期間 (2022年 5月18日)	4,541	4,551	1.1506	1.1531
2021年 6月末日	2,352		1.1494	
7月末日	2,872		1.1540	
8月末日	3,245		1.1700	
9月末日	3,607		1.1636	
10月末日	3,955		1.2171	
11月末日	4,064		1.2048	
12月末日	4,439		1.2361	
2022年 1月末日	4,319		1.1494	
2月末日	4,354		1.1356	
3月末日	4,822		1.2133	
4月末日	4,741		1.2093	
5月末日	4,646		1.1658	
6月末日	4,707		1.1620	

## 分配の推移

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0010円
第2計算期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	0.0010円
第3計算期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	0.0000円

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0010円
第2計算期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	0.0010円
第3計算期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	0.0010円

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0030円
第2特定期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	0.0035円
第3特定期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	0.0015円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	0.0040円
第2特定期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	0.0050円
第3特定期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	0.0060円

各特定期間中の分配金単価の合計を表示しております。

## 収益率の推移

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	4.8%
第2計算期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	7.9%
第3計算期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	16.0%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	10.4%

第2計算期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	11.9%
第3計算期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	6.0%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

	計算期間	収益率
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	4.9%
第2特定期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	7.9%
第3特定期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	16.0%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

	計算期間	収益率
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	10.7%
第2特定期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	11.9%
第3特定期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	5.9%

各特定期間中の分配金単価の合計を加算して算出しております。

各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### （４）設定及び解約の実績

##### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	6,347,790,418	197,137,682	6,150,652,736
第2計算期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	3,373,092,421	1,278,218,602	8,245,526,555
第3計算期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	1,363,512,843	623,720,881	8,985,318,517

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

##### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	20,545,225,134	877,117,524	19,668,107,610

第2計算期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	37,289,795,224	6,215,626,965	50,742,275,869
第3計算期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	20,588,899,595	6,018,075,617	65,313,099,847

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	704,781,435	27,668,750	677,112,685
第2特定期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	231,324,502	138,829,855	769,607,332
第3特定期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	114,318,429	24,647,915	859,277,846

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間	2020年11月30日～2021年 5月18日	1,542,043,421	82,217,674	1,459,825,747
第2特定期間	2021年 5月19日～2021年11月18日	2,197,011,543	386,875,794	3,269,961,496
第3特定期間	2021年11月19日～2022年 5月18日	1,106,753,860	429,308,185	3,947,407,171

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 参考情報

< 更新後 >

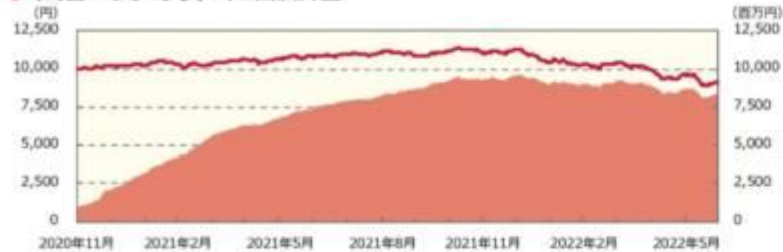


## 運用実績（2022年6月30日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） — 純資産総額（右軸）

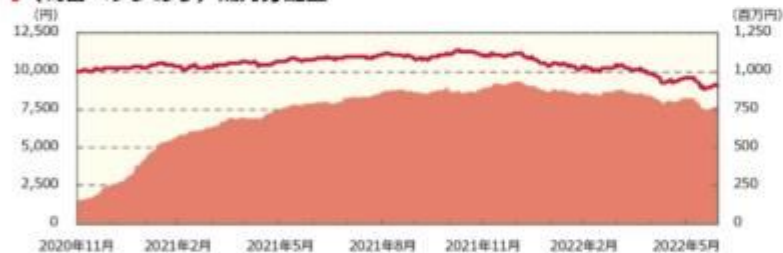
#### ■（為替ヘッジあり）年2回決算型



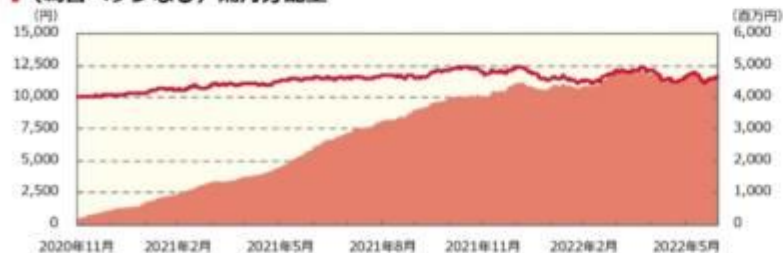
#### ■（為替ヘッジなし）年2回決算型



#### ■（為替ヘッジあり）隔月分配型



#### ■（為替ヘッジなし）隔月分配型



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

#### ■（為替ヘッジあり）年2回決算型

2022年5月	0 円
2021年11月	10 円
2021年5月	10 円
--	--
--	--
設定来累計	20 円

#### ■（為替ヘッジなし）年2回決算型

2022年5月	10 円
2021年11月	10 円
2021年5月	10 円
--	--
--	--
設定来累計	30 円

#### ■（為替ヘッジあり）隔月分配型

2022年5月	0 円
2022年3月	5 円
2022年1月	10 円
2021年11月	10 円
2021年9月	10 円
直近1年間累計	80 円
設定来累計	80 円

#### ■（為替ヘッジなし）隔月分配型

2022年5月	25 円
2022年3月	20 円
2022年1月	15 円
2021年11月	15 円
2021年9月	15 円
直近1年間累計	150 円
設定来累計	150 円





## 運用実績（2022年6月30日現在）

### ■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率（％）			
	(為替ヘッジあり) 年2回決算型	(為替ヘッジなし) 年2回決算型	(為替ヘッジあり) 隔月分配型	(為替ヘッジなし) 隔月分配型
ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	24.9	24.1	24.9	24.0
米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	34.9	35.2	34.9	35.8
米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド	14.9	15.0	14.9	15.2
ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	25.0	24.6	25.0	24.0

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）			
			(為替ヘッジあり) 年2回決算型	(為替ヘッジなし) 年2回決算型	(為替ヘッジあり) 隔月分配型	(為替ヘッジなし) 隔月分配型
1	WHITECAP RESOURCES INC	石油・ガス・消耗燃料	0.4	0.4	0.4	0.4
2	WINTRUST FINANCIAL CORP	銀行	0.4	0.4	0.4	0.4
3	NOW INC/DE	商社・流通業	0.4	0.4	0.4	0.4
4	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	—	0.4	0.4	0.4	0.4
5	DEFINITY FINANCIAL CORP-W/I	保険	0.4	0.3	0.4	0.3

・「米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）			
			(為替ヘッジあり) 年2回決算型	(為替ヘッジなし) 年2回決算型	(為替ヘッジあり) 隔月分配型	(為替ヘッジなし) 隔月分配型
1	CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	社債券	0.7	0.7	0.7	0.7
2	RALPH LAUREN CORP	社債券	0.7	0.7	0.7	0.7
3	STARBUCKS CORP	社債券	0.7	0.7	0.7	0.7
4	ASHTAD CAPITAL INC	社債券	0.6	0.6	0.6	0.6
5	HEALTHPEAK PROPERTIES	社債券	0.6	0.6	0.6	0.6

・「米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）			
			(為替ヘッジあり) 年2回決算型	(為替ヘッジなし) 年2回決算型	(為替ヘッジあり) 隔月分配型	(為替ヘッジなし) 隔月分配型
1	STATE OF QATAR	国債証券	0.6	0.6	0.6	0.6
2	ABU DHABI GOVT INT'L	国債証券	0.5	0.5	0.5	0.5
3	ABU DHABI GOVT INT'L	国債証券	0.4	0.5	0.4	0.5
4	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	社債券	0.4	0.4	0.4	0.4
5	INDONESIA GLOBAL	国債証券	0.4	0.4	0.4	0.4

・「ACI ESGグローバルREIT マザーファンド」を通じての投資銘柄

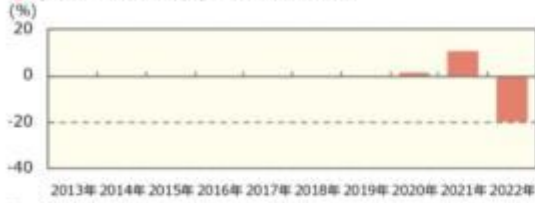
順位	銘柄	種類	投資比率（％）			
			(為替ヘッジあり) 年2回決算型	(為替ヘッジなし) 年2回決算型	(為替ヘッジあり) 隔月分配型	(為替ヘッジなし) 隔月分配型
1	PROLOGIS INC	投資証券	2.1	2.1	2.1	2.0
2	PUBLIC STORAGE	投資証券	1.2	1.2	1.2	1.2
3	EQUINIX INC	投資証券	1.1	1.1	1.1	1.1
4	WELLTOWER INC	投資証券	1.0	1.0	1.0	1.0
5	AGREE REALTY CORP	投資証券	0.8	0.8	0.8	0.8



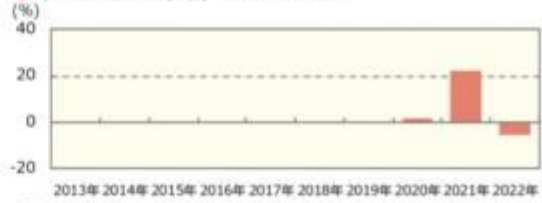
## 運用実績（2022年6月30日現在）

### ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

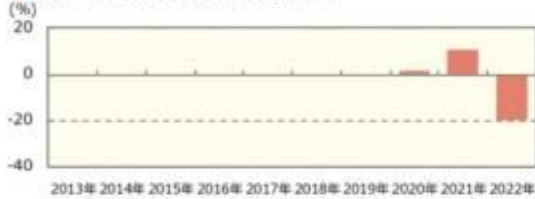
#### ■（為替ヘッジあり）年2回決算型



#### ■（為替ヘッジなし）年2回決算型



#### ■（為替ヘッジあり）隔月分配型



#### ■（為替ヘッジなし）隔月分配型



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2020年は設定日（2020年11月30日）から年末までの収益率。

- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2022年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

## 第3【ファンドの経理状況】

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

(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)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2021年11月19日から2022年5月18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。

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

(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)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)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ヶ月未満であるため、財務諸表は原則として6ヶ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、当期(2021年11月19日から2022年5月18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

グローバルE S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	第2期 (2021年11月18日現在)	第3期 (2022年 5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	312,967,410	169,589,170
親投資信託受益証券	9,193,686,710	8,430,399,731
派生商品評価勘定	47,463,216	10,872,953
未収入金	6,486,907	77,929,402
流動資産合計	9,560,604,243	8,688,791,256
資産合計	9,560,604,243	8,688,791,256
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	57,383,592
未払金	87,548,805	9,147,293
未払収益分配金	8,245,526	-
未払解約金	82,555,229	21,531,550
未払受託者報酬	2,239,354	2,493,079
未払委託者報酬	67,180,622	74,792,152
未払利息	272	60
その他未払費用	134,295	149,525
流動負債合計	247,904,103	165,497,251
負債合計	247,904,103	165,497,251

	第2期 (2021年11月18日現在)	第3期 (2022年 5月18日現在)
純資産の部		
元本等		
元本	8,245,526,555	8,985,318,517
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,067,173,585	462,024,512
（分配準備積立金）	650,214,430	648,826,570
元本等合計	9,312,700,140	8,523,294,005
純資産合計	9,312,700,140	8,523,294,005
負債純資産合計	9,560,604,243	8,688,791,256

