

## 【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】	2023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、2023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

##### (1) ファンドの目的及び基本的性格

###### <更新後>

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。  
なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

《一般社団法人投資信託協会インターネットホームページアドレス》 <http://www.toushin.or.jp/>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（2023年1月19日現在）

###### <商品分類表定義>

###### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来からの信託財産とともに運用されるファンドをいう。

###### [ 投資対象地域による区分 ]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

###### [ 投資対象資産による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

###### [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...MRF及びMMFの運営に関する規則（以下「MRF等規則」という。）に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...MRF等規則に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

###### [ 補足分類 ]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運

用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

### (3) ファンドの仕組み

#### < 更新後 >

委託会社の概況(2023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

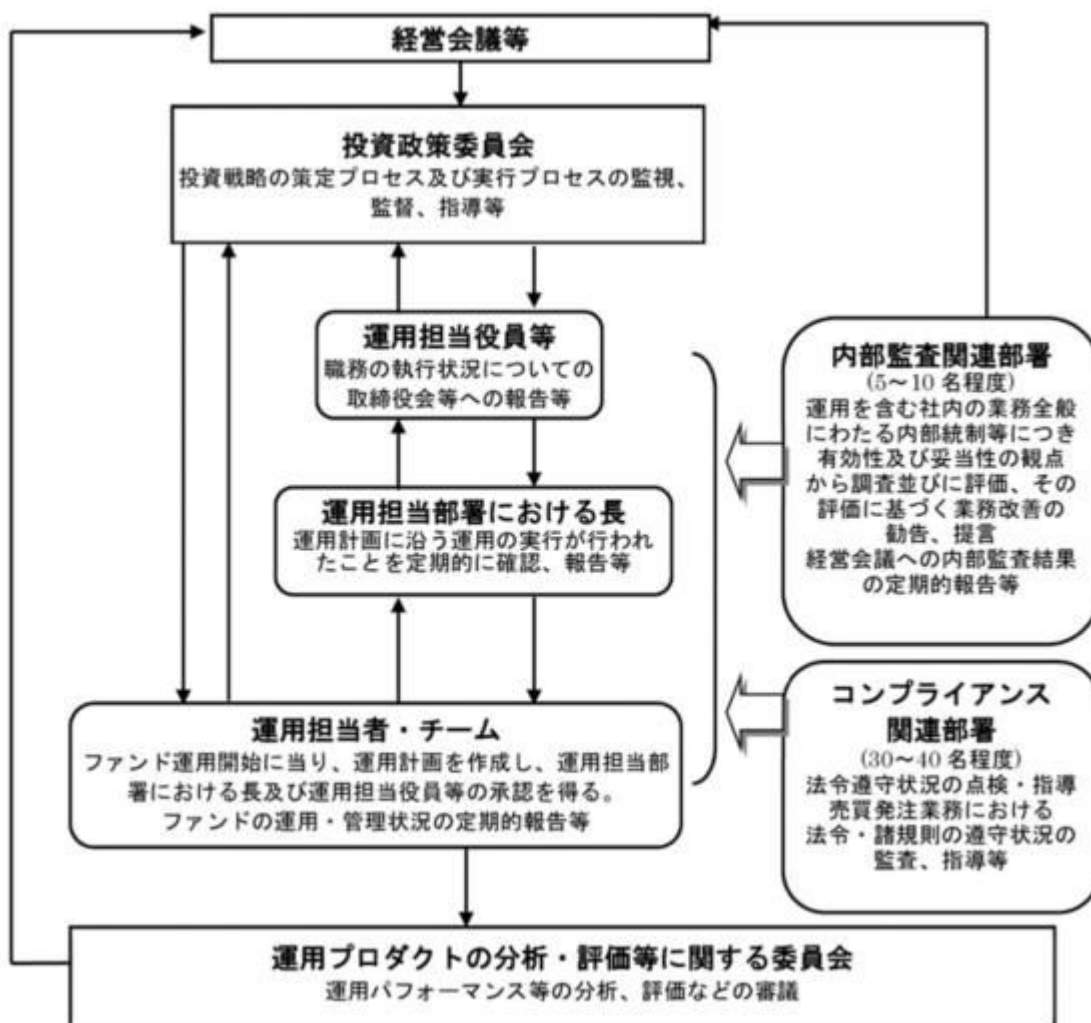
名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

## 2 投資方針

### (3) 運用体制

#### < 更新後 >

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

## （５）投資制限

<訂正前>

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す。）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、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号口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号八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。なお、デリバティブ取引は実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で実質的に行ないます。



- ・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す。）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、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号口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号八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

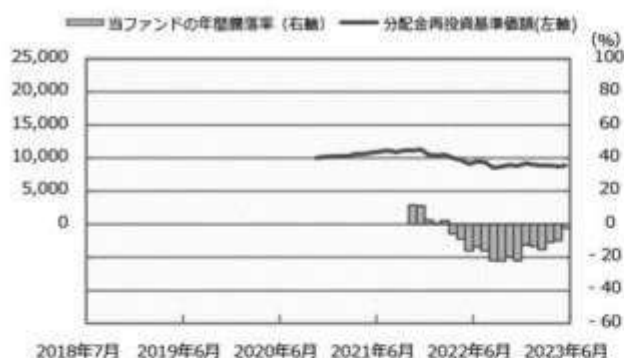
### 3 投資リスク

< 更新後 >

## ■ リスクの定量的比較 (2018年7月末～2023年6月末：月次)

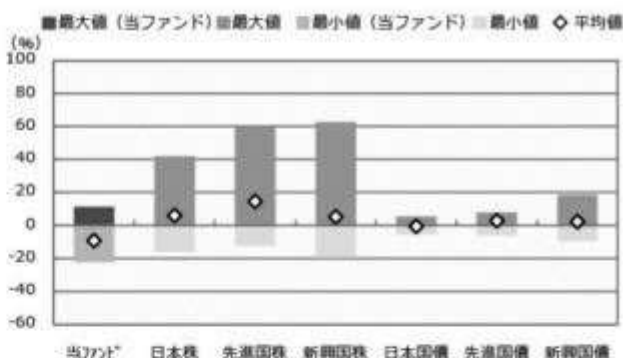
### Ⅰ (為替ヘッジあり) 年2回決算型

#### 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



2018年7月 2019年6月 2020年6月 2021年6月 2022年6月 2023年6月

#### 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

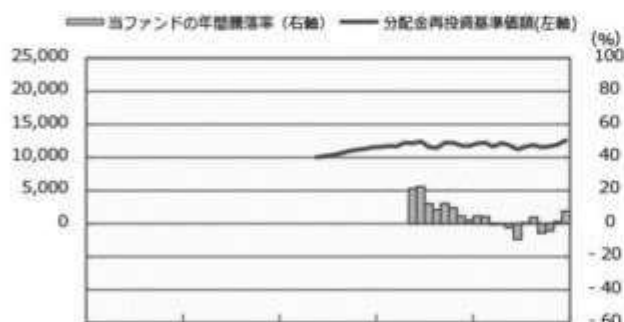
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	11.4	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	18.5
最小値 (%)	△ 22.1	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	△ 9.1	6.0	14.5	5.3	△ 0.4	2.8	2.3

- \* 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2023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。
- \* 2018年7月から2023年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2023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。

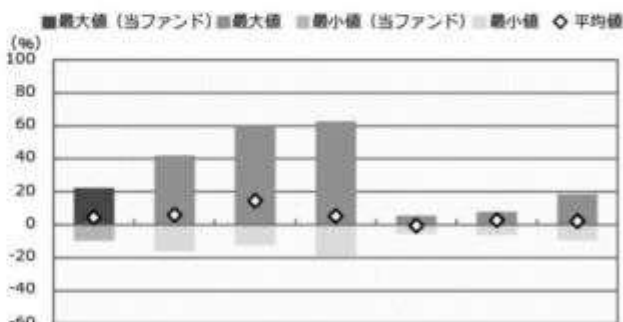
### Ⅱ (為替ヘッジなし) 年2回決算型

#### 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



2018年7月 2019年6月 2020年6月 2021年6月 2022年6月 2023年6月

#### 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

	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	7.9	18.5
最小値 (%)	△ 9.5	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	4.5	6.0	14.5	5.3	△ 0.4	2.8	2.3

- \* 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2023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。

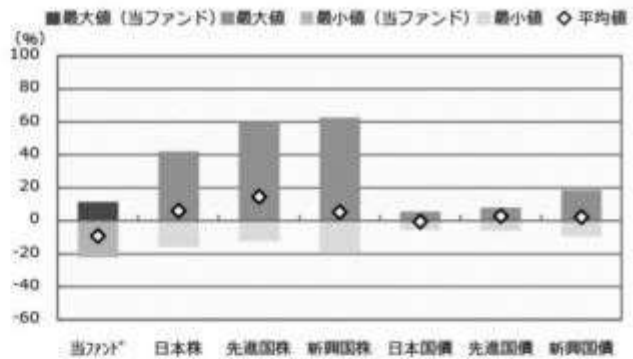
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2018年7月から2023年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2023年6月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 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



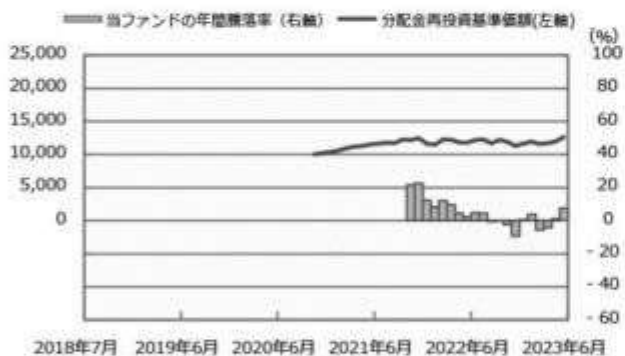
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	11.4	42.1	59.8	62.7	5.4	7.9	18.5
最小値 (%)	△ 22.2	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	△ 9.2	6.0	14.5	5.3	△ 0.4	2.8	2.3

- \* 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2023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。

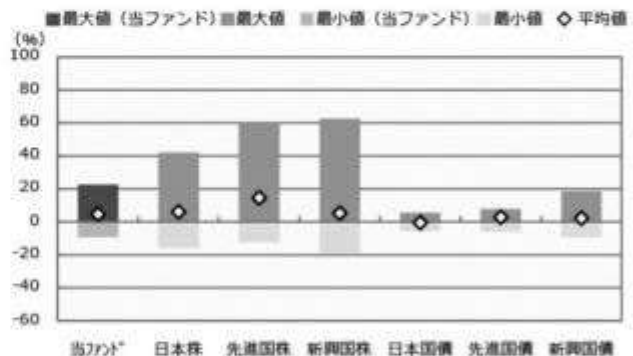
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2018年7月から2023年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2023年6月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 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	7.9	18.5
最小値 (%)	△ 9.4	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 5.5	△ 6.1	△ 9.4
平均値 (%)	4.6	6.0	14.5	5.3	△ 0.4	2.8	2.3