## ( 2 ) 損益及び剰余金計算書

( 単位：円 )

	第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	980,428,144	471,186,979
為替差損益	312,234,162	1,036,273,556
営業収益合計	668,193,982	1,507,460,535
営業費用		
支払利息	28,539	16,467
受託者報酬	2,239,354	2,493,079
委託者報酬	67,180,622	74,792,152
その他費用	134,295	155,465
営業費用合計	69,582,810	77,457,163
営業利益又は営業損失（ ）	598,611,172	1,584,917,698
経常利益又は経常損失（ ）	598,611,172	1,584,917,698
当期純利益又は当期純損失（ ）	598,611,172	1,584,917,698
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（ ）	56,678,912	37,270,535
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	290,116,345	1,067,173,585
剰余金増加額又は欠損金減少額	314,671,079	95,832,549
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	314,671,079	95,832,549
剰余金減少額又は欠損金増加額	71,300,573	77,383,483
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	71,300,573	77,383,483
分配金	8,245,526	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,067,173,585	462,024,512

## ( 3 ) 注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年11月19日から2022年 5月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2021年11月18日現在	第3期 2022年 5月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 <div style="text-align: right;">8,245,526,555口</div>	1. 計算期間の末日における受益権の総数 <div style="text-align: right;">8,985,318,517口</div> 2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 <div style="text-align: right;">元本の欠損 462,024,512円</div> 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 <div style="text-align: right;">1口当たり純資産額 0.9486円</div> <div style="text-align: right;">(10,000口当たり純資産額) (9,486円)</div>
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 <div style="text-align: right;">1口当たり純資産額 1.1294円</div> <div style="text-align: right;">(10,000口当たり純資産額) (11,294円)</div>	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 <div style="text-align: right;">1口当たり純資産額 0.9486円</div> <div style="text-align: right;">(10,000口当たり純資産額) (9,486円)</div>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
1.運用の外部委託費用	1.運用の外部委託費用

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用

なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

支払金額 47,795,709円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 30,658,144円

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。

また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

支払金額 41,324,964円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 6,922,413円

## 2. 分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	84,948,170円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	456,984,090円
収益調整金額	C	416,959,155円
分配準備積立金額	D	116,527,696円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,075,419,111円
当ファンドの期末残存口数	F	8,245,526,555口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,304円
10,000口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	8,245,526円

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用

なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

支払金額 75,094,531円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 48,790,592円

当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。

また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。

米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

支払金額 65,069,743円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 10,931,583円

## 2. 分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	42,332,097円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	198,365,141円
分配準備積立金額	D	606,494,473円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	847,191,711円
当ファンドの期末残存口数	F	8,985,318,517口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	942円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

## (金融商品に関する注記)

### (1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。	1.金融商品に対する取組方針 同左

<p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>
---	--

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2021年11月18日現在	第3期 2022年 5月18日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、(その他の注記)の3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

## 1 元本の移動

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日		
期首元本額	6,150,652,736円	期首元本額	8,245,526,555円
期中追加設定元本額	3,373,092,421円	期中追加設定元本額	1,363,512,843円
期中一部解約元本額	1,278,218,602円	期中一部解約元本額	623,720,881円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	927,379,466	439,475,262
合計	927,379,466	439,475,262

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第2期(2021年11月18日現在)				第3期(2022年 5月18日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年 超				うち1年 超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	8,720,012,564	-	8,672,549,348	47,463,216	7,927,151,713	-	7,973,662,352	46,510,639
米ドル	7,657,088,187	-	7,615,876,648	41,211,539	6,919,766,842	-	6,974,894,631	55,127,789
カナダドル	232,002,387	-	229,731,892	2,270,495	261,179,743	-	262,059,628	879,885
メキシコペソ	-	-	-	-	9,847,613	-	10,178,666	331,053



ユーロ	226,057,523	-	224,784,577	1,272,946	211,750,923	-	209,495,618	2,255,305
英ポンド	193,024,696	-	192,814,009	210,687	129,597,299	-	127,826,311	1,770,988
スイスフラン	35,429,509	-	35,317,129	112,380	26,293,290	-	25,536,898	756,392
スウェーデンクローナ	86,177,702	-	86,073,207	104,495	29,431,306	-	28,600,850	830,456
ノルウェークローネ	14,820,176	-	14,732,827	87,349	43,912,305	-	41,263,360	2,648,945
デンマーククローネ	21,582,536	-	21,460,494	122,042	260,558	-	256,929	3,629
豪ドル	181,490,207	-	179,803,376	1,686,831	181,246,323	-	179,451,406	1,794,917
香港ドル	41,464,328	-	41,235,767	228,561	38,946,601	-	39,217,401	270,800
シンガポールドル	30,875,313	-	30,719,422	155,891	74,918,910	-	74,880,654	38,256
合計	8,720,012,564	-	8,672,549,348	47,463,216	7,927,151,713	-	7,973,662,352	46,510,639

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年5月18日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	A C I E S G グローバル小型株マザーファンド	1,790,140,679	2,124,359,943	
		A C I E S G グローバル R E I T マザーファンド	1,413,441,498	2,072,246,580	
		米ドル建て E S G 先進国社債 マザーファンド	2,785,414,975	2,963,681,533	

		米ドル建てESG新興国債マ ザーファンド	1,163,532,132	1,270,111,675	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：98.9%	7,152,529,284	8,430,399,731	100.0%
	合計			8,430,399,731	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

#### （1）貸借対照表

（単位：円）

	第2期 (2021年11月18日現在)	第3期 (2022年5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,500,517,293	1,603,078,623
親投資信託受益証券	61,938,437,506	74,839,604,392
流動資産合計	63,438,954,799	76,442,683,015
資産合計	63,438,954,799	76,442,683,015
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	50,742,275	65,313,099
未払解約金	421,228,891	57,084,458
未払受託者報酬	11,770,767	19,927,502
未払委託者報酬	353,122,847	597,825,044
未払利息	1,306	571
その他未払費用	706,184	1,195,596
流動負債合計	837,572,270	741,346,270
負債合計	837,572,270	741,346,270
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	50,742,275,869	65,313,099,847
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,859,106,660	10,388,236,898
（分配準備積立金）	5,058,845,760	4,889,412,177
元本等合計	62,601,382,529	75,701,336,745
純資産合計	62,601,382,529	75,701,336,745
負債純資産合計	63,438,954,799	76,442,683,015

#### （2）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第2期 自 2021年5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年5月18日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	5,142,469,427	3,649,833,114
営業収益合計	5,142,469,427	3,649,833,114
<b>営業費用</b>		
支払利息	127,448	91,526

	第2期		第3期	
	自	2021年 5月19日 至 2021年11月18日	自	2021年11月19日 至 2022年 5月18日
受託者報酬		11,770,767		19,927,502
委託者報酬		353,122,847		597,825,044
その他費用		706,184		1,195,596
営業費用合計		365,727,246		619,039,668
営業利益又は営業損失( )		4,776,742,181		4,268,872,782
経常利益又は経常損失( )		4,776,742,181		4,268,872,782
当期純利益又は当期純損失( )		4,776,742,181		4,268,872,782
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( )		330,190,056		120,510,437
期首剰余金又は期首欠損金( )		2,030,519,435		11,859,106,660
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,220,053,861		4,092,595,745
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,220,053,861		4,092,595,745
剰余金減少額又は欠損金増加額		787,276,486		1,349,790,063
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		787,276,486		1,349,790,063
分配金		50,742,275		65,313,099
期末剰余金又は期末欠損金( )		11,859,106,660		10,388,236,898

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年11月19日から2022年 5月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

第2期 2021年11月18日現在		第3期 2022年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	50,742,275,869口	1. 計算期間の末日における受益権の総数	65,313,099,847口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額		2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.2337円	1口当たり純資産額	1.1591円
(10,000口当たり純資産額)	(12,337円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,591円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日																																																												
<p>1.運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 47,795,709円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 30,658,144円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 41,324,964円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 6,922,413円</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>482,380,580円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>3,964,171,545円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>6,800,260,900円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>663,035,910円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>11,909,848,935円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>50,742,275,869口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,347円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>50,742,275円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	482,380,580円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,964,171,545円	収益調整金額	C	6,800,260,900円	分配準備積立金額	D	663,035,910円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,909,848,935円	当ファンドの期末残存口数	F	50,742,275,869口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,347円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	50,742,275円	<p>1.運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 75,094,531円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 48,790,592円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 65,069,743円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 10,931,583円</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>353,982,762円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>5,498,824,721円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,600,742,514円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>10,453,549,997円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>65,313,099,847口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,600円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>10円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>65,313,099円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	353,982,762円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	5,498,824,721円	分配準備積立金額	D	4,600,742,514円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,453,549,997円	当ファンドの期末残存口数	F	65,313,099,847口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,600円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	65,313,099円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	482,380,580円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,964,171,545円																																																											
収益調整金額	C	6,800,260,900円																																																											
分配準備積立金額	D	663,035,910円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,909,848,935円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	50,742,275,869口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,347円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	50,742,275円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	353,982,762円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	5,498,824,721円																																																											
分配準備積立金額	D	4,600,742,514円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,453,549,997円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	65,313,099,847口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,600円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	65,313,099円																																																											

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
1.金融商品に対する取組方針	1.金融商品に対する取組方針

<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p> <p>2.金融商品の内容及びその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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>
---	--

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2021年11月18日現在	第3期 2022年 5月18日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

## 1 元本の移動

第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日		
期首元本額	19,668,107,610円	期首元本額	50,742,275,869円
期中追加設定元本額	37,289,795,224円	期中追加設定元本額	20,588,899,595円
期中一部解約元本額	6,215,626,965円	期中一部解約元本額	6,018,075,617円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第2期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	第3期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,071,789,063	3,692,106,025
合計	5,071,789,063	3,692,106,025

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年5月18日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

親投資信託受益証券	日本円	ACI ESGグローバル小型株マザーファンド	15,653,511,037	18,576,021,547	
		ACI ESGグローバルREITマザーファンド	12,553,585,382	18,404,811,528	
		米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	24,903,180,216	26,496,983,749	
		米ドル建てESG新興国国債マザーファンド	10,408,379,964	11,361,787,568	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：98.9%	63,518,656,599	74,839,604,392	100.0%
合計				74,839,604,392	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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。

## グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

### （1）貸借対照表

（単位：円）

	前期 (2021年11月18日現在)	当期 (2022年 5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,669,399	9,520,966
親投資信託受益証券	855,991,442	803,444,190
派生商品評価勘定	4,377,991	1,033,431
未収入金	761,689	5,288,004
流動資産合計	878,800,521	819,286,591
資産合計	878,800,521	819,286,591
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,405,089
未払金	8,332,214	876,180
未払収益分配金	769,607	-
未払解約金	1,771,740	-
未払受託者報酬	75,813	77,880
未払委託者報酬	2,274,347	2,336,411
未払利息	15	3
その他未払費用	4,528	4,654
流動負債合計	13,228,264	8,700,217
負債合計	13,228,264	8,700,217
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	769,607,332	859,277,846
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	95,964,925	48,691,472
（分配準備積立金）	63,613,205	64,604,807
元本等合計	865,572,257	810,586,374
純資産合計	865,572,257	810,586,374
負債純資産合計	878,800,521	819,286,591

## ( 2 ) 損益及び剰余金計算書

( 単位：円 )

	前期		当期	
	自 至	2021年 5月19日 2021年11月18日	自 至	2021年11月19日 2022年 5月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		98,966,980		43,727,252
為替差損益		31,180,495		98,891,217
営業収益合計		67,786,485		142,618,469
営業費用				
支払利息		2,439		1,266
受託者報酬		228,959		238,027
委託者報酬		6,868,634		7,140,817
その他費用		13,674		20,162
営業費用合計		7,113,706		7,400,272
営業利益又は営業損失 ( )		60,672,779		150,018,741
経常利益又は経常損失 ( )		60,672,779		150,018,741
当期純利益又は当期純損失 ( )		60,672,779		150,018,741
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 ( )		1,975,747		585,766
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		30,888,455		95,964,925
剰余金増加額又は欠損金減少額		20,911,732		7,864,362
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		20,911,732		7,864,362
剰余金減少額又は欠損金増加額		11,868,441		1,833,857
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		11,868,441		1,833,857
分配金		2,663,853		1,253,927
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		95,964,925		48,691,472

## ( 3 ) 注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2021年11月19日から2022年 5月18日までとなっております。

( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

該当事項はありません。

( 貸借対照表に関する注記 )



前期 2021年11月18日現在	当期 2022年 5月18日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 769,607,332口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 859,277,846口
2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1247円 (10,000口当たり純資産額) (11,247円)	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 48,691,472円 3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.9433円 (10,000口当たり純資産額) (9,433円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日																		
<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 47,795,709円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 30,658,144円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 41,324,964円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 6,922,413円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2021年 5月19日から2021年 7月19日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,056,645円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>22,828,471円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,056,645円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	22,828,471円	<p>1. 運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 75,094,531円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 48,790,592円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 65,069,743円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 10,931,583円</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2021年11月19日から2022年 1月18日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,345,239円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,345,239円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	3,056,645円																	
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	22,828,471円																	
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	1,345,239円																	
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																	

収益調整金額	C	20,564,987円
分配準備積立金額	D	14,009,136円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,459,239円
当ファンドの期末残存口数	F	727,522,068口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	831円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,091,283円

2021年 7月20日から2021年 9月21日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,611,903円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	7,717,135円
収益調整金額	C	28,602,463円
分配準備積立金額	D	38,221,512円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	77,153,013円
当ファンドの期末残存口数	F	802,963,496口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	960円
10,000口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	802,963円

2021年 9月22日から2021年11月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,813,785円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	19,669,093円
収益調整金額	C	32,351,720円
分配準備積立金額	D	41,899,934円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	96,734,532円
当ファンドの期末残存口数	F	769,607,332口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,256円
10,000口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	769,607円

収益調整金額	C	20,693,095円
分配準備積立金額	D	62,866,654円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	84,904,988円
当ファンドの期末残存口数	F	832,250,781口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,020円
10,000口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	832,250円

2022年 1月19日から2022年 3月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	946,046円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	22,266,359円
分配準備積立金額	D	62,968,745円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	86,181,150円
当ファンドの期末残存口数	F	843,355,889口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,021円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	421,677円

2022年 3月19日から2022年 5月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,762,786円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	24,595,825円
分配準備積立金額	D	62,842,021円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	89,200,632円
当ファンドの期末残存口数	F	859,277,846口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,038円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。	1.金融商品に対する取組方針 同左

<p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>
--	--

## (2)金融商品の時価等に関する事項

<p>前期</p> <p>2021年11月18日現在</p>	<p>当期</p> <p>2022年 5月18日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、(その他の注記)の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

## 1 元本の移動

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
期首元本額 677,112,685円	期首元本額 769,607,332円
期中追加設定元本額 231,324,502円	期中追加設定元本額 114,318,429円
期中一部解約元本額 138,829,855円	期中一部解約元本額 24,647,915円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	54,275,094	2,105,037
合計	54,275,094	2,105,037

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	前期(2021年11月18日現在)				当期(2022年 5月18日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	805,913,516	-	801,535,525	4,377,991	750,847,776	-	755,219,434	4,371,658
米ドル	707,942,718	-	704,140,147	3,802,571	654,513,105	-	659,694,721	5,181,616
カナダドル	21,207,468	-	20,999,920	207,548	24,768,780	-	24,852,223	83,443
メキシコペソ	-	-	-	-	927,719	-	958,906	31,187

ユーロ	20,810,819	-	20,693,632	117,187	20,146,364	-	19,938,954	207,410
英ポンド	17,884,077	-	17,864,556	19,521	12,600,723	-	12,443,267	157,456
スイスフラン	3,086,194	-	3,076,405	9,789	2,414,689	-	2,345,225	69,464
スウェーデンクローナ	7,937,589	-	7,927,965	9,624	2,788,934	-	2,710,240	78,694
ノルウェークローネ	1,337,750	-	1,329,865	7,885	4,194,352	-	3,941,334	253,018
デンマーククローネ	1,976,358	-	1,965,183	11,175	18,611	-	18,352	259
豪ドル	16,734,920	-	16,579,380	155,540	17,561,801	-	17,380,940	180,861
香港ドル	3,950,387	-	3,928,612	21,775	3,813,151	-	3,839,350	26,199
シンガポールドル	3,045,236	-	3,029,860	15,376	7,099,547	-	7,095,922	3,625
合計	805,913,516	-	801,535,525	4,377,991	750,847,776	-	755,219,434	4,371,658

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年5月18日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	ACI ESGグローバル小型株マザーファンド	172,268,840	204,431,432	
		ACI ESGグローバルREITマザーファンド	137,484,222	201,565,617	
		米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	261,128,102	277,840,300	

		米ドル建てESG新興国債マ ザーファンド	109,570,210	119,606,841	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.1%	680,451,374	803,444,190	100.0%
	合計			803,444,190	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

#### （1）貸借対照表

（単位：円）

	前期 (2021年11月18日現在)	当期 (2022年 5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	93,249,088	80,308,756
親投資信託受益証券	3,975,392,184	4,486,696,920
流動資産合計	4,068,641,272	4,567,005,676
資産合計	4,068,641,272	4,567,005,676
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,904,942	9,868,517
未払解約金	32,617,387	1,861,129
未払受託者報酬	331,989	432,418
未払委託者報酬	9,959,575	12,972,547
未払利息	81	28
その他未払費用	19,898	25,926
流動負債合計	47,833,872	25,160,565
負債合計	47,833,872	25,160,565
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,269,961,496	3,947,407,171
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	750,845,904	594,437,940
（分配準備積立金）	362,297,178	321,992,657
元本等合計	4,020,807,400	4,541,845,111
純資産合計	4,020,807,400	4,541,845,111
負債純資産合計	4,068,641,272	4,567,005,676

#### （2）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	360,531,078	219,365,264
営業収益合計	360,531,078	219,365,264
<b>営業費用</b>		
支払利息	7,446	5,032

	前期	当期
	自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
受託者報酬	828,420	1,206,992
委託者報酬	24,852,347	36,209,770
その他費用	49,645	72,361
営業費用合計	25,737,858	37,494,155
営業利益又は営業損失( )	334,793,220	256,859,419
経常利益又は経常損失( )	334,793,220	256,859,419
当期純利益又は当期純損失( )	334,793,220	256,859,419
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( )	16,081,897	4,914,551
期首剰余金又は期首欠損金( )	150,872,616	750,845,904
剰余金増加額又は欠損金減少額	351,456,564	209,010,179
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	351,456,564	209,010,179
剰余金減少額又は欠損金増加額	56,241,399	80,525,878
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	56,241,399	80,525,878
分配金	13,953,200	23,118,295
期末剰余金又は期末欠損金( )	750,845,904	594,437,940

## (3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当該財務諸表の特定期間は、2021年11月19日から2022年 5月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

前期 2021年11月18日現在	当期 2022年 5月18日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,269,961,496口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,947,407,171口
2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2296円 (10,000口当たり純資産額) (12,296円)	2. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1506円 (10,000口当たり純資産額) (11,506円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日																																																																																																
<p>1.運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 47,795,709円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 30,658,144円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 41,324,964円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 6,922,413円</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <p>2021年 5月19日から2021年 7月19日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>8,977,844円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>53,626,562円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>203,890,805円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>72,078,330円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>338,573,541円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,333,802,447口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,450円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>20円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>4,667,604円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2021年 7月20日から2021年 9月21日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>8,858,505円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>14,655,257円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>303,118,030円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>124,986,378円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>451,618,170円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,977,844円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	53,626,562円	収益調整金額	C	203,890,805円	分配準備積立金額	D	72,078,330円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	338,573,541円	当ファンドの期末残存口数	F	2,333,802,447口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,450円	10,000口当たり分配金額	H	20円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	4,667,604円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,858,505円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,655,257円	収益調整金額	C	303,118,030円	分配準備積立金額	D	124,986,378円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	451,618,170円	<p>1.運用の外部委託費用</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用</p> <p>なお、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド 支払金額 75,094,531円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 48,790,592円</p> <p>当ファンドの主要投資対象である下記マザーファンドにおいて、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託する為に要する費用として、個別契約により当社は運用会社であるNOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED(ノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッド)に対し総額で以下の金額を支払っております。なお、信託財産からの直接的な支弁は行っておりません。</p> <p>また、以下の金額は当該マザーファンドを投資対象とする全てのベビーファンドの合計額となっております。</p> <p>米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド 支払金額 65,069,743円</p> <p>米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド 支払金額 10,931,583円</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <p>2021年11月19日から2022年 1月18日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>6,448,941円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>324,238,598円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>344,632,066円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>675,319,605円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,626,704,947口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,862円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>15円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>5,440,057円</td> </tr> </tbody> </table> <p>2022年 1月19日から2022年 3月18日まで</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>4,953,490円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>338,779,966円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>341,316,804円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>685,050,260円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	6,448,941円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	324,238,598円	分配準備積立金額	D	344,632,066円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	675,319,605円	当ファンドの期末残存口数	F	3,626,704,947口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,862円	10,000口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,440,057円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	4,953,490円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	338,779,966円	分配準備積立金額	D	341,316,804円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	685,050,260円
項目																																																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	8,977,844円																																																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	53,626,562円																																																																																															
収益調整金額	C	203,890,805円																																																																																															
分配準備積立金額	D	72,078,330円																																																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	338,573,541円																																																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	2,333,802,447口																																																																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,450円																																																																																															
10,000口当たり分配金額	H	20円																																																																																															
収益分配金金額	I=F×H/10,000	4,667,604円																																																																																															
項目																																																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	8,858,505円																																																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,655,257円																																																																																															
収益調整金額	C	303,118,030円																																																																																															
分配準備積立金額	D	124,986,378円																																																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	451,618,170円																																																																																															
項目																																																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	6,448,941円																																																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																																															
収益調整金額	C	324,238,598円																																																																																															
分配準備積立金額	D	344,632,066円																																																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	675,319,605円																																																																																															
当ファンドの期末残存口数	F	3,626,704,947口																																																																																															
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,862円																																																																																															
10,000口当たり分配金額	H	15円																																																																																															
収益分配金金額	I=F×H/10,000	5,440,057円																																																																																															
項目																																																																																																	
費用控除後の配当等収益額	A	4,953,490円																																																																																															
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																																																															
収益調整金額	C	338,779,966円																																																																																															
分配準備積立金額	D	341,316,804円																																																																																															
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	685,050,260円																																																																																															



当ファンドの期末残存口数	F	2,920,436,509口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,546円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	4,380,654円

2021年 9月22日から2021年11月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	13,534,816円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	219,058,339円
収益調整金額	C	388,548,726円
分配準備積立金額	D	134,608,965円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	755,750,846円
当ファンドの期末残存口数	F	3,269,961,496口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,311円
10,000口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	4,904,942円