- \* 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2023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。
- \* 2018年7月から2023年6月の5年間（当ファンドは2021年11月から2023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。

＜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・ディバースファイド（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）に係る標準又は商標は、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）に係る標準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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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取利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・ディバースファイド（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・ディバースファイド（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値段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）についての勧誘、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考えら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NASDAQ、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, 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

###### ＜更新後＞

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

###### ＜収益分配金に対する課税＞

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。

###### ＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

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》
--------	---------------------------------	--------

・特定公社債 <sup>(注1)</sup> の利子 ・公募公社債投資信託の収益分配金	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 ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益分配金
--	--	-----------------------------

(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。

公募株式投資信託は税法上、NISA（少額投資非課税制度）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。ファンドは、2024年1月1日以降のNISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### \* 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。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。2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。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。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。（2023年6月末現在）

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。

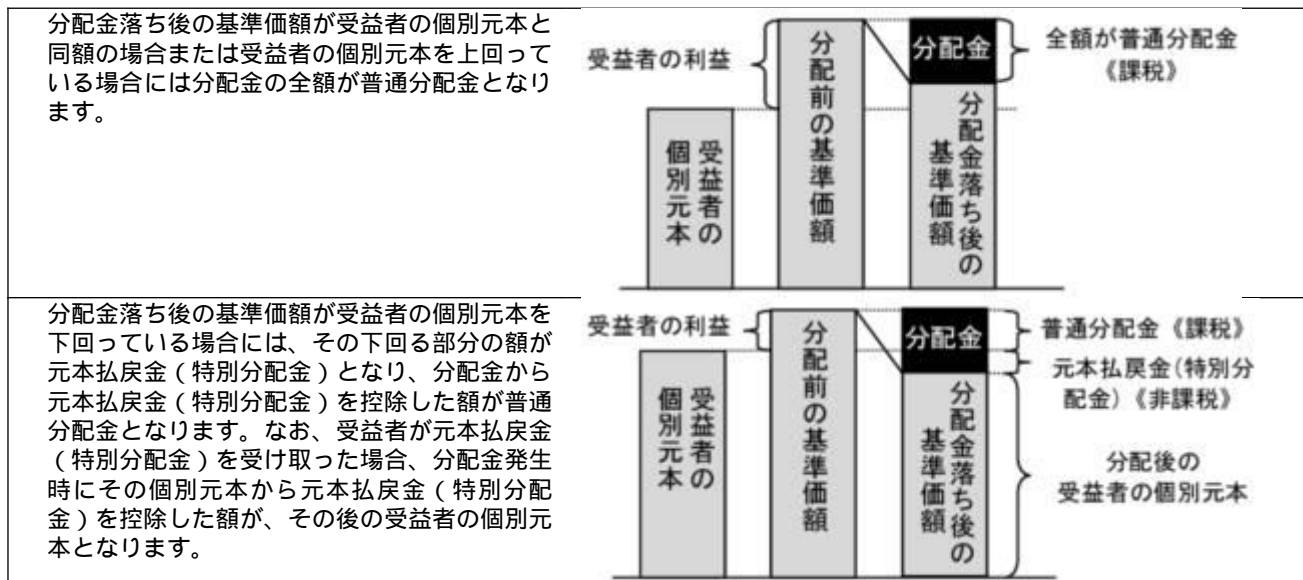
#### 個別元本について

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（2023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2023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	7,811,507,752	99.65
現金・預金・その他資産（負債控除後）		27,030,877	0.34
合計（純資産総額）		7,838,538,629	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	77,463,860,787	99.02
現金・預金・その他資産（負債控除後）		765,876,397	0.97
合計（純資産総額）		78,229,737,184	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	621,089,769	99.67
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,036,036	0.32
合計（純資産総額）		623,125,805	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	4,584,765,701	98.98
現金・預金・その他資産（負債控除後）		46,920,861	1.01
合計（純資産総額）		4,631,686,562	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	1,823,895,850	7.99
	アメリカ	12,173,694,567	53.33
	カナダ	1,245,657,865	5.45
	メキシコ	247,815,200	1.08
	ブラジル	170,087,638	0.74
	ドイツ	540,518,755	2.36
	イタリア	488,227,663	2.13
	フランス	232,409,174	1.01
	オランダ	122,678,513	0.53
	スペイン	279,422,510	1.22
	ベルギー	162,313,075	0.71
	フィンランド	260,780,490	1.14
	アイルランド	111,008,873	0.48
	イギリス	653,206,961	2.86
スイス	102,871,095	0.45	

	スウェーデン	463,403,477	2.03
	ノルウェー	173,299,590	0.75
	オーストラリア	295,045,887	1.29
	香港	548,665,896	2.40
	韓国	319,871,398	1.40
	台湾	750,494,349	3.28
	小計	21,165,368,826	92.72
投資信託受益証券	アメリカ	317,351,632	1.39
投資証券	日本	218,218,000	0.95
	アメリカ	433,969,031	1.90
	カナダ	240,727,842	1.05
	イギリス	127,772,016	0.55
	小計	1,020,686,889	4.47
現金・預金・その他資産（負債控除後）		322,764,925	1.41
合計（純資産総額）		22,826,172,272	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	29,035,856,348	92.30
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,419,855,717	7.69
合計（純資産総額）		31,455,712,065	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	10,481,930,225	77.85
特殊債券	アメリカ	349,892,454	2.59
社債券	アメリカ	2,202,257,087	16.35
現金・預金・その他資産（負債控除後）		429,036,661	3.18
合計（純資産総額）		13,463,116,427	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	496,883,520	2.18
	アメリカ	396,271,655	1.74
	スペイン	121,612,843	0.53
	オーストラリア	209,029,039	0.91
	香港	55,994,505	0.24

	小計	1,279,791,562	5.62
投資証券	日本	902,928,400	3.97
	アメリカ	16,606,512,600	73.03
	カナダ	479,722,637	2.10
	イギリス	970,884,861	4.26
	オーストラリア	1,108,715,015	4.87
	香港	168,029,802	0.73
	シンガポール	624,209,267	2.74
	小計	20,861,002,582	91.74
現金・預金・その他資産（負債控除後）		596,603,512	2.62
合計（純資産総額）		22,737,397,656	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 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

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E S G先進国社債 マ ザーファンド	2,264,004,501	1.1358	2,571,456,313	1.1971	2,710,239,788	34.57
2	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S Gグローバル小型 株 マザーファンド	1,477,185,615	1.2277	1,813,540,780	1.3348	1,971,747,358	25.15
3	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド	1,326,634,302	1.3967	1,852,910,130	1.4845	1,969,388,621	25.12
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てE S G新興国国債 マ ザーファンド	903,107,571	1.2098	1,092,579,540	1.2846	1,160,131,985	14.80

## 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	99.65
合計	99.65

## 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

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E S G先進国社債 マ ザーファンド	22,500,389,552	1.1357	25,553,692,415	1.1971	26,935,216,332	34.43
2	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S Gグローバル小型 株 マザーファンド	14,639,759,918	1.2275	17,970,305,300	1.3348	19,541,151,538	24.97
3	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド	13,108,023,754	1.3962	18,301,422,766	1.4845	19,458,861,262	24.87
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てE S G新興国国債 マ ザーファンド	8,974,491,402	1.2097	10,856,442,249	1.2846	11,528,631,655	14.73

## 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	99.02
合 計	99.02

## 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

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E S G先進国社債 マ ザーファンド	179,848,588	1.1360	204,307,996	1.1971	215,296,744	34.55
2	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S Gグローバル小型 株 マザーファンド	117,506,202	1.2282	144,321,118	1.3348	156,847,278	25.17
3	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド	105,619,038	1.3971	147,560,358	1.4845	156,791,461	25.16
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てE S G新興国国債 マ ザーファンド	71,737,729	1.2101	86,809,826	1.2846	92,154,286	14.78

## 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	99.67
合 計	99.67

## 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

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E S G先進国社債 マ ザーファンド	1,331,708,127	1.1357	1,512,420,920	1.1971	1,594,187,798	34.41
2	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S Gグローバル小型 株 マザーファンド	866,261,292	1.2276	1,063,422,363	1.3348	1,156,285,572	24.96
3	日本	親投資信託 受益証券	A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド	776,054,312	1.3962	1,083,527,031	1.4845	1,152,052,626	24.87
4	日本	親投資信託 受益証券	米ドル建てE S G新興国国債 マ ザーファンド	531,091,161	1.2097	642,460,978	1.2846	682,239,705	14.72

## 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	98.98
合 計	98.98

(参考) A C I E S G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	アメリカ	株式	TOLL BROTHERS INC	家庭用耐久財	31,222	8,940.16	279,129,878	11,355.61	354,545,068	1.55
2	日本	株式	アシックス	その他製品	80,000	3,097.82	247,825,600	4,421.00	353,680,000	1.54
3	アメリカ	株式	CLEAN HARBORS INC	商業サービス・用品	14,963	16,866.68	252,376,233	23,494.17	351,543,409	1.54
4	アメリカ	株式	KINSALE CAPITAL GROUP INC	保険	6,172	43,547.74	268,776,692	53,931.93	332,867,874	1.45
5	カナダ	株式	STANTEC INC	建設・土木	35,575	7,336.71	261,003,600	9,287.33	330,397,106	1.44
6	アメリカ	株式	RADNET INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	67,481	2,543.12	171,612,592	4,783.22	322,776,476	1.41
7	韓国	株式	JYP ENTERTAINMENT CORP	娯楽	23,282	8,677.57	202,031,185	13,739.00	319,871,398	1.40
8	アメリカ	株式	H&E EQUIPMENT SERVICES INC	商社・流通業	47,118	6,011.84	283,266,119	6,630.39	312,410,843	1.36
9	香港	株式	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	繊維・アパレル・贅沢品	769,800	395.90	304,763,820	399.60	307,612,080	1.34
10	カナダ	株式	FIRSTSERVICE CORP	不動産管理・開発	12,935	21,034.82	272,085,516	21,852.69	282,664,576	1.23
11	アメリカ	株式	SPS COMMERCE INC	ソフトウェア	9,687	19,240.17	186,379,555	27,442.25	265,833,146	1.16
12	アメリカ	株式	CROCS INC	繊維・アパレル・贅沢品	16,750	14,252.51	238,729,659	15,689.36	262,796,912	1.15
13	アメリカ	株式	TENABLE HOLDINGS INC	ソフトウェア	41,231	5,645.18	232,756,505	6,305.61	259,986,816	1.13
14	アメリカ	株式	ATI INC	金属・鉱業	40,870	4,185.86	171,076,152	6,262.11	255,932,767	1.12
15	アメリカ	投資証券	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		17,916	12,986.75	232,670,690	13,476.82	241,450,716	1.05
16	カナダ	投資証券	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		35,712	5,511.82	196,838,451	6,740.81	240,727,842	1.05
17	カナダ	株式	CAPSTONE COPPER CORP	金属・鉱業	364,478	486.56	177,341,509	646.19	235,525,465	1.03
18	アメリカ	株式	EVOLENT HEALTH INC-A	ヘルスケア・テクノロジー	53,357	3,765.39	200,909,930	4,401.89	234,871,986	1.02
19	フランス	株式	SPIE SA	商業サービス・用品	50,125	3,620.07	181,456,109	4,636.59	232,409,174	1.01
20	アメリカ	株式	COMMERCIAL METALS CO	金属・鉱業	30,600	6,930.28	212,066,723	7,593.12	232,349,665	1.01
21	台湾	株式	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	機械	48,928	4,374.81	214,051,051	4,731.32	231,494,073	1.01
22	アメリカ	株式	GXO LOGISTICS INC	航空貨物・物流サービス	25,426	7,727.96	196,491,289	9,096.67	231,291,998	1.01
23	アメリカ	株式	INTER PARFUMS INC	パーソナルケア用品	11,937	18,486.80	220,676,946	19,318.46	230,604,548	1.01
24	アメリカ	株式	WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	エネルギー設備・サービス	24,180	7,456.83	180,306,287	9,483.79	229,318,185	1.00
25	アメリカ	株式	JELD-WEN HOLDING INC	建設関連製品	87,371	2,036.72	177,950,795	2,563.42	223,968,848	0.98
26	カナダ	株式	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	金融サービス	101,575	1,992.17	202,355,155	2,188.98	222,346,334	0.97