当ファンドの期末残存口数	F	3,904,860,874口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,754円
10,000口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	7,809,721円

2022年 3月19日から2022年 5月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,955,030円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	363,655,275円
分配準備積立金額	D	321,906,144円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	695,516,449円
当ファンドの期末残存口数	F	3,947,407,171口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,761円
10,000口当たり分配金額	H	25円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	9,868,517円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>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。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

<p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

## (2)金融商品の時価等に関する事項

前期 2021年11月18日現在	当期 2022年 5月18日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
期首元本額	1,459,825,747円
	期首元本額
	3,269,961,496円

期中追加設定元本額	2,197,011,543円	期中追加設定元本額	1,106,753,860円
期中一部解約元本額	386,875,794円	期中一部解約元本額	429,308,185円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2021年 5月19日 至 2021年11月18日	当期 自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
	損益に含まれた評価差額(円)	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	248,516,416	15,458,666
合計	248,516,416	15,458,666

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年5月18日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	A C I E S Gグローバル小型株マザーファンド	930,387,606	1,104,090,972	
		A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド	726,516,933	1,065,146,475	
		米ドル建てE S G先進国社債 マザーファンド	1,527,513,460	1,625,274,321	
		米ドル建てE S G新興国国債 マザーファンド	634,101,459	692,185,152	
	小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 98.8%	3,818,519,458	4,486,696,920 100.0%	
合計				4,486,696,920	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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）

「グローバルESGバランスファンド」の各ファンドは「ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド」、「米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド」、「米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド」および「ACI ESGグローバルREIT 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。

## ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
(2022年 5月18日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	480,948,821
コール・ローン	331,374,905
株式	19,752,213,601
投資信託受益証券	9,234,177
投資証券	1,392,900,910
派生商品評価勘定	287,105
未収入金	122,627,908
未収配当金	23,499,230
流動資産合計	22,113,086,657
資産合計	22,113,086,657
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,226
未払金	101,670,621
未払解約金	2,680,000
未払利息	118
流動負債合計	104,352,965
負債合計	104,352,965
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	18,546,308,162
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,462,425,530
元本等合計	22,008,733,692
純資産合計	22,008,733,692
負債純資産合計	22,113,086,657

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p>
-------------------	--

	<p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1867円
(10,000口当たり純資産額)	(11,867円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p>
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

#### 市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

#### 信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

#### 流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 5月18日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ

ん。

### 2.時価の算定方法

#### 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### 投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目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。

### （その他の注記）

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 5月18日現在

期首	2021年11月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	13,000,044,407円
同期中における追加設定元本額	6,395,609,910円
同期中における一部解約元本額	849,346,155円
期末元本額	18,546,308,162円
期末元本額の内訳*	
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型	1,790,140,679円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型	15,653,511,037円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型	172,268,840円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2022年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	ウエストホールディングス	44,700	4,675.00	208,972,500	
		日本電子	32,700	6,260.00	204,702,000	
		アシックス	54,100	2,301.00	124,484,100	
		ネクステージ	59,800	1,957.00	117,028,600	
		日本瓦斯	112,300	1,871.00	210,113,300	
		オープンハウスグループ	15,600	4,935.00	76,986,000	
		小計	銘柄数：6 組入時価比率：4.3%			942,286,500 4.8%
	米ドル	ELEMENT SOLUTIONS INC	69,360	20.80	1,442,688.00	
		EAGLE MATERIALS INC	10,182	127.33	1,296,474.06	
		SUMMIT MATERIALS INC -CL A	47,810	26.80	1,281,308.00	
		GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO	19,915	21.49	427,973.35	
		ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	53,221	26.96	1,434,838.16	
		COMMERCIAL METALS CO	45,254	38.52	1,743,184.08	
		CONSTELLIUM SE	65,717	16.81	1,104,702.77	
		SSR MINING INC	76,739	19.56	1,501,014.84	
		BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,146	68.36	420,140.56	
		SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,436	46.06	434,622.16	
		EVOQUA WATER TECHNOLOGIES CO	36,167	36.35	1,314,670.45	
		JOHN BEAN TECHNOLOGIES CORP	8,179	119.54	977,717.66	
		KORNIT DIGITAL LTD	2,396	46.38	111,126.48	
LINDSAY CORP	11,135	128.14	1,426,838.90			
MUELLER WATER PRODUCTS INC-A	75,651	11.79	891,925.29			
H&E EQUIPMENT SERVICES INC	37,720	35.37	1,334,156.40			
MRC GLOBAL INC	137,573	10.38	1,428,007.74			
NOW INC/DE	247,006	10.82	2,672,604.92			

CLEAN HARBORS INC	22,231	91.39	2,031,691.09
DRIVEN BRANDS HOLDINGS INC	54,660	27.30	1,492,218.00
SP PLUS CORP	18,281	31.38	573,657.78
LOVESAC CO/THE	4,698	37.60	176,644.80
CAPRI HOLDINGS LTD	3,470	45.09	156,462.30
CROCS INC	2,500	57.22	143,050.00
BLOOMIN BRANDS INC	42,313	21.47	908,460.11
SEAWORLD ENTERTAINMENT INC	35,096	57.56	2,020,125.76
TRAVEL + LEISURE CO	34,901	51.10	1,783,441.10
WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	26,778	78.50	2,102,073.00
REVOLVE GROUP INC	12,932	29.23	378,002.36
OLLIE S BARGAIN OUTLET HOLDI	18,213	45.81	834,337.53
ARKO CORP	94,743	8.61	815,737.23
PETCO HEALTH AND WELLNESS CO	42,540	19.22	817,618.80
BJ'S WHOLESALE CLUB HOLDINGS	28,464	63.81	1,816,287.84
PRICESMART INC	13,979	79.64	1,113,287.56
US FOODS HOLDING CORP	44,516	34.78	1,548,266.48
DUCKHORN PORTFOLIO INC/THE	34,275	20.14	690,298.50
MGP INGREDIENTS INC	17,875	98.85	1,766,943.75
HOSTESS BRANDS INC	35,638	22.34	796,152.92
SOVOS BRANDS INC	102,314	14.44	1,477,414.16
ELF BEAUTY INC	47,253	23.70	1,119,896.10
INMODE LTD	6,496	23.77	154,409.92
SI-BONE INC	10,254	13.89	142,428.06
SILK ROAD MEDICAL INC	12,813	30.16	386,440.08
ENSIGN GROUP INC/THE	12,963	81.54	1,057,003.02
PROGYNY INC	31,393	37.79	1,186,341.47
R1 RCM INC	80,387	22.59	1,815,942.33
RADNET INC	41,649	19.32	804,658.68
TENET HEALTHCARE CORP	16,301	73.76	1,202,361.76
NATERA INC	6,805	36.67	249,539.35
HARMONY BIOSCIENCES HOLDINGS	32,347	41.90	1,355,339.30
BANCORP INC/THE	40,788	19.35	789,247.80
GLACIER BANCORP INC	40,429	46.44	1,877,522.76
TRIUMPH BANCORP INC	11,942	69.91	834,865.22



	VERITEX HOLDINGS INC	31,607	33.67	1,064,207.69	
	WINTRUST FINANCIAL CORP	31,858	85.64	2,728,319.12	
	KINSALE CAPITAL GROUP INC	7,562	210.85	1,594,447.70	
	RLI CORP	12,272	119.69	1,468,835.68	
	SELECTIVE INSURANCE GROUP	20,750	77.82	1,614,765.00	
	PERFICIENT INC	11,287	98.30	1,109,512.10	
	SWITCH INC - A	29,478	33.55	988,986.90	
	WNS HOLDINGS LTD-ADR	22,208	71.50	1,587,872.00	
	MANHATTAN ASSOCIATES, INC.	8,752	120.78	1,057,066.56	
	PAYCOR HCM INC	63,262	23.10	1,461,352.20	
	SPROUT SOCIAL INC - CLASS A	11,455	44.07	504,821.85	
	SPS COMMERCE INC	8,871	104.31	925,334.01	
	TENABLE HOLDINGS INC	45,268	44.78	2,027,101.04	
	PURE STORAGE INC - CLASS A	32,877	26.29	864,336.33	
	NATIONAL INSTRUMENTS CORP	41,112	33.86	1,392,052.32	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	16,182	50.98	824,958.36	
	NOVA LTD	13,051	102.48	1,337,466.48	
	ONTO INNOVATION INC	11,446	78.00	892,788.00	
	POWER INTEGRATIONS INC	16,693	86.15	1,438,101.95	
	EUROPEAN WAX CENTER INC-A	33,347	25.74	858,351.78	
	OPTIMIZERX CORP	12,332	27.20	335,430.40	
	CODEXIS INC	36,585	10.75	393,288.75	
	FIRST ADVANTAGE CORP	47,393	15.55	736,961.15	
	STERLING CHECK CORP	34,043	20.00	680,860.00	
	CARGURUS INC	4,307	25.33	109,096.31	
	小計銘柄数：78			85,658,474.42	
				(11,078,210,496)	
	組入時価比率：50.3%			56.2%	
カナダドル	GIBSON ENERGY INC	61,873	25.87	1,600,654.51	
	VERMILION ENERGY INC	99,070	26.41	2,616,438.70	
	WHITECAP RESOURCES INC	404,179	10.57	4,272,172.03	
	CAPSTONE COPPER CORP	423,472	4.98	2,108,890.56	
	LAURENTIAN BANK OF CANADA	37,577	38.48	1,445,962.96	
	DEFINITY FINANCIAL CORP-W/I	92,273	32.20	2,971,190.60	
	KINAXIS INC	8,034	141.62	1,137,775.08	

	STANTEC INC	33,447	56.51	1,890,089.97	
	COLLIERS INTERNATIONAL GROUP	4,491	145.89	655,191.99	
	TRICON RESIDENTIAL INC	213,841	16.68	3,566,867.88	
小計	銘柄数：10			22,265,234.28	
				(2,249,901,923)	
	組入時価比率：10.2%			11.4%	
メキシコペソ	QUALITAS CONTROLADORA SAB CV	158,377	104.36	16,528,223.72	
小計	銘柄数：1			16,528,223.72	
				(107,264,866)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
リアル	SANTOS BRASIL PARTICIPACOES	749,600	7.88	5,906,848.00	
	SLC AGRICOLA SA	94,200	55.22	5,201,724.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	525,700	25.65	13,484,205.00	
小計	銘柄数：3			24,592,777.00	
				(643,846,279)	
	組入時価比率：2.9%			3.3%	
ユーロ	K+S AG-REG	53,574	29.54	1,582,575.96	
	NEXANS SA	21,696	80.45	1,745,443.20	
	METSO OUTOTEC OYJ	115,893	7.96	923,203.63	
	SPIE SA	45,644	22.20	1,013,296.80	
	CIE AUTOMOTIVE SA	16,335	21.38	349,242.30	
	AUTOGRILL SPA	235,492	7.07	1,664,928.44	
	BASIC-FIT NV	28,374	37.90	1,075,374.60	
	D'IETEREN GROUP	13,731	156.90	2,154,393.90	
	BANCO DE SABADELL SA	1,064,605	0.73	783,336.35	
	ASR NEDERLAND NV	40,662	44.74	1,819,217.88	
	ACCIONA S.A.	8,482	181.90	1,542,875.80	
小計	銘柄数：11			14,653,888.86	
				(2,001,135,062)	
	組入時価比率：9.1%			10.1%	
英ポンド	RS GROUP PLC	123,122	9.17	1,129,028.74	
小計	銘柄数：1			1,129,028.74	
				(182,496,205)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
スイスフラン	SIG GROUP AG	58,618	20.02	1,173,532.36	
	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	1,899	631.50	1,199,218.50	

小計	銘柄数：2			2,372,750.86 (309,121,982) 1.6%	
スウェーデン ローナ	HOLMEN AB-B SHARES	20,330	538.00	10,937,540.00	
	LINDAB INTERNATIONAL AB	38,515	192.00	7,394,880.00	
	FORTNOX AB	158,883	47.83	7,600,168.30	
小計	銘柄数：3			25,932,588.30 (337,901,625) 1.7%	
ノルウェー ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	498,137	31.72	15,800,905.64	
	BAKKAFROST P/F	13,239	594.00	7,863,966.00	
	STOREBRAND ASA	160,365	81.64	13,092,198.60	
小計	銘柄数：3			36,757,070.24 (492,912,311) 2.5%	
豪ドル	IGO LTD	221,475	10.91	2,416,292.25	
	CORPORATE TRAVEL MANAGEMENT	79,402	21.31	1,692,056.62	
	METCASH LTD	244,758	4.71	1,152,810.18	
	IDP EDUCATION LTD	72,430	22.28	1,613,740.40	
	CARSALES.COM LTD	61,000	19.43	1,185,230.00	
小計	銘柄数：5			8,060,129.45 (733,552,381) 3.7%	
香港ドル	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	623,700	16.06	10,016,622.00	
小計	銘柄数：1			10,016,622.00 (165,073,930) 0.8%	
ウォン	HITE JINRO CO LTD	43,446	36,950.00	1,605,329,700.00	
小計	銘柄数：1			1,605,329,700.00 (163,743,629) 0.8%	
新台湾ドル	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	46,928	863.00	40,498,864.00	
	ASPEED TECHNOLOGY INC	15,000	2,575.00	38,625,000.00	
小計	銘柄数：2			79,123,864.00 (344,766,412)	

	組入時価比率：1.6%		1.7%
合計			19,752,213,601 (18,809,927,101)

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	SCHWAB INTL SMALL-CAP EQUITY	1,128	38,814.48	
		SCHWAB US SMALL-CAP ETF	766	32,585.64	
	小計	銘柄数：2	1,894	71,400.12 (9,234,177)	
		組入時価比率：0.0%		0.7%	
	合計			9,234,177 (9,234,177)	
投資証券	日本円	インヴィンシブル投資法人 投資証券	2,499	108,706,500	
		小計	銘柄数：1	2,499	108,706,500 7.8%
		組入時価比率：0.5%			
	米ドル	DIGITALBRIDGE GROUP INC	268,421	1,656,157.57	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	85,965	1,149,352.05	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	48,177	1,027,615.41	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,122	2,777,850.84	
		小計	銘柄数：4	432,685	6,610,975.87 (854,997,509)
		組入時価比率：3.9%		60.9%	
	カナダドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	57,249	2,876,762.25	
		小計	銘柄数：1	57,249	2,876,762.25 (290,696,825)
		組入時価比率：1.3%		20.7%	
	英ポンド	TRITAX BIG BOX REIT PLC	420,021	856,842.84	
小計		銘柄数：1	420,021	856,842.84 (138,500,076)	
	組入時価比率：0.6%		9.9%		
合計				1,392,900,910	

		(1,284,194,410)	
合計		1,402,135,087	(1,293,428,587)

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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

種類	2022年 5月18日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	111,206,494	-	111,493,599	287,105
米ドル	103,187,680	-	103,460,720	273,040
ユーロ	8,018,814	-	8,032,879	14,065
売建	8,018,814	-	8,021,040	2,226
米ドル	8,018,814	-	8,021,040	2,226
合計	-	-	-	284,879

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

1)計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

米ドル建て ESG 先進国社債 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,393,676,892
コール・ローン	182,759,469
社債券	29,560,920,453
未収利息	277,904,731
前払費用	5,968,140
流動資産合計	31,421,229,685
資産合計	31,421,229,685
負債の部	
流動負債	
未払解約金	57,590,000
未払利息	65
流動負債合計	57,590,065
負債合計	57,590,065
純資産の部	
元本等	
元本	29,477,236,753
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,886,402,867
元本等合計	31,363,639,620
純資産合計	31,363,639,620
負債純資産合計	31,421,229,685

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	社債券 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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0640円
(10,000口当たり純資産額)	(10,640円)

(金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p> <p>2.金融商品の内容及びその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、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 5月18日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 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。</p> <p>2.時価の算定方法 社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 5月18日現在	
期首	2021年11月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	24,464,469,520円
同期中における追加設定元本額	5,810,378,252円
同期中における一部解約元本額	797,611,019円
期末元本額	29,477,236,753円
期末元本額の内訳*	
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	2,785,414,975円

グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型	24,903,180,216円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型	261,128,102円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型	1,527,513,460円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2022年5月18日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	AES CORP/THE	4,200,000.00	3,892,749.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E	3,000,000.00	2,333,445.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E	650,000.00	506,396.15	
		AMAZON.COM INC	2,000,000.00	1,596,735.60	
		AMERICAN ELECTRIC POWER	4,400,000.00	3,765,896.64	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	3,500,000.00	3,198,623.40	
		APPLE INC	1,800,000.00	1,291,610.16	
		ASHTREAD CAPITAL INC	4,600,000.00	4,302,040.52	
		AVANGRID INC	4,000,000.00	3,828,666.80	
		BEST BUY CO INC	3,200,000.00	3,227,616.64	
		BOEING CO	3,250,000.00	3,123,069.62	
		BOSTON PROPERTIES LP	3,500,000.00	2,870,312.90	
		CANADIAN PACIFIC RAILWAY	1,300,000.00	1,119,182.61	
		CANADIAN PACIFIC RAILWAY	2,300,000.00	1,813,364.39	
		CATERPILLAR FINL SERVICE	3,000,000.00	2,997,265.20	
		CATERPILLAR INC	1,000,000.00	825,060.90	
		CENTERPOINT ENERGY INC	3,000,000.00	2,576,123.40	
		CMS ENERGY CORP	3,300,000.00	3,054,760.83	
		CNH INDUSTRIAL CAP LLC	1,500,000.00	1,342,306.05	
		CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	5,000,000.00	4,837,800.50	
		CSX CORP	1,000,000.00	674,063.70	
		DAIMLER FINANCE NA LLC	3,000,000.00	2,745,960.30	
		DAIMLER FINANCE NA LLC	1,800,000.00	1,552,989.96	
		DELL INT LLC / EMC CORP	3,550,000.00	3,780,268.26	
		DOMINION ENERGY INC	1,550,000.00	1,380,475.72	
		DOMINION ENERGY INC	2,950,000.00	2,758,234.36	
		DUKE ENERGY CORP	1,600,000.00	1,287,003.36	
DUKE ENERGY CORP	1,000,000.00	945,802.80			



E.ON INTL FINANCE BV	3,150,000.00	3,533,931.45	
EDP FINANCE BV	3,600,000.00	3,083,743.08	
ELECTRICITE DE FRANCE SA	4,000,000.00	3,890,692.80	
ENEL FINANCE INTL NV	2,500,000.00	2,054,551.50	
ENEL FINANCE INTL NV	5,550,000.00	3,964,890.03	
EVERSOURCE ENERGY	2,700,000.00	2,159,694.63	
EXELON CORP	1,000,000.00	943,129.00	
EXELON CORP	2,000,000.00	1,799,190.80	
EXELON CORP	900,000.00	767,236.59	
FEDERAL REALTY INVESTMEN	1,000,000.00	921,791.30	
FEDEX CORP	1,000,000.00	1,005,934.60	
FEDEX CORP	4,700,000.00	3,907,689.04	
GENERAL MILLS INC	1,600,000.00	1,429,623.36	
GENERAL MOTORS FINL CO	4,500,000.00	3,887,814.60	
HASBRO INC	3,600,000.00	3,391,005.24	
HEALTHPEAK PROPERTIES	1,500,000.00	1,415,935.35	
HEALTHPEAK PROPERTIES	4,800,000.00	4,219,445.28	
HOME DEPOT INC	4,000,000.00	3,900,930.40	
HP ENTERPRISE CO	3,300,000.00	3,398,449.89	
HP INC	1,000,000.00	893,776.40	
HP INC	1,000,000.00	946,200.60	
HP INC	4,700,000.00	4,169,274.12	
INGERSOLL-RAND LUX FINAN	4,000,000.00	3,805,395.60	
INTEL CORP	1,000,000.00	995,230.90	
INTL FLAVOR & FRAGRANCES	4,000,000.00	3,094,541.20	
JABIL INC	4,000,000.00	3,630,574.40	
KEURIG DR PEPPER INC	2,000,000.00	1,656,257.80	
KROGER CO	4,200,000.00	3,416,789.04	
MASSACHUSETTS ELECTRIC	2,500,000.00	2,011,289.00	
MCDONALD'S CORP	4,000,000.00	3,811,652.40	
MICRON TECHNOLOGY INC	2,000,000.00	1,964,901.20	
MOLSON COORS BREWING CO	4,000,000.00	3,336,439.20	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	1,500,000.00	1,408,112.10	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	4,800,000.00	4,068,201.60	
NISSAN MOTOR CO	4,000,000.00	3,852,675.60	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,000,000.00	1,800,414.40	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	4,600,000.00	4,131,939.42	
NXP BV/NXP FUNDING LLC	2,000,000.00	1,462,195.40	
RALPH LAUREN CORP	5,200,000.00	4,707,401.40	
RAYTHEON TECH CORP	4,600,000.00	3,517,818.26	
SCENTRE GROUP TRUST 2	4,400,000.00	4,161,747.48	
SEMPRA ENERGY	2,000,000.00	1,872,988.80	
	2,400,000.00	2,040,602.64	

	SEMPRA ENERGY		
	SIEMENS FINANCIERINGSMAT	1,000,000.00	886,229.60
	SIMON PROPERTY GROUP LP	3,000,000.00	2,494,857.60
	SSE PLC	2,500,000.00	2,511,975.00
	STARBUCKS CORP	5,300,000.00	4,568,076.89
	SYSCO CORPORATION	3,562,000.00	3,870,478.81
	TOTAL CAPITAL INTL SA	3,000,000.00	2,311,236.00
	UDR INC	4,000,000.00	3,515,537.20
	UNITED PARCEL SERVICE	1,000,000.00	1,096,605.30
	VENTAS REALTY LP/CAP CRP	2,600,000.00	2,566,530.98
	VF CORP	3,200,000.00	2,865,925.12
	VOLKSWAGEN GROUP AMERICA	3,600,000.00	3,277,901.16
	VOLKSWAGEN GROUP AMERICA	1,000,000.00	938,963.10
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE	4,000,000.00	3,647,656.00
	WEA FINANCE LLC	1,900,000.00	1,739,674.01
	WEA FINANCE LLC/WESTFIEL	2,900,000.00	2,850,059.97
	WELLTOWER INC	4,000,000.00	3,435,863.20
	WESTINGHOUSE AIR BRAKE	2,000,000.00	1,932,215.40
小計	銘柄数：88	254,812,000.00	228,569,708.91
			(29,560,920,453)
	組入時価比率：94.3%		100.0%
合計			29,560,920,453
			(29,560,920,453)

(注1)外貨建の有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建の有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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。

## 米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(2022年5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	371,818,488
コール・ローン	86,781,178
国債証券	10,141,653,711
特殊債券	1,110,544,753
社債券	1,624,534,789
未収利息	143,640,319
前払費用	12,458,620
流動資産合計	13,491,431,858
資産合計	13,491,431,858