27	アメリカ	株式	MANHATTAN ASSOCIATES, INC.	ソフトウェア	7,809	18,345.58	143,260,671	28,296.24	220,965,404	0.96
28	アメリカ	株式	SUMMIT MATERIALS INC -CL A	建設資材	40,186	4,149.61	166,756,380	5,442.92	218,729,368	0.95
29	アメリカ	株式	ELF BEAUTY INC	パーソナルケア用品	13,386	7,642.42	102,301,473	16,311.37	218,344,066	0.95
30	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券		3,815	46,107	175,900,074	57,200	218,218,000	0.95

## 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	食料品	0.79
		繊維製品	0.45
		電気機器	0.50
		その他製品	1.54
		情報・通信業	1.63
		小売業	1.27
		不動産業	0.69
		サービス業	1.08
	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.74
		娯楽	2.05
		不動産管理・開発	2.17
		エネルギー設備・サービス	2.71
		石油・ガス・消耗燃料	0.63
		建設資材	0.95
		容器・包装	0.88
		金属・鋳業	3.74
		紙製品・林産品	0.57
		航空宇宙・防衛	0.68
		建設関連製品	2.99
		建設・土木	2.82
		電気設備	0.52
		機械	5.93
		商社・流通業	2.07
		商業サービス・用品	3.94
		航空貨物・物流サービス	1.01
		陸上運輸	0.80
		自動車用部品	0.47
		家庭用耐久財	1.55
		レジャー用品	0.65
		繊維・アパレル・贅沢品	2.49
		ホテル・レストラン・レジャー	2.36
		販売	0.71
大規模小売り	1.35		
専門小売り	1.07		

	飲料	0.64
	パーソナルケア用品	1.96
	ヘルスケア機器・用品	1.92
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	4.58
	バイオテクノロジー	1.36
	医薬品	0.87
	銀行	3.22
	金融サービス	1.68
	保険	2.27
	ソフトウェア	6.27
	通信機器	0.41
	コンピュータ・周辺機器	1.34
	電子装置・機器・部品	2.02
	半導体・半導体製造装置	4.23
	ガス	0.77
	消費者金融	0.58
	資本市場	2.36
	ヘルスケア・テクノロジー	1.02
	専門サービス	1.16
投資信託受益証券		1.39
投資証券		4.47
合計		98.58

## (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	13,487.42	674,371,181	13,615.96	680,798,008	3.85	2027/11/15	2.16
2	アメリカ	社債券	RALPH LAUREN CORP	5,200,000	12,485.80	649,261,868	12,769.27	664,002,381	2.95	2030/6/15	2.11
3	アメリカ	社債券	STARBUCKS CORP	5,300,000	12,221.05	647,715,754	12,319.64	652,941,347	2.55	2030/11/15	2.07
4	アメリカ	社債券	HP INC	4,700,000	12,273.21	576,841,037	12,723.20	597,990,408	3.4	2030/6/17	1.90
5	アメリカ	社債券	NXP BV/NXP FDG/NXP USA	4,600,000	12,433.69	571,949,937	12,767.80	587,319,025	3.4	2030/5/1	1.86
6	アメリカ	社債券	HEALTHPEAK PROPERTIES	4,800,000	12,047.14	578,263,037	12,221.07	586,611,538	2.875	2031/1/15	1.86
7	アメリカ	社債券	NEXTERA ENERGY CAPITAL	4,800,000	11,913.34	571,840,792	12,034.09	577,636,402	2.25	2030/6/1	1.83
8	アメリカ	社債券	SCENTRE GROUP TRUST 2	4,400,000	12,703.57	558,957,271	12,986.92	571,424,526	4.75	2080/9/24	1.81
9	アメリカ	社債券	AES CORP/THE	4,200,000	12,594.04	528,950,053	13,013.19	546,554,115	3.95	2030/7/15	1.73
10	アメリカ	社債券	INGERSOLL-RAND LUX FINAN	4,000,000	13,286.66	531,466,702	13,638.30	545,532,356	3.8	2029/3/21	1.73
11	アメリカ	社債券	SYSCO CORPORATION	3,562,000	15,133.57	539,058,091	15,131.48	538,983,463	5.95	2030/4/1	1.71
12	アメリカ	社債券	MCDONALD'S CORP	4,000,000	13,427.01	537,080,426	13,451.58	538,063,458	3.6	2030/7/1	1.71
13	アメリカ	社債券	AVANGRID INC	4,000,000	13,108.87	524,355,059	13,205.78	528,231,222	3.8	2029/6/1	1.67

14	アメリカ	社債券	ENEL FINANCE AMERICA LLC	5,550,000	8,604.70	477,560,919	9,464.32	525,269,807	2.875	2041/7/12	1.66
15	アメリカ	社債券	HP ENTERPRISE CO	3,300,000	14,290.94	471,601,190	14,971.24	494,050,957	6.35	2045/10/15	1.57
16	アメリカ	社債券	UDR INC	4,000,000	11,791.75	471,670,391	12,249.07	489,963,025	3	2031/8/15	1.55
17	アメリカ	社債券	FEDEX CORP	4,200,000	10,826.57	454,716,246	11,478.26	482,087,203	4.05	2048/2/15	1.53
18	アメリカ	社債券	E.ON INTL FINANCE BV	3,150,000	14,164.76	446,190,042	15,291.17	481,672,137	6.65	2038/4/30	1.53
19	アメリカ	社債券	RAYTHEON TECH CORP	4,600,000	10,362.90	476,693,604	10,387.16	477,809,447	3.125	2050/7/1	1.51
20	アメリカ	社債券	MOLSON COORS BREWING CO	4,000,000	11,535.72	461,428,993	11,778.62	471,144,831	4.2	2046/7/15	1.49
21	アメリカ	社債券	HASBRO INC	3,600,000	12,870.08	463,323,014	13,083.54	471,007,525	3.9	2029/11/19	1.49
22	アメリカ	社債券	SIMON PROPERTY GROUP LP	4,000,000	11,517.64	460,705,739	11,646.93	465,877,576	2.2	2031/2/1	1.48
23	アメリカ	社債券	KROGER CO	4,000,000	11,098.98	443,959,380	11,326.81	453,072,465	1.7	2031/1/15	1.44
24	アメリカ	社債券	UNITED PARCEL SERVICE	3,000,000	15,412.12	462,363,874	15,021.18	450,635,488	5.3	2050/4/1	1.43
25	アメリカ	社債券	BEST BUY CO INC	3,200,000	13,818.36	442,187,579	14,034.80	449,113,647	4.45	2028/10/1	1.42
26	アメリカ	社債券	EDP FINANCE BV	3,600,000	11,874.84	427,494,309	12,410.90	446,792,519	1.71	2028/1/24	1.42
27	アメリカ	社債券	INTL FLAVOR & FRAGRANCES	4,000,000	10,151.71	406,068,737	10,075.74	403,029,689	3.268	2040/11/15	1.28
28	アメリカ	社債券	GENERAL MILLS INC	2,825,000	14,057.20	397,115,927	14,087.40	397,969,158	4.2	2028/4/17	1.26
29	アメリカ	社債券	DAIMLER FINANCE NA LLC	3,000,000	12,905.63	387,168,972	13,159.58	394,787,515	1.45	2026/3/2	1.25
30	アメリカ	社債券	PEPSICO INC	2,750,000	13,952.11	383,683,205	13,931.08	383,104,818	3.6	2028/2/18	1.21

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	92.30
合計	92.30

## (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	PANAMA GLOBAL	3,300,000	15,284.11	504,375,735	15,456.95	510,079,363	6.7	2036/1/26	3.78
2	アメリカ	社債券	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	3,200,000	13,605.06	435,362,053	14,464.78	462,873,036	5.375	2029/1/25	3.43
3	アメリカ	社債券	PETROLEOS MEXICANOS	5,000,000	9,218.08	460,904,361	9,030.87	451,543,879	6.75	2047/9/21	3.35
4	アメリカ	国債証券	KINGDOM OF JORDAN	3,500,000	11,726.26	410,419,423	12,541.63	438,957,225	7.375	2047/10/10	3.26
5	アメリカ	国債証券	PERU GLOBAL	2,430,000	15,490.85	376,427,746	16,189.23	393,398,525	6.55	2037/3/14	2.92
6	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF HUNGARY	2,400,000	15,916.53	381,996,859	16,355.88	392,541,286	7.625	2041/3/29	2.91
7	アメリカ	国債証券	HUNGARY	2,700,000	14,065.50	379,768,740	14,154.92	382,182,954	5.25	2029/6/16	2.83
8	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	2,800,000	12,216.99	342,075,864	12,518.23	350,510,704	2.45	2031/1/31	2.60
9	アメリカ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	2,800,000	11,548.45	323,356,698	12,307.41	344,607,627	6.4	2049/6/5	2.55
10	アメリカ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	2,200,000	14,058.18	309,279,984	14,205.55	312,522,268	5.95	2027/1/25	2.32