(2022年 5月18日現在)

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,754
未払金	27,831,557
未払解約金	20,190,000
未払利息	30
流動負債合計	48,041,341
負債合計	48,041,341
純資産の部	
元本等	
元本	12,315,583,765
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,127,806,752
元本等合計	13,443,390,517
純資産合計	13,443,390,517
負債純資産合計	13,491,431,858

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券、社債券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0916円
(10,000口当たり純資産額)	(10,916円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年11月19日

至 2022年 5月18日

## 1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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その金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

## 市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

## 信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

## 流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 5月18日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目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。

## （その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 5月18日現在

期首	2021年11月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	10,504,765,459円
同期中における追加設定元本額	2,225,579,957円
同期中における一部解約元本額	414,761,651円
期末元本額	12,315,583,765円

期末元本額の内訳 *	
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型	1,163,532,132円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型	10,408,379,964円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型	109,570,210円
グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型	634,101,459円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2022年5月18日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ABU DHABI GOVT INT'L	3,200,000.00	3,078,195.20	
		ABU DHABI GOVT INT'L	3,820,000.00	3,618,686.00	
		BRAZIL GLOBAL	1,350,000.00	1,542,171.01	
		CHINA GOVT INTL BOND	300,000.00	294,260.58	
		CHINA GOVT INTL BOND	500,000.00	490,276.20	
		CHINA GOVT INTL BOND	400,000.00	377,091.60	
		CHINA GOVT INTL BOND	1,600,000.00	1,370,620.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	400,000.00	342,304.16	
		COLOMBIA GLOBAL	1,690,000.00	1,673,649.25	
		COSTA RICA GOVERNMENT	800,000.00	798,600.00	
		COSTA RICA GOVERNMENT	200,000.00	191,285.54	
		COSTA RICA GOVERNMENT	200,000.00	186,240.48	
		DOMINICAN REPUBLIC	2,200,000.00	2,171,878.28	
		DOMINICAN REPUBLIC	1,000,000.00	845,854.20	
		DOMINICAN REPUBLIC	500,000.00	463,111.80	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,000,000.00	958,250.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	194,451.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,120,000.00	1,976,709.20	
		HUNGARY	580,000.00	597,654.62	
		INDONESIA GLOBAL	2,080,000.00	2,697,838.00	
		INDONESIA GLOBAL	1,150,000.00	1,277,349.96	
		KINGDOM OF BAHRAIN	600,000.00	611,623.20	
		KINGDOM OF BAHRAIN	2,340,000.00	2,462,031.00	
		KINGDOM OF BAHRAIN	200,000.00	203,860.40	
		KINGDOM OF BAHRAIN	800,000.00	807,259.20	
		KINGDOM OF JORDAN	1,000,000.00	863,250.00	

KINGDOM OF MOROCCO	500,000.00	429,670.00	
MEXICO GLOBAL	2,250,000.00	2,506,219.65	
OMAN GOV INTERNTL BOND	2,620,000.00	2,606,376.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	1,800,000.00	1,746,532.80	
OMAN GOV INTERNTL BOND	800,000.00	858,218.40	
PANAMA GLOBAL	1,860,000.00	2,228,810.10	
PANAMA GLOBAL	400,000.00	501,045.36	
PANAMA GLOBAL	1,700,000.00	1,882,555.01	
PERU GLOBAL	1,430,000.00	1,617,051.15	
PHILIPPINES GLOBAL	1,700,000.00	2,231,208.18	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	908,710.16	
REPUBLIC OF ARMENIA	200,000.00	197,320.00	
REPUBLIC OF AZERBAIJAN	350,000.00	301,853.72	
REPUBLIC OF CHILE	2,800,000.00	2,427,488.00	
REPUBLIC OF CHILE	1,540,000.00	1,312,095.40	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,600,000.00	1,450,956.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,600,000.00	2,328,664.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	400,000.00	498,976.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	412,179.92	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	610,734.70	
REPUBLIC OF PANAMA	100,000.00	90,691.00	
REPUBLIC OF PARAGUAY	500,000.00	480,207.65	
REPUBLIC OF PARAGUAY	500,000.00	467,696.70	
REPUBLIC OF PERU	1,420,000.00	1,257,992.20	
REPUBLIC OF PERU	1,300,000.00	1,687,850.58	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	400,000.00	402,739.08	
REPUBLIC OF SERBIA	200,000.00	150,731.60	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,500,000.00	1,433,737.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,635,192.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	154,938.00	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	700,000.00	715,407.00	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	400,000.00	406,940.00	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	880,000.00	1,104,078.62	
ROMANIA	200,000.00	203,775.00	
ROMANIA	1,550,000.00	1,324,940.00	
STATE OF QATAR	3,440,000.00	3,943,065.60	
STATE OF QATAR	1,600,000.00	1,713,760.00	
TRINIDAD & TOBAGO	1,000,000.00	910,219.70	
UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,162,095.60	
UNITED MEXICAN STATES	2,040,000.00	2,019,645.28	
小計	銘柄数：66	77,410,000.00	78,416,869.34 (10,141,653,711)

		組入時価比率：75.4%		78.8%
合計				10,141,653,711 (10,141,653,711)
特殊債券	米ドル	CHINA DEVELOPMENT BANK	600,000.00	594,517.86
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	1,400,000.00	1,418,209.10
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	1,000,000.00	996,150.20
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	2,200,000.00	2,116,110.26
		PETROLIAM NASIONAL BERHD	1,310,000.00	1,517,807.65
		PETRONAS CAPITAL LTD	800,000.00	800,474.00
		PETRONAS CAPITAL LTD	200,000.00	189,798.98
		PETRONAS CAPITAL LTD	1,000,000.00	953,839.50
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：8.3%	8,510,000.00	8,586,907.55 (1,110,544,753) 8.6%
	合計			
社債券	米ドル	CODELCO INC	200,000.00	189,585.68
		CODELCO INC	1,200,000.00	1,102,633.08
		CODELCO INC	960,000.00	989,331.64
		CODELCO INC	200,000.00	202,316.66
		KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	600,000.00	576,751.80
		KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	3,060,000.00	2,798,292.88
		PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	2,600,000.00	2,617,602.00
		PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	1,200,000.00	1,005,828.00
		PETROLEOS MEXICANOS	800,000.00	798,096.00
		PETROLEOS MEXICANOS	1,400,000.00	1,213,562.00
		PETROLEOS MEXICANOS	1,200,000.00	1,067,160.00
	小計	銘柄数：11 組入時価比率：12.1%	13,420,000.00	12,561,159.74 (1,624,534,789) 12.6%
	合計			
合計				12,876,733,253 (12,876,733,253)

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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

種類	2022年 5月18日現在		
	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引			

為替予約取引				
売建	20,671,734	-	20,691,488	19,754
米ドル	20,671,734	-	20,691,488	19,754
合計	20,671,734	-	20,691,488	19,754

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## A C I E S G グローバル R E I T マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2022年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	362,167,618
コール・ローン	365,093,084
株式	1,539,116,123
投資証券	19,566,005,752
派生商品評価勘定	474,699
未収入金	298,608,228
未収配当金	31,753,159
流動資産合計	22,163,218,663
資産合計	
22,163,218,663	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	158,314
未払金	419,156,311
未払解約金	570,000
未払利息	130
流動負債合計	419,884,755
負債合計	
419,884,755	
純資産の部	
元本等	
元本	14,831,028,035
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,912,305,873
元本等合計	21,743,333,908
純資産合計	
21,743,333,908	
負債純資産合計	
22,163,218,663	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)



1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式 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、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券 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、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.費用・収益の計上基準	<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。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 5月18日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4661円
(10,000口当たり純資産額)	(14,661円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年11月19日 至 2022年 5月18日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p>

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

#### 市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

#### 信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

#### 流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 5月18日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
投資証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目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。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 5月18日現在	
期首	2021年11月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	13,027,037,349円
同期中における追加設定元本額	2,952,473,531円
同期中における一部解約元本額	1,148,482,845円
期末元本額	14,831,028,035円
期末元本額の内訳*	
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	1,413,441,498円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)年2回決算型	12,553,585,382円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジあり)隔月分配型	137,484,222円
グローバルESGバランスファンド(為替ヘッジなし)隔月分配型	726,516,933円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	東急不動産ホールディングス	421,100	671.00	282,558,100	
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：1.3%			282,558,100 18.4%
	米ドル	TRICON RESIDENTIAL INC	30,033	13.04	391,630.32	
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.2%			391,630.32 (50,649,549) 3.3%
	カナダドル	TRICON RESIDENTIAL INC	96,893	16.68	1,616,175.24	
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.8%			1,616,175.24 (163,314,508) 10.6%
	ユーロ	CELLNEX TELECOM SA	21,925	40.90	896,732.50	
		VGP NV	3,269	187.60	613,264.40	
		小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.9%			1,509,996.90 (206,205,176) 13.4%
	英ポンド	GRAINGER PLC	740,283	2.98	2,211,965.60	
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：1.6%			2,211,965.60 (357,542,119) 23.2%
	シンガポールド ル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	943,500	3.85	3,632,475.00	
		CITY DEVELOPMENTS LTD	183,200	8.16	1,494,912.00	
		小計	銘柄数：2 組入時価比率：2.2%			5,127,387.00 (478,846,671) 31.1%
合計					1,539,116,123 (1,256,558,023)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2022年5月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	864	134,179,200	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	916	300,906,000	
		三菱地所物流リート投資法人 投資 証券	218	100,716,000	
		オリックス不動産投資法人 投資証 券	1,199	220,256,300	
		インヴィンシブル投資法人 投資証 券	7,376	320,856,000	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：5.0%	10,573	1,076,913,500	5.5%
	米ドル	AGREE REALTY CORP	57,293	3,948,633.56	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	72,543	2,742,125.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,969	2,695,476.96	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	74,176	1,827,696.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	42,100	6,027,457.00	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	994,924	994,924.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	37,680	4,847,532.00	
		DUKE REALTY CORP	46,355	2,526,347.50	
		EQUINIX INC	10,777	6,970,671.37	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	54,424	3,952,815.12	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	114,120	2,631,607.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,081	2,983,976.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	204,535	4,237,965.20	
		INVITATION HOMES INC	136,139	5,016,722.15	
IRON MOUNTAIN INC		53,990	2,889,004.90		
KILROY REALTY CORP	44,287	2,737,822.34			
KIMCO REALTY CORP	228,916	5,514,586.44			
KITE REALTY GROUP TRUST	273,102	6,060,133.38			

	LIFE STORAGE INC	16,914	1,939,190.10	
	NETSTREIT CORP	104,158	2,208,149.60	
	PROLOGIS INC	65,537	8,251,108.30	
	PUBLIC STORAGE	26,666	8,438,722.36	
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	66,925	4,453,858.75	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,308	1,135,043.76	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,274	3,993,591.38	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	33,663	1,450,202.04	
	STORE CAPITAL CORP	57,072	1,569,480.00	
	UDR INC	102,193	4,962,492.08	
	VENTAS INC	58,781	3,331,119.27	
	VICI PROPERTIES INC	151,225	4,467,186.50	
	WELLTOWER INC	66,005	5,918,008.30	
小計	銘柄数：31	3,242,132	120,723,649.60	
			(15,613,189,602)	
	組入時価比率：71.8%		79.8%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	36,512	1,425,793.60	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	83,436	1,614,486.60	
小計	銘柄数：2	119,948	3,040,280.20	
			(307,220,314)	
	組入時価比率：1.4%		1.6%	
英ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	89,496	1,124,069.76	
	SEGRO PLC	120,062	1,336,290.06	
	SHAFTESBURY PLC	160,245	923,812.42	
	WORKSPACE GROUP PLC	133,423	897,936.79	
小計	銘柄数：4	503,226	4,282,109.03	
			(692,160,103)	
	組入時価比率：3.2%		3.5%	
豪ドル	DEXUS/AU	288,344	3,067,980.16	
	GOODMAN GROUP	265,796	4,983,675.00	
	SCENTRE GROUP	1,376,557	3,936,953.02	
	VICINITY CENTRES	383,665	725,126.85	
小計	銘柄数：4	2,314,362	12,713,735.03	
			(1,157,077,025)	
	組入時価比率：5.3%		5.9%	
香港ドル	LINK REIT	272,100	18,706,875.00	