11	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,700,000	17,971.32	305,512,450	18,352.21	311,987,632	9.5	2030/2/2	2.31
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,000,000	10,404.61	312,138,387	10,236.29	307,088,820	5.65	2047/9/27	2.28
13	アメリカ	国債証券	ROMANIA	2,000,000	13,842.19	276,843,906	14,364.15	287,283,186	6	2034/5/25	2.13
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,100,000	13,640.48	286,450,190	13,588.46	285,357,719	4.85	2027/9/27	2.11
15	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,800,000	14,038.30	252,689,558	14,127.04	254,286,768	4.75	2026/6/15	1.88
16	アメリカ	国債証券	ROMANIA	2,000,000	11,787.68	235,753,740	12,146.53	242,930,745	3	2031/2/14	1.80
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,300,000	17,667.27	229,674,613	18,291.66	237,791,674	8.75	2033/11/21	1.76
18	アメリカ	国債証券	COLOMBIA GLOBAL	1,690,000	13,099.27	221,377,800	13,768.21	232,682,892	7.375	2037/9/18	1.72
19	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000	12,865.07	231,571,417	12,752.95	229,553,243	4.85	2029/9/30	1.70
20	アメリカ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,800,000	12,249.63	220,493,514	12,681.48	228,266,732	4.5	2030/1/30	1.69
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,100,000	10,221.79	214,657,695	10,752.95	225,812,131	5.625	2044/2/26	1.67
22	アメリカ	社債券	CODELCO INC	1,700,000	13,018.79	221,319,510	13,119.61	223,033,519	3.75	2031/1/15	1.65
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,800,000	11,288.92	203,200,585	11,748.37	211,470,818	6.125	2041/1/18	1.57
24	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	1,080,000	17,897.56	193,293,708	18,997.34	205,171,327	8.5	2035/10/12	1.52
25	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,420,000	14,198.87	201,623,964	14,256.86	202,447,507	4.875	2025/2/1	1.50
26	アメリカ	国債証券	KINGDOM OF BAHRAIN	1,340,000	14,849.87	198,988,336	14,788.37	198,164,172	7	2026/1/26	1.47
27	アメリカ	国債証券	MEXICO GLOBAL	1,150,000	15,192.45	174,713,182	15,747.38	181,094,918	6.75	2034/9/27	1.34
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,420,000	12,320.80	174,955,451	12,653.34	179,677,484	2.844	2030/6/20	1.33
29	アメリカ	社債券	PETROLEOS MEXICANOS	1,400,000	12,174.59	170,444,300	11,882.09	166,349,260	5.35	2028/2/12	1.23
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000	12,341.54	160,440,135	12,700.83	165,110,918	4.5	2029/3/15	1.22

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.85
特殊債券	2.59
社債券	16.35
合計	96.81

## (参考) A C I 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		116,963	16,418.89	1,920,403,485	17,616.28	2,060,453,542	9.06
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC		15,002	99,157.21	1,487,556,481	112,661.57	1,690,149,019	7.43
3	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC		43,589	25,505.19	1,111,745,766	27,263.91	1,188,406,991	5.22
4	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC		59,789	14,609.90	873,511,659	16,221.48	969,866,140	4.26

5	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE		20,859	42,399.42	884,409,620	41,842.66	872,796,130	3.83
6	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP		423,640	1,796.64	761,130,772	1,926.89	816,308,696	3.59
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC		65,380	10,446.52	682,994,099	11,655.74	762,052,680	3.35
8	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC		151,435	4,791.91	725,664,329	4,549.78	688,996,873	3.03
9	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC		80,960	7,420.58	600,770,821	8,142.63	659,228,005	2.89
10	アメリカ	投資証券	KITE REALTY GROUP TRUST		193,925	3,121.63	605,363,009	3,231.82	626,732,070	2.75
11	アメリカ	投資証券	TERRENO REALTY CORP		72,226	9,092.32	656,702,114	8,584.85	620,049,947	2.72
12	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC		118,187	4,845.56	572,682,885	4,948.50	584,849,398	2.57
13	アメリカ	投資証券	VENTAS INC		80,588	6,473.23	521,664,790	6,904.42	556,413,705	2.44
14	アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A		104,299	4,796.26	500,246,082	5,115.24	533,515,168	2.34
15	日本	株式	東急不動産ホールディングス	不動産業	603,600	733.06	442,478,096	823.20	496,883,520	2.18
16	カナダ	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		88,314	5,040.57	445,153,252	5,432.01	479,722,637	2.10
17	アメリカ	投資証券	UDR INC		74,767	5,902.86	441,339,194	6,217.17	464,839,239	2.04
18	アメリカ	投資証券	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		128,676	3,340.56	429,851,134	3,463.81	445,709,357	1.96
19	イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC		392,275	1,139.77	447,106,611	1,042.81	409,070,254	1.79
20	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC		10,768	33,265.05	358,198,120	33,792.81	363,881,078	1.60
21	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC		16,758	23,208.54	388,928,869	21,454.17	359,528,986	1.58
22	シンガポール	投資証券	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		1,788,879	174.31	311,823,434	175.38	313,736,461	1.37
23	シンガポール	投資証券	KEPPEL DC REIT		1,337,900	217.86	291,487,399	232.05	310,472,806	1.36
24	イギリス	投資証券	SEGRO PLC		238,359	1,489.21	354,967,321	1,300.77	310,051,309	1.36
25	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC		15,264	20,411.69	311,564,070	18,641.36	284,541,785	1.25
26	アメリカ	投資証券	AMERICOLD REALTY TRUST INC		55,997	4,593.54	257,224,548	4,639.68	259,808,161	1.14
27	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC		15,480	16,898.58	261,590,088	16,639.05	257,572,531	1.13
28	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES		30,901	7,935.41	245,212,208	8,278.92	255,827,185	1.12
29	イギリス	投資証券	BIG YELLOW GROUP PLC		130,811	2,204.54	288,379,063	1,924.63	251,763,298	1.10
30	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP		28,643	9,340.25	267,532,947	8,731.29	250,090,563	1.09

## 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	2.18
	国外	ホテル・レストラン・レジャー	1.98
		情報技術サービス	0.91
		各種電気通信サービス	0.53
投資証券			91.74
合計			97.37

## 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E S G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E S G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E S G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）A C I E S G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E S G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E S G新興国国債 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）A C I E S GグローバルR E I T 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E S G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E S G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E S G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E S G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）A C I E S G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E S G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E S G新興国国債 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）A C I E S GグローバルR E I T 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E S Gバランスファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型

2023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
第4計算期間	(2022年11月18日)	8,080	8,080	0.8823	0.8823
第5計算期間	(2023年 5月18日)	7,912	7,912	0.8802	0.8802
	2022年 6月末日	8,295		0.9092	
	7月末日	8,696		0.9490	
	8月末日	8,516		0.9325	
	9月末日	7,797		0.8511	
	10月末日	7,970		0.8703	
	11月末日	8,141		0.8908	
	12月末日	7,982		0.8801	
	2023年 1月末日	8,322		0.9175	
	2月末日	8,145		0.8973	
	3月末日	8,053		0.8851	
	4月末日	8,022		0.8885	
	5月末日	7,803		0.8705	
	6月末日	7,838		0.8864	

## 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

2023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
第4計算期間	(2022年11月18日)	77,259	77,325	1.1756	1.1766
第5計算期間	(2023年 5月18日)	77,035	77,100	1.1801	1.1811
	2022年 6月末日	78,271		1.1699	
	7月末日	81,213		1.2070	
	8月末日	80,484		1.2192	
	9月末日	75,975		1.1573	
	10月末日	80,010		1.2138	
	11月末日	77,303		1.1768	
	12月末日	73,679		1.1204	
	2023年 1月末日	76,320		1.1584	
	2月末日	77,656		1.1816	
	3月末日	75,387		1.1485	
	4月末日	76,126		1.1617	
	5月末日	76,904		1.1845	
	6月末日	78,229		1.2546	

## 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

2023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
第4特定期間	(2022年11月18日)	689	689	0.8773	0.8773
第5特定期間	(2023年 5月18日)	615	615	0.8748	0.8748
	2022年 6月末日	762		0.9039	
	7月末日	788		0.9435	
	8月末日	777		0.9270	
	9月末日	669		0.8462	
	10月末日	680		0.8653	
	11月末日	679		0.8858	

12月末日	660		0.8753
2023年 1月末日	671		0.9121
2月末日	654		0.8920
3月末日	622		0.8798
4月末日	624		0.8831
5月末日	607		0.8651
6月末日	623		0.8809

## 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

2023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
第4特定期間 (2022年11月18日)	4,594	4,608	1.1597	1.1632
第5特定期間 (2023年 5月18日)	4,523	4,536	1.1550	1.1585
2022年 6月末日	4,707		1.1620	
7月末日	4,828		1.1956	
8月末日	4,795		1.2077	
9月末日	4,537		1.1439	
10月末日	4,774		1.2000	
11月末日	4,606		1.1610	
12月末日	4,363		1.1054	
2023年 1月末日	4,512		1.1394	
2月末日	4,569		1.1623	
3月末日	4,422		1.1264	
4月末日	4,471		1.1395	
5月末日	4,513		1.1593	
6月末日	4,631		1.2279	

## 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
第4計算期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	0.0000円

第5計算期間	2022年11月19日～2023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
第4計算期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	0.0010円
第5計算期間	2022年11月19日～2023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
第4特定期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	0.0000円
第5特定期間	2022年11月19日～2023年 5月18日	0.0000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
第4特定期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	0.0095円
第5特定期間	2022年11月19日～2023年 5月18日	0.0105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%

第4計算期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	7.0%
第5計算期間	2022年11月19日～2023年 5月18日	0.2%

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E S G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%
第4計算期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	1.5%
第5計算期間	2022年11月19日～2023年 5月18日	0.5%

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E S G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%
第4特定期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	7.0%
第5特定期間	2022年11月19日～2023年 5月18日	0.3%

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E S G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%
第4特定期間	2022年 5月19日～2022年11月18日	1.6%
第5特定期間	2022年11月19日～2023年 5月18日	0.5%

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
第4計算期間	2022年5月19日～2022年11月18日	632,456,698	459,237,202	9,158,538,013
第5計算期間	2022年11月19日～2023年5月18日	342,243,870	511,706,995	8,989,074,888

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
第4計算期間	2022年5月19日～2022年11月18日	7,616,708,084	7,212,209,321	65,717,598,610
第5計算期間	2022年11月19日～2023年5月18日	3,148,840,588	3,586,690,712	65,279,748,486

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
第4特定期間	2022年5月19日～2022年11月18日	19,016,604	92,673,956	785,620,494
第5特定期間	2022年11月19日～2023年5月18日	10,163,097	91,983,461	703,800,130

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
第4特定期間	2022年5月19日～2022年11月18日	413,293,578	399,054,898	3,961,645,851

第5特定期間	2022年11月19日～2023年 5月18日	198,955,123	244,264,893	3,916,336,081
--------	-------------------------	-------------	-------------	---------------