小計	銘柄数：1	272,100	18,706,875.00 (308,289,300)	1.6%
	組入時価比率：1.4%			
シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,519,800	3,449,946.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	29,128	37,575.12	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	561,379	915,047.77	
小計	銘柄数：3	2,110,307	4,402,568.89 (411,155,908)	2.1%
	組入時価比率：1.9%			
合計			19,566,005,752 (18,489,092,252)	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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

種類	2022年 5月18日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	168,178,192	-	168,652,891	474,699
米ドル	146,640,343	-	147,103,017	462,674
香港ドル	21,537,849	-	21,549,874	12,025
売建	39,193,592	-	39,351,906	158,314
米ドル	21,537,849	-	21,543,830	5,981
豪ドル	17,655,743	-	17,808,076	152,333
合計	-	-	-	316,385

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

1)計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2 ファンドの現況

### 純資産額計算書

#### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

2022年6月30日現在

資産総額	15,911,844,702円
負債総額	7,615,946,441円
純資産総額（ - ）	8,295,898,261円
発行済口数	9,124,404,444口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9092円

#### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型

2022年6月30日現在

資産総額	78,472,601,354円
負債総額	200,846,194円
純資産総額（ - ）	78,271,755,160円
発行済口数	66,903,393,555口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1699円

#### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型

2022年6月30日現在

資産総額	1,461,260,036円
負債総額	698,683,487円
純資産総額（ - ）	762,576,549円
発行済口数	843,661,363口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9039円

#### グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型

2022年6月30日現在

資産総額	4,716,854,247円
負債総額	9,848,434円
純資産総額（ - ）	4,707,005,813円
発行済口数	4,050,721,796口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1620円

（参考）ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	22,367,272,752円
負債総額	113,889,356円
純資産総額（ - ）	22,253,383,396円
発行済口数	19,215,377,777口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1581円

（参考）米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	32,389,907,315円
負債総額	217円
純資産総額（ - ）	32,389,907,098円
発行済口数	29,267,035,354口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1067円

（参考）米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	13,779,767,625円
負債総額	81円
純資産総額（ - ）	13,779,767,544円
発行済口数	12,195,946,241口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1299円

（参考）ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

2022年6月30日現在

資産総額	22,930,915,442円
------	-----------------



負債総額	270,893,525円
純資産総額（ - ）	22,660,021,917円
発行済口数	15,593,260,132口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4532円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 委託会社等の概況

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

2022年6月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構

###### (a) 会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

###### 株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

###### 取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

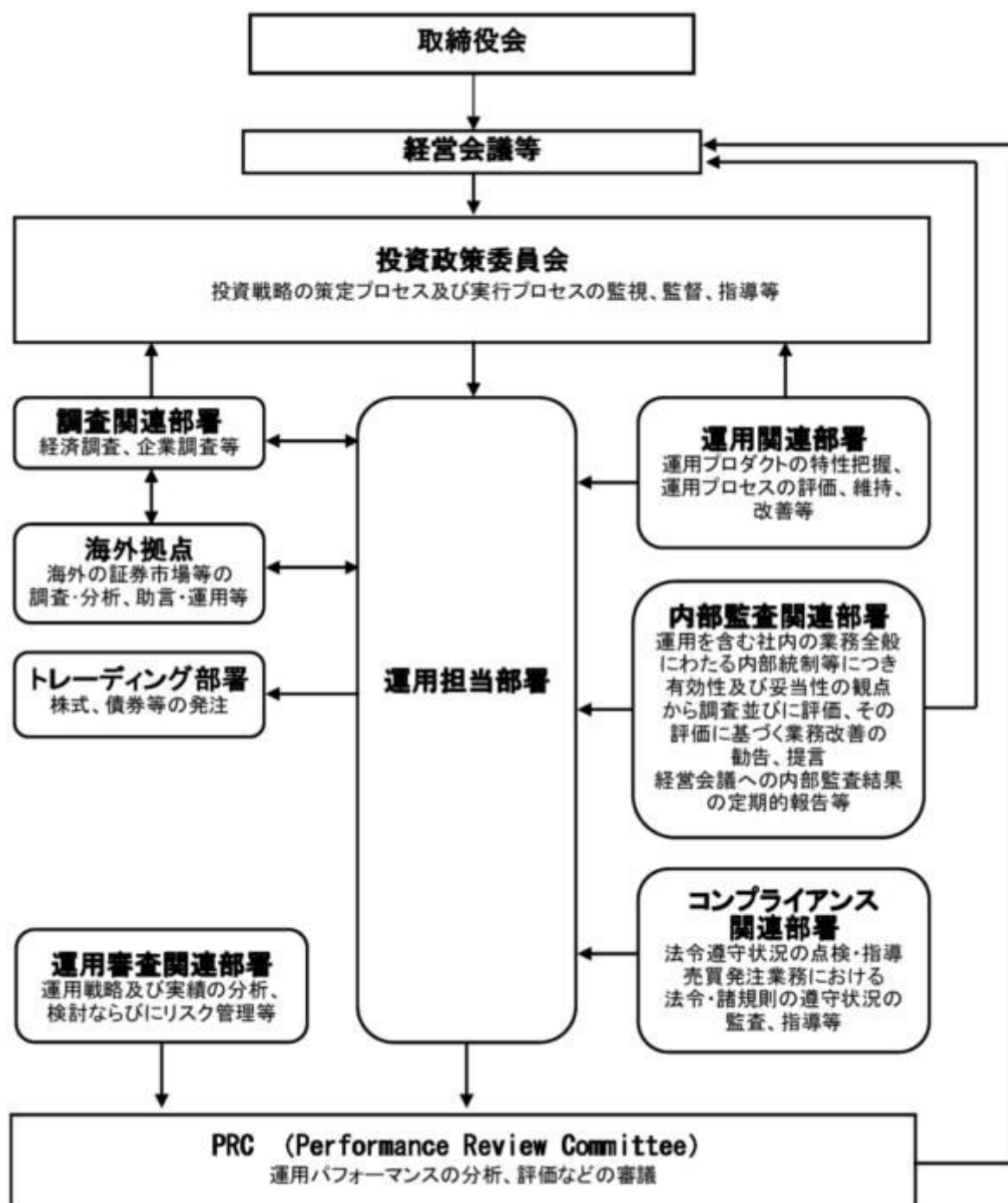
###### 代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

###### 監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

## (b)投資信託の運用体制



## 2 事業の内容及び営業の概況

## &lt; 更新後 &gt;

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2022年5月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	1,007	38,742,985
単体型株式投資信託	196	743,186
追加型公社債投資信託	14	6,246,104
単体型公社債投資信託	510	1,398,981
合計	1,727	47,131,256

### 3 委託会社等の経理状況

< 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(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、以下「財務諸表等規則」という)、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。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

#### (1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		4,281	2,006
金銭の信託		35,912	35,894
有価証券		30,400	29,300
前払金		-	11
前払費用		167	454
未収入金		632	694
未収委託者報酬		24,499	27,176
未収運用受託報酬		4,347	4,002
短期貸付金		-	1,835
その他		268	57
貸倒引当金		14	15
流動資産計		100,496	101,417
固定資産			
有形固定資産		2,666	1,744
建物	2	1,935	1,219

器具備品	2	731		525	
無形固定資産			5,429		5,210
ソフトウェア		5,428		5,209	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,487		16,067
投資有価証券		1,767		2,201	
関係会社株式		9,942		9,214	
長期差入保証金		330		443	
長期前払費用		15		13	
前払年金費用		1,301		1,297	
繰延税金資産		3,008		2,784	
その他		122		112	
固定資産計			24,583		23,023
資産合計			125,080		124,440

区分	注記 番号	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
預り金			123		120
未払金			16,948		17,615
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		8		17	
未払手数料		7,256		8,357	
関係会社未払金		8,671		8,149	
その他未払金		1,011		1,089	
未払費用	1		9,171		9,512
未払法人税等			2,113		1,319
前受収益			22		22
賞与引当金			3,795		4,416
その他			-		121
流動負債計			32,175		33,127
固定負債					
退職給付引当金			3,299		3,194
時効後支払損引当金			580		588
資産除去債務			1,371		1,123
固定負債計			5,250		4,905
負債合計			37,425		38,033
<b>(純資産の部)</b>					
株主資本					
資本金			87,596		86,232
資本剰余金			17,180		17,180
資本準備金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,686		55,322
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		56,001		54,637	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		31,395		30,030	

評価・換算差額等			57		174
その他有価証券評価差額金			57		174
純資産合計			87,654		86,407
負債・純資産合計			125,080		124,440

## (2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			106,355		115,733
運用受託報酬			16,583		17,671
その他営業収益			428		530
営業収益計			123,367		133,935
営業費用					
支払手数料			34,739		39,087
広告宣伝費			1,005		804
公告費			0		0
調査費			24,506		26,650
調査費		5,532		4,867	
委託調査費		18,974		21,783	
委託計算費			1,358		1,384
営業雑経費			4,149		3,094
通信費		73		72	
印刷費		976		918	
協会費		88		79	
諸経費		3,011		2,023	
営業費用計			65,760		71,021
一般管理費					
給料			10,985		12,033
役員報酬		147		229	
給料・手当		7,156		7,375	
賞与		3,682		4,427	
交際費			35		47
旅費交通費			64		65
租税公課			1,121		1,049
不動産賃借料			1,147		1,432
退職給付費用			1,267		1,212
固定資産減価償却費			2,700		2,525
諸経費			10,739		11,190
一般管理費計			28,063		29,556
営業利益			29,542		33,357

		前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,540		3,530	
受取利息		0		10	
金銭の信託運用益		1,698		-	
その他		447		1,268	
営業外収益計			6,687		4,809
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,387	
時効後支払損引当金繰入額		13		12	
為替差損		26		23	
その他		32		266	
営業外費用計			72		1,689
経常利益			36,157		36,477
特別利益					
投資有価証券等売却益		71		26	
株式報酬受入益		48		53	
固定資産売却益		-		9	
資産除去債務履行差額		-		141	
移転補償金		2,077		-	
特別利益計			2,197		230
特別損失					
投資有価証券等売却損		-		0	
投資有価証券等評価損		36		-	
関係会社株式評価損		582		727	
固定資産除却損	2	105		374	
資産除去債務履行差額		-		0	
事務所移転費用		406		54	
特別損失計			1,129		1,158
税引前当期純利益			37,225		35,549
法人税、住民税及び事業税			11,239		10,474
法人税等調整額			290		171
当期純利益			26,276		24,904

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		株主 資本 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		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	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当期変動額									
剰余金の配当							23,950	23,950	23,950
当期純利益							26,276	26,276	26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,326	2,326	2,326
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596

(単位：百万円)

	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	10	10	85,281
当期変動額			
剰余金の配当			23,950
当期純利益			26,276
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	46	46	46
当期変動額合計	46	46	2,372
当期末残高	57	57	87,654