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 >

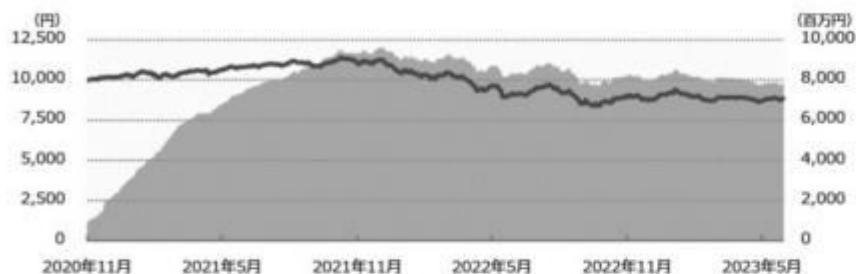


# 運用実績 (2023年6月30日現在)

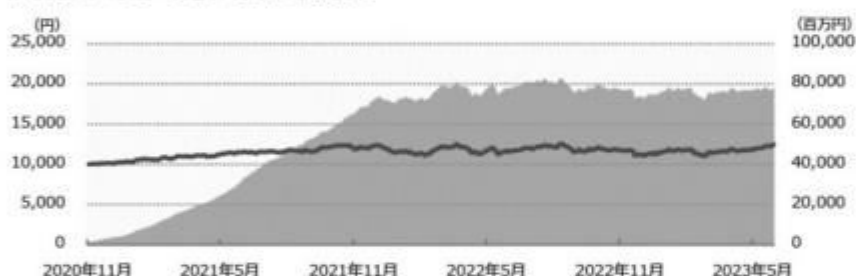
## ■ 基準価額・純資産の推移 (日次：設定来)

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） — 純資産総額（右軸）

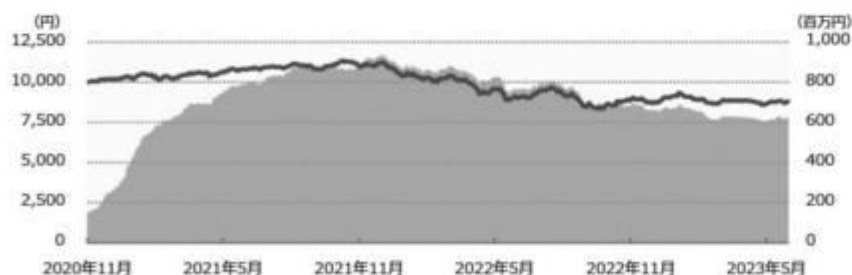
### Ⅰ（為替ヘッジあり）年2回決算型



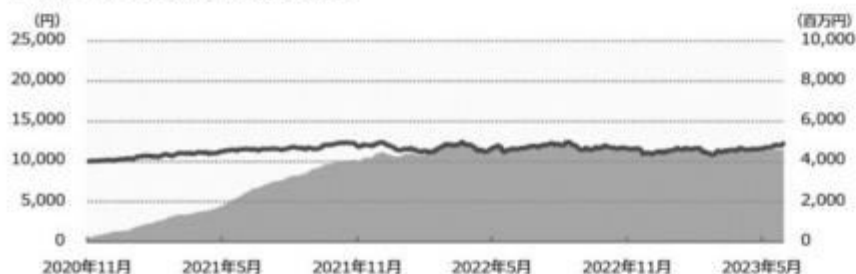
### Ⅱ（為替ヘッジなし）年2回決算型



### Ⅲ（為替ヘッジあり）隔月分配型



### Ⅳ（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）

### Ⅰ（為替ヘッジあり）年2回決算型

2023年5月	0 円
2022年11月	0 円
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

### Ⅱ（為替ヘッジなし）年2回決算型

2023年5月	10 円
2022年11月	10 円
2022年5月	10 円
2021年11月	10 円
2021年5月	10 円
設定来累計	50 円

### Ⅲ（為替ヘッジあり）隔月分配型

2023年5月	0 円
2023年3月	0 円
2023年1月	0 円
2022年11月	0 円
2022年9月	0 円
直近1年間累計	0 円
設定来累計	80 円

### Ⅳ（為替ヘッジなし）隔月分配型

2023年5月	35 円
2023年3月	35 円
2023年1月	35 円
2022年11月	35 円
2022年9月	30 円
直近1年間累計	200 円
設定来累計	350 円

## ■ 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	25.2	25.0	25.2	25.0
米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	34.6	34.4	34.6	34.4
米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド	14.8	14.7	14.8	14.7
ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	25.1	24.9	25.2	24.9

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	TOLL BROTHERS INC	家庭用耐久財	0.4	0.4	0.4	0.4
2	アシックス	その他製品	0.4	0.4	0.4	0.4
3	CLEAN HARBORS INC	商業サービス・用品	0.4	0.4	0.4	0.4
4	KINSALE CAPITAL GROUP INC	保険	0.4	0.4	0.4	0.4
5	STANTEC INC	建設・土木	0.4	0.4	0.4	0.4

・「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	HP INC	社債券	0.7	0.7	0.7	0.7
5	NXP BV/NXP FDG/NXP USA	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

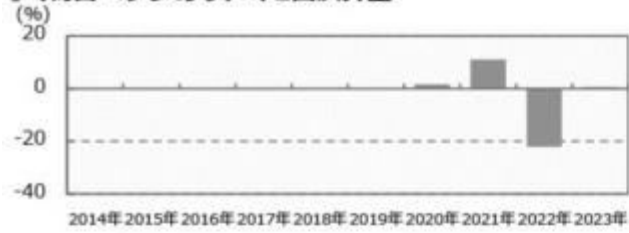
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			(為替ヘッジあり) 年2回決算型	(為替ヘッジなし) 年2回決算型	(為替ヘッジあり) 隔月分配型	(為替ヘッジなし) 隔月分配型
1	PANAMA GLOBAL	国債証券	0.6	0.6	0.6	0.6
2	PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	社債券	0.5	0.5	0.5	0.5
3	PETROLEOS MEXICANOS	社債券	0.5	0.5	0.5	0.5
4	KINGDOM OF JORDAN	国債証券	0.5	0.5	0.5	0.5
5	PERU GLOBAL	国債証券	0.4	0.4	0.4	0.4

・「ACI ESGグローバルREIT マザーファンド」を通じての投資銘柄

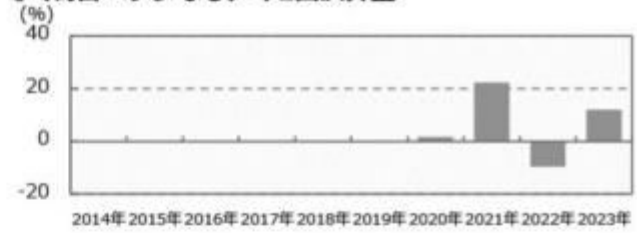
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			(為替ヘッジあり) 年2回決算型	(為替ヘッジなし) 年2回決算型	(為替ヘッジあり) 隔月分配型	(為替ヘッジなし) 隔月分配型
1	PROLOGIS INC	投資証券	2.3	2.3	2.3	2.3
2	EQUINIX INC	投資証券	1.9	1.8	1.9	1.8
3	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	1.3	1.3	1.3	1.3
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	1.1	1.1	1.1	1.1
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	1.0	1.0	1.0	1.0

## ■ 年間収益率の推移 （暦年ベース）

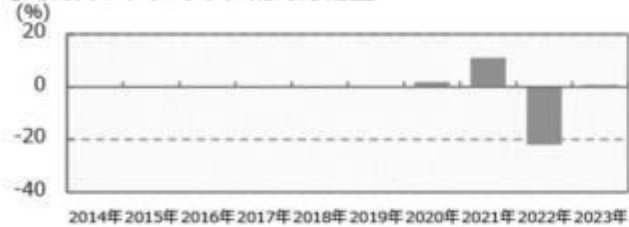
### Ⅰ（為替ヘッジあり）年2回決算型



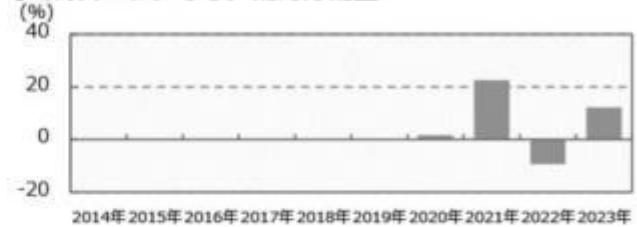
### Ⅱ（為替ヘッジなし）年2回決算型



### Ⅲ（為替ヘッジあり）隔月分配型



### Ⅳ（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。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2020年は設定日（2020年11月30日）から年末までの収益率。
- ・2023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2【管理及び運営】

### 3 資産管理等の概要

#### （3）信託期間

## &lt;訂正前&gt;

2030年11月18日までとします（2020年11月30日設定）。

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

## &lt;訂正後&gt;

無期限とします（2020年11月30日設定）。

## (5) その他

## &lt;更新後&gt;

## (a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより各ファンドにつき受益権の口数が30億口を下回った場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

## (b) 信託期間の終了

( ) 委託者は、上記「(a) ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

( ) 上記( )の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行いません。

( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記( )から( )までに規定するこの信託契約の解約の手続を行なうことが困難な場合には適用しません。

( ) 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

( ) 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記

「(d) 信託約款の変更等」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c) 運用報告書

各ファンドにつき、毎年5月、11月に終了する計算期間の末日および償還時に交付運用報告書を作成し、知れている受益者に対して交付します。

(d) 信託約款の変更等

( ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

( ) 委託者は、上記( )の事項(上記( )の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

( ) 上記( )の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

( ) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

( ) 上記( )から( )の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nomura-am.co.jp/>

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

( ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d) 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはでき

ないものとしてします。

( ) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

- 1.他の受益者の氏名または名称および住所
- 2.他の受益者が有する受益権の内容

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

委託者と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から別段の意思表示のないときは、原則1年毎に自動的に更新されるものとしてします。

なお、運用の外部委託を行う場合は、委託者と運用の委託先との間で締結する「運用指図に関する権限の委託契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から更新しない旨を書面によって通知がない限り、1年毎に自動的に更新されるものとしてします。但し、当該契約はファンドの償還日に終了するものとしてします。

(j) 有価証券報告書

委託者は、有価証券報告書を毎年5月、11月の決算日を基準に作成し3ヵ月以内に関東財務局長に提出します。



## 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5期計算期間(2022年11月19日から2023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(2022年11月19日から2023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4期 (2022年11月18日現在)	第5期 (2023年 5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	159,248,663	199,433,395
親投資信託受益証券	7,636,335,588	7,914,518,632
派生商品評価勘定	126,318	-
未収入金	405,038,959	84,400,000
流動資産合計	8,200,749,528	8,198,352,027
資産合計	8,200,749,528	8,198,352,027
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,798,008	196,504,386
未払金	381,458	6,977,101
未払解約金	14,109,136	13,643,204
未払受託者報酬	2,305,039	2,215,525
未払委託者報酬	69,150,892	66,465,828
未払利息	246	209
その他未払費用	138,243	132,874
流動負債合計	119,883,022	285,939,127
負債合計	119,883,022	285,939,127
純資産の部		

	第4期 (2022年11月18日現在)	第5期 (2023年 5月18日現在)
元本等		
元本	9,158,538,013	8,989,074,888
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,077,671,507	1,076,661,988
（分配準備積立金）	676,685,969	700,826,025
元本等合計	8,080,866,506	7,912,412,900
純資産合計	8,080,866,506	7,912,412,900
負債純資産合計	8,200,749,528	8,198,352,027

## ( 2 ) 損益及び剰余金計算書

( 単位：円 )

	第4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
営業収益		
受取利息	-	15
有価証券売買等損益	234,435,857	132,983,044
為替差損益	766,262,973	82,864,651
営業収益合計	531,827,116	50,118,408
営業費用		
支払利息	34,087	22,007
受託者報酬	2,305,039	2,215,525
委託者報酬	69,150,892	66,465,828
その他費用	138,243	138,814
営業費用合計	71,628,261	68,842,174
営業利益又は営業損失（ ）	603,455,377	18,723,766
経常利益又は経常損失（ ）	603,455,377	18,723,766
当期純利益又は当期純損失（ ）	603,455,377	18,723,766
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（ ）	16,760,685	4,965,548
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	462,024,512	1,077,671,507
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,891,264	61,091,169
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,891,264	61,091,169
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,843,567	36,392,336
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	53,843,567	36,392,336
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,077,671,507	1,076,661,988

## ( 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、2022年11月19日から2023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4期 2022年11月18日現在	第5期 2023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 9,158,538,013口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 8,989,074,888口
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 1,077,671,507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 1,076,661,988円
3. 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 0.8823円 (10,000口当たり純資産額) (8,823円)	3. 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 0.8802円 (10,000口当たり純資産額) (8,802円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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 80,567,855円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 51,232,059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 70,905,893円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 11,862,544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	58,831,890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	247,728,774円
分配準備積立金額	D	617,854,079円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	924,414,743円
当ファンドの期末残存口数	F	9,158,538,013口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,009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

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 76,304,747円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 48,935,334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 67,012,719円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 11,242,370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	60,238,221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	268,316,348円
分配準備積立金額	D	640,587,804円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	969,142,373円
当ファンドの期末残存口数	F	8,989,074,888口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,078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4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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4期 2022年11月18日現在	第5期 2023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4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
期首元本額 8,985,318,517円	期首元本額 9,158,538,013円
期中追加設定元本額 632,456,698円	期中追加設定元本額 342,243,870円
期中一部解約元本額 459,237,202円	期中一部解約元本額 511,706,995円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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	141,005,733	133,135,362
合計	141,005,733	133,135,362

## 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4期(2022年11月18日現在)				第5期(2023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	7,082,229,766	-	7,115,901,456	33,671,690	7,134,536,947	-	7,331,041,333	196,504,386
米ドル	6,217,704,907	-	6,247,848,090	30,143,183	6,222,429,876	-	6,398,123,731	175,693,855
カナダドル	165,416,342	-	166,603,260	1,186,918	154,552,869	-	158,240,728	3,687,859
メキシコペソ	9,027,216	-	9,022,998	4,218	16,051,956	-	16,821,757	769,801

ユーロ	177,606,738	-	178,453,565	846,827	215,634,466	-	218,912,369	3,277,903
英ポンド	126,667,889	-	127,412,610	744,721	169,012,672	-	174,763,114	5,750,442
スイスフラン	649,240	-	648,274	966	-	-	-	-
スウェーデンクローナ	37,401,277	-	37,317,237	84,040	38,867,451	-	39,451,881	584,430
ノルウェークローネ	27,000,870	-	26,963,776	37,094	16,771,129	-	16,807,293	36,164
デンマーククローネ	-	-	-	-	5,459,733	-	5,544,792	85,059
豪ドル	189,684,289	-	189,962,760	278,471	147,379,736	-	150,001,158	2,621,422
香港ドル	75,536,320	-	75,895,638	359,318	101,225,484	-	104,236,405	3,010,921
シンガポールドル	55,534,678	-	55,773,248	238,570	47,151,575	-	48,138,105	986,530
合計	7,082,229,766	-	7,115,901,456	33,671,690	7,134,536,947	-	7,331,041,333	196,504,386

## (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(2023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(2023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	1,632,227,288	2,003,722,218	
		A C I E S G グローバル R E I T マザーファンド	1,406,525,087	1,963,930,978	

	米ドル建てESG先進国社債マ ザーファンド	2,431,290,469	2,761,216,585	
	米ドル建てESG新興国国債マ ザーファンド	980,118,088	1,185,648,851	
小計	銘柄数：4 組入時価比率：100.0%	6,450,160,932	7,914,518,632	100.0%
合計			7,914,518,632	

(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4期 (2022年11月18日現在)	第5期 (2023年 5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,744,282,424	1,644,142,313
親投資信託受益証券	76,446,403,276	76,226,328,688
未収入金	85,300,000	37,000,000
流動資産合計	78,275,985,700	77,907,471,001
資産合計	78,275,985,700	77,907,471,001
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	65,717,598	65,279,748
未払解約金	271,749,198	162,747,820
未払受託者報酬	21,848,498	20,736,202
未払委託者報酬	655,454,941	622,085,925
未払利息	2,701	1,729
その他未払費用	1,310,850	1,244,119
流動負債合計	1,016,083,786	872,095,543
負債合計	1,016,083,786	872,095,543
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	65,717,598,610	65,279,748,486
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,542,303,304	11,755,626,972
（分配準備積立金）	5,051,562,044	5,308,037,243
元本等合計	77,259,901,914	77,035,375,458
純資産合計	77,259,901,914	77,035,375,458
負債純資産合計	78,275,985,700	77,907,471,001

#### （2）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
営業収益		
受取利息	-	155



	第4期	第5期
	自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
有価証券売買等損益	1,962,098,884	1,005,525,412
営業収益合計	1,962,098,884	1,005,525,567
営業費用		
支払利息	207,600	185,650
受託者報酬	21,848,498	20,736,202
委託者報酬	655,454,941	622,085,925
その他費用	1,310,850	1,244,119
営業費用合計	678,821,889	644,251,896
営業利益又は営業損失（ ）	1,283,276,995	361,273,671
経常利益又は経常損失（ ）	1,283,276,995	361,273,671
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,283,276,995	361,273,671
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（ ）	350,395,830	43,193,299
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	10,388,236,898	11,542,303,304
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,430,316,884	490,917,050
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,430,316,884	490,917,050
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,143,414,045	616,780,604
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,143,414,045	616,780,604
分配金	65,717,598	65,279,748
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,542,303,304	11,755,626,972

## ( 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、2022年11月19日から2023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4期 2022年11月18日現在	第5期 2023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 65,717,598,610口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 65,279,748,486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 1口当たり純資産額 1.1756円 (10,000口当たり純資産額) (11,756円)	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 1.1801円 (10,000口当たり純資産額) (11,801円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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 80,567,855円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 51,232,059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 70,905,893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 11,862,544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>718,371,879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>6,490,741,260円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,398,907,763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>11,608,020,902円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>65,717,598,610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>1,766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>65,717,598円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	718,371,879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	6,490,741,260円	分配準備積立金額	D	4,398,907,763円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,608,020,902円	当ファンドの期末残存口数	F	65,717,598,610口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,766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	65,717,598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 76,304,747円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 48,935,334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 67,012,719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 11,242,370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>578,935,735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>6,447,589,729円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,794,381,256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>11,820,906,720円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>65,279,748,486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>1,810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>65,279,748円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	578,935,735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	6,447,589,729円	分配準備積立金額	D	4,794,381,256円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,820,906,720円	当ファンドの期末残存口数	F	65,279,748,486口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,810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	65,279,748円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	718,371,879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	6,490,741,260円																																																											
分配準備積立金額	D	4,398,907,763円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,608,020,902円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	65,717,598,610口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,766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	65,717,598円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	578,935,735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	6,447,589,729円																																																											
分配準備積立金額	D	4,794,381,256円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,820,906,720円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	65,279,748,486口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,810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	65,279,748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4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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、(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>1.金融商品に対する取組方針 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4期 2022年11月18日現在	第5期 2023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4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日		
期首元本額	65,313,099,847円	期首元本額	65,717,598,610円
期中追加設定元本額	7,616,708,084円	期中追加設定元本額	3,148,840,588円
期中一部解約元本額	7,212,209,321円	期中一部解約元本額	3,586,690,712円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第4期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	第5期 自 2022年11月19日 至 2023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	1,715,549,101	997,982,260
合計	1,715,549,101	997,982,260

## 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(2023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(2023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	15,469,380,376	18,990,211,349	
		A C I E S G グローバル R E I T マザーファンド	13,487,399,163	18,832,455,451	
		米ドル建て E S G 先進国社債 マザーファンド	23,646,249,329	26,855,045,362	
		米ドル建て E S G 新興国国債 マザーファンド	9,546,678,124	11,548,616,526	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：98.9%	62,149,706,992	76,226,328,688	100.0%
合計				76,226,328,688	

(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 E S G 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 (2022年11月18日現在)	当期 (2023年 5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,176,210	11,239,807
親投資信託受益証券	651,257,025	615,847,543
派生商品評価勘定	10,693	-
未収入金	35,389,318	7,240,000
流動資産合計	694,833,246	634,327,350
資産合計		
	694,833,246	634,327,350
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,882,984	15,311,824
未払金	26,595	543,007
未払解約金	816,576	1,055,270
未払受託者報酬	60,595	55,208
未払委託者報酬	1,817,810	1,656,235
未払利息	12	11
その他未払費用	3,614	3,292
流動負債合計	5,608,186	18,624,847
負債合計		
	5,608,186	18,624,847
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	785,620,494	703,800,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	96,395,434	88,097,627
（分配準備積立金）	62,890,483	62,889,170
元本等合計	689,225,060	615,702,503
純資産合計		
	689,225,060	615,702,503
負債純資産合計		
	694,833,246	634,327,350

### （2）損益及び剰余金計算書

	前期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	22,472,835	9,860,518
為替差損益	71,814,645	5,670,444
営業収益合計	49,341,810	4,190,074
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,658	1,637
受託者報酬	208,012	177,707
委託者報酬	6,240,328	5,331,158
その他費用	12,420	16,541
営業費用合計	6,463,418	5,527,043
営業利益又は営業損失（ ）	55,805,228	1,336,969
経常利益又は経常損失（ ）	55,805,228	1,336,969
当期純利益又は当期純損失（ ）	55,805,228	1,336,969
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（ ）	1,199,255	352,593
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	48,691,472	96,395,434
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,464,960	10,336,339
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,464,960	10,336,339
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,562,949	1,054,156
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,562,949	1,054,156
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	96,395,434	88,097,627

## ( 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、2022年11月19日から2023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 2022年11月18日現在	当期 2023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 785,620,494口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 703,800,130口
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 96,395,434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 88,097,627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 0.8773円 (10,000口当たり純資産額) (8,773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 0.8748円 (10,000口当たり純資産額) (8,748円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023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 80,567,855円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 51,232,059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 70,905,893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 11,862,544円</p>	<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 76,304,747円</p> <p>ACI ESGグローバルREIT マザーファンド 支払金額 48,935,334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 67,012,719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 11,242,370円</p>																														
<p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2022年 5月19日から2022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>1,832,485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>24,623,450円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>63,025,072円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,832,485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	24,623,450円	分配準備積立金額	D	63,025,072円	<p>2. 分配金の計算過程</p> <p>2022年11月19日から2023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>3,313,850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>22,802,681円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>59,444,360円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,313,850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	22,802,681円	分配準備積立金額	D	59,444,360円
項目																															
費用控除後の配当等収益額	A	1,832,485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	24,623,450円																													
分配準備積立金額	D	63,025,072円																													
項目																															
費用控除後の配当等収益額	A	3,313,850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	22,802,681円																													
分配準備積立金額	D	59,444,360円																													