当事業年度(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	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		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	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							26,268	26,268	26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904



株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,364	1,364	1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(単位：百万円)

	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	57	57	87,654
当期変動額			
剰余金の配当			26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	116	116	116
当期変動額合計	116	116	1,247
当期末残高	174	174	86,407

## [重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法  (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末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しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法
4．外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物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．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年

## 6. 引当金の計上基準

## (2) 無形固定資産及び投資その他の資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

## (1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産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

確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。

退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。

## (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。

## 7. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬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。

## 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4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

## 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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。

## 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。

## 8. 消費税等の会計処理方法

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、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。

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

## [ 会計上の見積りに関する注記 ]

該当事項はありません。

## [ 会計方針の変更 ]

## （収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識しています。

これにより、営業外収益に計上しておりますシステム利用サービスに係る収益について、従来は、当該システム利用サービスに係るシステム関連費用を控除し、純額で認識しておりましたが、控除せず、総額で収益を認識する方法に変更しております。

収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

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

## （時価の算定に関する会計基準の適用）

「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しております。これによる財務諸表に与え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しました。ただし、「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 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

## [ 未適用の会計基準等 ]

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

## (1) 概要

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

## (2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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

・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

2020年3月27日に成立した「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを明らかにすることを目的として企業基準委員会から公表されたものです。

(2) 適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,256百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,223百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 346百万円 器具備品 643 合計 990	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207

損益計算書関係

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,334百万円	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 3,525百万円
2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 2 ソフトウェア 102 ア 合計 105	2. 固定資産除却損 建物 346百万円 器具備品 28 ソフトウェア - ア 合計 374

## 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

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

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2021年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	26,268百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,100円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月30日

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

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

## 金融商品関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 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、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとん

どないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	4,281	4,281	-
(2)金銭の信託	35,912	35,912	-
(3)未収委託者報酬	24,499	24,499	-
(4)未収運用受託報酬	4,347	4,347	-
(5)有価証券及び投資有価証券	30,400	30,400	-
その他有価証券	30,400	30,400	-
資産計	99,441	99,441	-
(6)未払金	16,948	16,948	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	8	8	-
未払手数料	7,256	7,256	-
関係会社未払金	8,671	8,671	-
その他未払金	1,011	1,011	-
(7)未払費用	9,171	9,171	-
(8)未払法人税等	2,113	2,113	-
負債計	28,233	28,233	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### (1) 現金・預金

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。

### (2) 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。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引

先金融機関から提示された価格等によっております。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。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金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。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これら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：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	4,281	-	-	-
金銭の信託	35,912	-	-	-
未収委託者報酬	24,499	-	-	-
未収運用受託報酬	4,347	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	30,400	-	-	-
合計	99,441	-	-	-

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的と



して、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	35,894	35,894	-
資産計	35,894	35,894	-
(2) その他（デリバティブ取引）	121	121	-
負債計	121	121	-

(注) 1 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等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、記載を省略しております。

(注) 2 投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	当事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（ ）1.2	9,529
組合出資金等	1,886
合計	11,415

- ( ) 1 市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。  
2 非上場株式等について、当事業年度において727百万円減損処理を行っております。

(注) 3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

### 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、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できない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。

区分	貸借対照表計上額（単位：百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）（ ）	-	1,736	-	1,736
資産計	-	1,736	-	1,736
デリバティブ取引（通貨関連）	-	121	-	121
負債計	-	121	-	121

( ) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託34,157百万円は表中に含まれておりません。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 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、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。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。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

## 有価証券関係

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(2021年3月31日)

時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

## 4．その他有価証券(2021年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	30,400	30,400	-
小計	30,400	30,400	-
合計	30,400	30,400	-

非上場株式（貸借対照表計上額312百万円）及び投資事業有限責任組合への出資金（貸借対照表計上額1,455百万円）は、記載しておりません。

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2022年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2022年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2022年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額315百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,886百万円）は、記載してありません。

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

デリバティブ取引関係

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち一年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,714	-	121	121

## 退職給付関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
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確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
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	
退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	893
退職給付の支払額	781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	17,413 百万円
期待運用収益	409
数理計算上の差異の発生額	1,328
事業主からの拠出額	824
退職給付の支払額	626
年金資産の期末残高	19,349
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	19,959 百万円
年金資産	19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,016 百万円
利息費用	139
期待運用収益	409
数理計算上の差異の費用処理額	469
過去勤務費用の費用処理額	34
確定給付制度に係る退職給付費用	1,182
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.8%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、206百万円でした。

## 当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 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確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

## 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

退職給付債務の期首残高	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	1,521
退職給付の支払額	904
その他	14
退職給付債務の期末残高	21,967

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	19,349 百万円
期待運用収益	454
数理計算上の差異の発生額	258
事業主からの拠出額	814
退職給付の支払額	672
年金資産の期末残高	19,687

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	18,807 百万円
年金資産	19,687
	879
非積立型制度の退職給付債務	3,159
未積立退職給付債務	2,279
未認識数理計算上の差異	489
未認識過去勤務費用	106
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896
退職給付引当金	3,194
前払年金費用	1,297
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	45
確定給付制度に係る退職給付費用	959
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
------------------------	------------------------

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		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	
	百万円		百万円
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,176	賞与引当金	1,381
退職給付引当金	1,022	退職給付引当金	990
関係会社株式評価減	784	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	430	未払事業税	285
投資有価証券評価減	428	投資有価証券評価減	110
減価償却超過額	223	減価償却超過額	272
時効後支払損引当金	179	時効後支払損引当金	182
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	135	ゴルフ会員権評価減	92
資産除去債務	425	資産除去債務	348
未払社会保険料	95	未払社会保険料	114
その他	358	その他	84
繰延税金資産小計	5,410	繰延税金資産小計	5,376
評価性引当額	1,530	評価性引当額	1,795
繰延税金資産合計	3,879	繰延税金資産合計	3,581
繰延税金負債		繰延税金負債	
資産除去債務に対応する除去費用	361	資産除去債務に対応する除去費用	233
関係会社株式評価益	80	関係会社株式評価益	81
その他有価証券評価差額金	25	その他有価証券評価差額金	78
前払年金費用	403	前払年金費用	402
繰延税金負債合計	871	繰延税金負債合計	796
繰延税金資産の純額	3,008	繰延税金資産の純額	2,784
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な項目別の内訳		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な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.5%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%
タックスヘイブン税制	1.9%	タックスヘイブン税制	1.8%
外国税額控除	0.5%	外国税額控除	0.5%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%
その他	0.3%	その他	0.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%

### 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

#### 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

#### 3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)



	前事業年度		当事業年度	
	自	2020年4月 1日 至 2021年3月31日	自	2021年4月 1日 至 2022年3月31日
期首残高		-		1,371
有形固定資産の取得に伴う増加		1,371		48
資産除去債務の履行による減少		-		296
期末残高		1,371		1,123

## 収益認識に関する注記

### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

委託者報酬	115,670百万円
運用受託報酬	16,675百万円
成功報酬（注）	1,058百万円
その他営業収益	530百万円
合計	133,935百万円

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

### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 7. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## セグメント情報等

前事業年度（自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）

### 1. セグメント情報

当社は投資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）製品・サービスごとの情報

当社の製品・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、製品・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

##### 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

### (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資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) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・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、製品・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

#### 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

### (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 関連当事者情報

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

(イ) 子会社等  
該当はありません。

### (ウ) 兄弟会社等

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

親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1)	26,722	未払手数料	5,690
							コマーシャル・ペーパーの償還(*2)	20,000	有価証券	-
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*2) コマーシャル・ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

## 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

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (イ) 子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
子会社	ノムラ・エー ム・ファイ ナンス・イン ク	ケイマン	2,500 (米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	3,427	短期貸付 金	1,835
							資金の返済	1,709		
							貸付金利息 の受取	9	未収利息	4

## （ウ）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	29,119	未払手数料	6,013

## （エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等  
（\*1）投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

## 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

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、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

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	17,018円01銭	1株当たり純資産額	16,775円81銭
1株当たり当期純利益	5,101円61銭	1株当たり当期純利益	4,835円10銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	26,276百万円	損益計算書上の当期純利益	24,904百万円
普通株式に係る当期純利益	26,276百万円	普通株式に係る当期純利益	24,904百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1 名称、資本金の額及び事業の内容

&lt; 更新後 &gt;

## (1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

\* 2022年5月末現在

## (2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
ぐんぎん証券株式会社 四国アライアンス証券株式会社 静銀ティーエム証券株式会社 第四北越証券株式会社 とうほう証券株式会社 百五証券株式会社 ひろぎん証券株式会社 北洋証券株式会社	3,000百万円 3,000百万円 3,000百万円 600百万円 3,000百万円 3,000百万円 5,000百万円 500百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社足利銀行 株式会社池田泉州銀行 株式会社伊予銀行 株式会社神奈川銀行 株式会社紀陽銀行 株式会社京都銀行 株式会社きらやか銀行 株式会社群馬銀行 株式会社京葉銀行 株式会社高知銀行 株式会社佐賀銀行 株式会社三十三銀行 株式会社滋賀銀行 株式会社十六銀行 株式会社常陽銀行 株式会社但馬銀行 株式会社千葉銀行 株式会社中京銀行 株式会社筑波銀行 株式会社東邦銀行 株式会社鳥取銀行	135,000百万円 61,385百万円 20,948百万円 6,191百万円 80,096百万円 42,103百万円 24,200百万円 48,652百万円 49,759百万円 19,544百万円 16,062百万円 37,400百万円 33,076百万円 36,839百万円 85,113百万円 5,481百万円 145,069百万円 31,879百万円 48,868百万円 23,519百万円 9,061百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社長崎銀行	7,621百万円	
株式会社長野銀行	13,000百万円	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福井銀行	17,965百万円	
株式会社福岡中央銀行	4,000百万円	
株式会社福島銀行	18,682百万円	
株式会社豊和銀行	12,400百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社みちのく銀行	36,986百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	

\* 2022年5月末現在

## (3) 運用の委託先

(a) 名称	(b) 資本金の額	(c) 事業の内容
American Century Investment Management, Inc. (アメリカン・センチュリー・インベストメント・マネジメント・インク)	16,207,000米ドル <sup>*1</sup>	資産運用業務を行なっています。
NOMURA ASSET MANAGEMENT U.K. LIMITED (ノムラ・アセット・マネジメント U.K. リミテッド)	4,744,391 <sup>*2</sup>	英国の1986年金融サービス業法に基づき英国金融サービス庁に登録された当該法律の定める範囲内で行う投資顧問業およびそれに付随する一切の業務を営んでいます。

\*1 2021年12月末現在

\*2 2022年3月末現在

## 独立監査人の監査報告書

2022年7月26日

野村アセットマネジメント株式会社

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 湯原 尚  
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」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型の2021年11月19日から2022年5月18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、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型の2022年5月18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、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

2022年7月26日

野村アセットマネジメント株式会社

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 湯原 尚  
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」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型の2021年11月19日から2022年5月18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、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型の2022年5月18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、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年7月26日

野村アセットマネジメント株式会社

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 湯原 尚  
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」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型の2021年11月19日から2022年5月18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、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジあり）隔月分配型の2022年5月18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、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年7月26日

野村アセットマネジメント株式会社

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 湯原 尚  
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」に掲げられているグローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型の2021年11月19日から2022年5月18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、グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）隔月分配型の2022年5月18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、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2022年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社  
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 湯原 尚指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 水永 真太郎

### 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」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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



## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。