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	89,481,007円
当ファンドの期末残存口数	F	843,736,101口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,060円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	I=F × H/10,000	0円

2022年 7月20日から2022年 9月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,009,407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	25,122,332円
分配準備積立金額	D	63,689,615円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	90,821,354円
当ファンドの期末残存口数	F	836,975,000口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,085円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	I=F × H/10,000	0円

2022年 9月21日から2022年11月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,388,825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	23,892,362円
分配準備積立金額	D	61,501,658円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	86,782,845円
当ファンドの期末残存口数	F	785,620,494口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,104円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	I=F × H/10,000	0円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	85,560,891円
当ファンドの期末残存口数	F	743,645,513口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,150円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	I=F × H/10,000	0円

2023年 1月19日から2023年 3月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,506,066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	22,179,574円
分配準備積立金額	D	59,285,069円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	82,970,709円
当ファンドの期末残存口数	F	707,174,708口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,173円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	I=F × H/10,000	0円

2023年 3月21日から2023年 5月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,533,616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	22,231,330円
分配準備積立金額	D	60,355,554円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	85,120,500円
当ファンドの期末残存口数	F	703,800,130口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,209円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	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 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023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
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	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。</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っております。</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 2022年11月18日現在</p>	<p>当期 2023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ぬ。</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</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 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 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023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 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
期首元本額 859,277,846円	期首元本額 785,620,494円
期中追加設定元本額 19,016,604円	期中追加設定元本額 10,163,097円
期中一部解約元本額 92,673,956円	期中一部解約元本額 91,983,461円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	前期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023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	22,083,016	32,711,874
合計	22,083,016	32,711,874

## 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(2022年11月18日現在)				当期(2023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	603,899,990	-	606,772,281	2,872,291	555,323,694	-	570,635,518	15,311,824
米ドル	530,482,683	-	533,054,690	2,572,007	484,373,682	-	498,074,822	13,701,140
カナダドル	14,175,565	-	14,277,280	101,715	11,973,108	-	12,258,804	285,696
メキシコペソ	771,923	-	771,562	361	1,249,644	-	1,310,783	61,139
ユーロ	15,182,534	-	15,254,925	72,391	16,741,252	-	16,996,530	255,278

英ポンド	10,682,435	-	10,745,241	62,806	13,075,372	-	13,510,665	435,293
スウェーデンクローナ	3,190,303	-	3,183,135	7,168	3,018,126	-	3,063,508	45,382
ノルウェークローネ	2,303,260	-	2,300,096	3,164	1,299,883	-	1,302,693	2,810
デンマーククローネ	-	-	-	-	413,914	-	420,363	6,449
豪ドル	16,040,762	-	16,064,405	23,643	11,695,905	-	11,904,852	208,947
香港ドル	6,408,761	-	6,439,251	30,490	7,871,198	-	8,105,324	234,126
シンガポールドル	4,661,764	-	4,681,696	19,932	3,611,610	-	3,687,174	75,564
合計	603,899,990	-	606,772,281	2,872,291	555,323,694	-	570,635,518	15,311,824

## (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(2023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(2023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	126,884,847	155,763,838	
		ACI ESGグローバルREITマザーファンド	109,427,974	152,794,280	
		米ドル建てESG先進国社債マザーファンド	189,290,749	214,977,503	
		米ドル建てESG新興国国債マザーファンド	76,309,765	92,311,922	
	小計	銘柄数: 4	501,913,335	615,847,543	

	組入時価比率：100.0%	100.0%
合計		615,847,543

(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 (2022年11月18日現在)	当期 (2023年 5月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	83,309,801	72,502,852
親投資信託受益証券	4,546,641,661	4,476,809,670
未収入金	-	7,180,000
流動資産合計	4,629,951,462	4,556,492,522
<b>資産合計</b>	4,629,951,462	4,556,492,522
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	13,865,760	13,707,176
未払解約金	8,824,905	7,287,275
未払受託者報酬	412,460	394,020
未払委託者報酬	12,373,877	11,820,611
未払利息	129	76
その他未払費用	24,728	23,625
流動負債合計	35,501,859	33,232,783
<b>負債合計</b>	35,501,859	33,232,783
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,961,645,851	3,916,336,081
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	632,803,752	606,923,658
（分配準備積立金）	309,534,511	295,761,165
元本等合計	4,594,449,603	4,523,259,739
<b>純資産合計</b>	4,594,449,603	4,523,259,739
<b>負債純資産合計</b>	4,629,951,462	4,556,492,522

#### （2）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	前期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	5
有価証券売買等損益	123,864,741	59,968,009
営業収益合計	123,864,741	59,968,014
<b>営業費用</b>		
支払利息	9,617	8,947
受託者報酬	1,306,668	1,222,965

	前期	当期
	自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
委託者報酬	39,199,955	36,688,843
その他費用	78,336	73,321
営業費用合計	40,594,576	37,994,076
営業利益又は営業損失（ ）	83,270,165	21,973,938
経常利益又は経常損失（ ）	83,270,165	21,973,938
当期純利益又は当期純損失（ ）	83,270,165	21,973,938
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（ ）	9,527,361	2,800,068
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	594,437,940	632,803,752
剰余金増加額又は欠損金減少額	72,243,569	26,075,866
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	72,243,569	26,075,866
剰余金減少額又は欠損金増加額	69,820,035	29,853,413
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	69,820,035	29,853,413
分配金	37,800,526	41,276,417
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	632,803,752	606,923,658

## (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、2022年11月19日から2023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 2022年11月18日現在	当期 2023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 3,961,645,851口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 3,916,336,081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 1.1597円 (10,000口当たり純資産額) (11,597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 1.1550円 (10,000口当たり純資産額) (11,550円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日

## 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 80,567,855円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 51,232,059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 70,905,893円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 11,862,544円

## 2. 分配金の計算過程

2022年 5月19日から2022年 7月19日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	22,335,064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	388,141,163円
分配準備積立金額	D	319,158,006円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	729,634,233円
当ファンドの期末残存口数	F	4,069,184,507口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,793円
10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	12,207,553円

2022年 7月20日から2022年 9月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	23,802,743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	486,184,998円
分配準備積立金額	D	306,792,958円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	816,780,699円
当ファンドの期末残存口数	F	3,909,071,264口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,089円

## 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 76,304,747円

ACI ESGグローバルREIT マザーファンド

支払金額 48,935,334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 67,012,719円

米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド

支払金額 11,242,370円

## 2. 分配金の計算過程

2022年11月19日から2023年 1月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	12,096,759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	401,428,326円
分配準備積立金額	D	305,189,730円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	718,714,815円
当ファンドの期末残存口数	F	3,950,860,556口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,819円
10,000口当たり分配金額	H	35円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	13,828,011円

2023年 1月19日から2023年 3月20日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,109,246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	403,192,780円
分配準備積立金額	D	297,599,608円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	711,901,634円
当ファンドの期末残存口数	F	3,926,065,938口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,813円

10,000口当たり分配金額	H	30円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	11,727,213円

2022年 9月21日から2022年11月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	9,908,944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	398,709,261円
分配準備積立金額	D	313,491,327円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	722,109,532円
当ファンドの期末残存口数	F	3,961,645,851口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,822円
10,000口当たり分配金額	H	35円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	13,865,760円

10,000口当たり分配金額	H	35円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	13,741,230円

2023年 3月21日から2023年 5月18日まで

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	22,119,482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	409,546,089円
分配準備積立金額	D	287,348,859円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	719,014,430円
当ファンドの期末残存口数	F	3,916,336,081口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,835円
10,000口当たり分配金額	H	35円
収益分配金額	$I=F \times H / 10,000$	13,707,176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 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023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 2022年11月18日現在	当期 2023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 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023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 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023年 5月18日
期首元本額	3,947,407,171円
期首元本額	3,961,645,851円



期中追加設定元本額	413,293,578円	期中追加設定元本額	198,955,123円
期中一部解約元本額	399,054,898円	期中一部解約元本額	244,264,893円

## 2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	前期 自 2022年 5月19日 至 2022年11月18日	当期 自 2022年11月19日 至 2023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	152,399,676	240,922,703
合計	152,399,676	240,922,703

## 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(2023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(2023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	917,179,622	1,125,929,703	
		A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド	793,781,444	1,108,357,030	
		米ドル建てE S G先進国社債 マザーファンド	1,381,335,632	1,568,782,877	
		米ドル建てE S G新興国国債 マザーファンド	556,948,054	673,740,060	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：99.0%	3,649,244,752	4,476,809,670 100.0%	
合計				4,476,809,670	

(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）	
(2023年 5月18日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	247,783,726
コール・ローン	345,518,291
株式	20,288,804,257
投資信託受益証券	321,239,765
投資証券	1,124,572,078
派生商品評価勘定	231,393
未収入金	239,658,550
未収配当金	24,691,728
流動資産合計	22,592,499,788
資産合計	22,592,499,788
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	217,967
未払金	294,277,615
未払解約金	22,800,000
未払利息	363
流動負債合計	317,295,945
負債合計	317,295,945
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	18,145,672,133
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,129,531,710
元本等合計	22,275,203,843
純資産合計	22,275,203,843
負債純資産合計	22,592,499,788

## 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	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。 投資信託受益証券
-------------------	---

	<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）

2023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	1.2276円
(10,000口当たり純資産額)	(12,276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 2022年11月19日 至 2023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

2023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

2023年 5月18日現在

期首	2022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	18,138,420,397円
同期中における追加設定元本額	1,004,556,352円
同期中における一部解約元本額	997,304,616円
期末元本額	18,145,672,133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	1,632,227,288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	15,469,380,376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	126,884,847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

917,179,622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(2023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	東洋水産	29,600	5,700.00	168,720,000	
		ゴールドウイン	9,000	13,290.00	119,610,000	
		太陽誘電	41,200	4,065.00	167,478,000	
		アシックス	84,800	4,100.00	347,680,000	
		J M D C	33,300	5,760.00	191,808,000	
		マツキヨココカラ&カンパニー	21,100	7,760.00	163,736,000	
		三越伊勢丹ホールディングス	153,600	1,515.00	232,704,000	
		日本瓦斯	51,000	2,067.00	105,417,000	
		ふくおかフィナンシャルグループ	33,600	2,701.00	90,753,600	
		日本空港ビルデング	25,700	7,060.00	181,442,000	
		テクノプロ・ホールディングス	33,000	3,315.00	109,395,000	
		ベイカレント・コンサルティング	24,000	5,280.00	126,720,000	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：9.0%			2,005,463,600 9.9%	
	米ドル	TRANSOCEAN LTD	246,178	5.89	1,449,988.42	
		WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	25,639	57.83	1,482,703.37	
		ANTERO RESOURCES CORP	46,832	21.84	1,022,810.88	
		GOLAR LNG LTD	36,608	21.86	800,250.88	
		KOSMOS ENERGY LTD	59,218	6.24	369,520.32	
		INGEVITY CORP	7,397	53.30	394,260.10	
		SUMMIT MATERIALS INC -CL A	46,844	31.94	1,496,197.36	
		GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO	48,252	25.77	1,243,454.04	
		O-I GLASS INC	73,441	21.48	1,577,512.68	
		ATI INC	46,123	36.34	1,676,109.82	
COMMERCIAL METALS CO		26,235	45.11	1,183,460.85		
SIGMA LITHIUM CORP	19,526	42.40	827,902.40			

AZEK CO INC/THE	52,441	24.78	1,299,487.98
HAYWARD HOLDINGS INC	66,448	11.82	785,415.36
JELD-WEN HOLDING INC	63,176	14.62	923,633.12
TREX COMPANY INC	13,900	57.11	793,829.00
CONSTRUCTION PARTNERS INC-A	31,970	28.50	911,145.00
EVOQUA WATER TECHNOLOGIES CO	6,484	49.09	318,299.56
H&E EQUIPMENT SERVICES INC	39,000	37.00	1,443,000.00
NOW INC/DE	112,740	9.33	1,051,864.20
CLEAN HARBORS INC	17,447	141.50	2,468,750.50
DRIVEN BRANDS HOLDINGS INC	47,015	27.63	1,299,024.45
HEALTHCARE SERVICES GROUP	48,736	14.72	717,393.92
GXO LOGISTICS INC	26,961	59.03	1,591,507.83
XPO INC	16,796	47.12	791,427.52
TOLL BROTHERS INC	26,714	65.83	1,758,582.62
CROCS INC	17,761	116.67	2,072,175.87
BLOOMIN BRANDS INC	32,801	25.15	824,945.15
BOWLERO CORP	112,441	14.06	1,580,920.46
PLANET FITNESS INC - CL A	11,410	69.86	797,102.60
OLLIE S BARGAIN OUTLET HOLDI	19,952	67.16	1,339,976.32
BJ'S WHOLESALE CLUB HOLDINGS	15,822	71.35	1,128,899.70
MGP INGREDIENTS INC	9,379	101.74	954,219.46
ELF BEAUTY INC	19,793	90.14	1,784,141.02
INTER PARFUMS INC	9,829	134.80	1,324,949.20
ALPHATEC HOLDINGS INC	31,733	15.26	484,245.58
INMODE LTD	30,909	32.98	1,019,378.82
SILK ROAD MEDICAL INC	21,526	32.67	703,254.42
ENSIGN GROUP INC/THE	12,308	91.29	1,123,597.32
HEALTH EQUITY INC	20,470	56.66	1,159,830.20
OPTION CARE HEALTH INC	11,836	28.19	333,656.84
R1 RCM INC	82,640	16.77	1,385,872.80
RADNET INC	71,554	27.83	1,991,347.82
ADMA BIOLOGICS INC	121,723	4.11	500,281.53
AVID BIOSERVICES INC	41,200	15.21	626,652.00
NATERA INC	20,553	49.64	1,020,250.92
HARMONY BIOSCIENCES HOLDINGS	22,326	35.53	793,242.78

	SCPHARMACEUTICALS INC	39,839	11.27	448,985.53	
	BANCORP INC/THE	9,236	32.01	295,644.36	
	COMMERCE BANCSHARES INC	12,939	50.17	649,149.63	
	SOUTHSTATE CORP	6,016	64.47	387,851.52	
	WINTRUST FINANCIAL CORP	5,621	65.78	369,749.38	
	SHIFT4 PAYMENTS INC-CLASS A	12,589	64.82	816,018.98	
	BRP GROUP INC-A	24,789	21.60	535,442.40	
	KINSALE CAPITAL GROUP INC	6,545	322.59	2,111,351.55	
	RLI CORP	8,280	129.23	1,070,024.40	
	GUIDEWIRE SOFTWARE INC	10,363	80.42	833,392.46	
	MANHATTAN ASSOCIATES, INC.	9,479	172.20	1,632,283.80	
	SPS COMMERCE INC	10,272	157.99	1,622,873.28	
	TENABLE HOLDINGS INC	32,172	38.22	1,229,613.84	
	CIENA CORPORATION	16,383	44.50	729,043.50	
	PURE STORAGE INC - CLASS A	33,954	24.05	816,593.70	
	JABIL INC	10,629	82.75	879,549.75	
	LITTELFUSE INC	4,088	266.26	1,088,470.88	
	NATIONAL INSTRUMENTS CORP	5,442	57.95	315,363.90	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	17,885	81.72	1,461,562.20	
	NOVA LTD	8,450	97.14	820,833.00	
	ONTO INNOVATION INC	10,629	97.95	1,041,110.55	
	POWER INTEGRATIONS INC	10,207	81.94	836,361.58	
	BROOKFIELD INFRASTRUCTURE-A	28,700	46.70	1,340,290.00	
	HAMILTON LANE INC-CLASS A	11,856	66.41	787,356.96	
	EVOLENT HEALTH INC-A	59,279	34.04	2,017,857.16	
	HURON CONSULTING GROUP INC	10,535	80.37	846,697.95	
	WNS HOLDINGS LTD-ADR	25,919	71.65	1,857,096.35	
	KANZHUN LTD	8,858	17.80	157,672.40	
小計	銘柄数：75			79,624,714.00	
				(10,957,953,140)	
	組入時価比率：49.2%			54.0%	
カナダドル	CAPSTONE COPPER CORP	386,476	5.95	2,299,532.20	
	STANTEC INC	37,722	78.62	2,965,703.64	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	118,489	20.38	2,414,805.82	
	KINAXIS INC	9,998	182.48	1,824,435.04	

	FIRSTSERVICE CORP	13,716	198.90	2,728,112.40	
小計	銘柄数：5			12,232,589.10	
	組入時価比率：5.6%			(1,250,782,235)	6.2%
メキシコペソ	GENTERA SAB DE CV	896,286	19.78	17,728,537.08	
	CORP INMOBILIARIA VESTA SAB	126,439	56.49	7,142,539.11	
小計	銘柄数：2			24,871,076.19	
	組入時価比率：0.9%			(194,556,480)	1.0%
リアル	TOTVS SA	204,400	28.64	5,854,016.00	
小計	銘柄数：1			5,854,016.00	
	組入時価比率：0.7%			(163,065,371)	0.8%
ユーロ	NEXANS SA	5,684	77.05	437,952.20	
	INTERPUMP GROUP SPA	24,620	51.52	1,268,422.40	
	KION GROUP AG	28,363	34.63	982,210.69	
	METSO CORPORATION	133,112	10.51	1,399,672.68	
	VALMET OYJ	12,325	29.83	367,654.75	
	SPIE SA	53,150	28.70	1,525,405.00	
	CIE AUTOMOTIVE SA	31,577	28.00	884,156.00	
	BASIC-FIT NV	34,343	38.04	1,306,407.72	
	D' IETEREN GROUP	8,904	164.50	1,464,708.00	
	AIB GROUP PLC	383,535	3.97	1,523,401.02	
	BPER BANCA	477,500	2.67	1,274,925.00	
	AIXTRON SE	39,557	27.31	1,080,301.67	
	SMA SOLAR TECHNOLOGY AG	7,272	103.40	751,924.80	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	12,667	59.90	758,753.30	
小計	銘柄数：14			15,025,895.23	
	組入時価比率：10.1%			(2,241,713,309)	11.0%
英ポンド	QINETIQ GROUP PLC	255,948	3.72	952,638.45	
	ROTORK PLC	360,828	3.30	1,191,454.05	
	INTERMEDIATE CAPITAL GROUP	54,641	12.85	702,410.05	
小計	銘柄数：3			2,846,502.55	
	組入時価比率：2.2%			(489,114,533)	2.4%



スウェーデンク ローナ	TRELLEBORG AB-B SHS	56,859	256.30	14,572,961.70		
	FORTNOX AB	176,157	74.92	13,197,682.44		
	NORDNET AB PUBL	58,567	154.20	9,031,031.40		
	小計	銘柄数：3		36,801,675.54	(484,678,066)	2.4%
	組入時価比率：2.2%					
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	445,873	36.80	16,408,126.40		
	小計	銘柄数：1		16,408,126.40	(209,695,855)	1.0%
	組入時価比率：0.9%					
デンマークク ローネ	TORM PLC-A	17,817	185.20	3,299,708.40		
	小計	銘柄数：1		3,299,708.40	(66,093,159)	0.3%
	組入時価比率：0.3%					
豪ドル	PINNACLE INVESTMENT MANAGEMENT GROUP LTD	153,193	8.88	1,360,353.84		
	IDP EDUCATION LTD	44,323	26.99	1,196,277.77		
	CARSALES.COM LTD	89,174	23.44	2,090,238.56		
	小計	銘柄数：3		4,646,870.17	(425,885,651)	2.1%
	組入時価比率：1.9%					
香港ドル	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	1,814,000	3.55	6,439,700.00		
	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	816,000	22.20	18,115,200.00		
	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	703,600	15.32	10,779,152.00		
	POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	199,800	40.50	8,091,900.00		
	小計	銘柄数：4		43,425,952.00	(763,428,236)	3.8%
	組入時価比率：3.4%					
ウォン	JYP ENTERTAINMENT CORP	24,687	119,500.00	2,950,096,500.00		
	小計	銘柄数：1		2,950,096,500.00	(304,744,968)	1.5%
	組入時価比率：1.4%					
新台湾ドル	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	50,928	1,065.00	54,238,320.00		
	POYA CO LTD	49,000	560.00	27,440,000.00		
	WIWYNN CORP	24,000	1,065.00	25,560,000.00		

		LOTES CO LTD	33,000	903.00	29,799,000.00	
		ASPEED TECHNOLOGY INC	9,600	2,805.00	26,928,000.00	
	小計	銘柄数：5			163,965,320.00	
					(731,629,654)	
		組入時価比率：3.3%			3.6%	
	合計				20,288,804,257	
					(18,283,340,657)	

(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。

(2)株式以外の有価証券(2023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	35,156	1,193,194.64		
		SCHWAB US SMALL-CAP ETF	27,790	1,141,057.40		
	小計	銘柄数：2	62,946	2,334,252.04		
				(321,239,765)		
		組入時価比率：1.4%		22.2%		
	合計			321,239,765		
				(321,239,765)		
投資証券	日本円	インヴィンシブル投資法人 投資証券	4,045	232,992,000		
		小計	銘柄数：1	4,045	232,992,000	
					16.1%	
	米ドル	HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	40,990	1,058,361.80		
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,470	1,920,086.00		
		TERRENO REALTY CORP	6,389	395,479.10		
		小計	銘柄数：3	67,849	3,373,926.90	
				(464,319,819)		
		組入時価比率：2.1%		32.1%		
	カナダドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	37,867	2,346,239.32		
小計		銘柄数：1	37,867	2,346,239.32		
				(239,902,970)		
	組入時価比率：1.1%		16.6%			
英ポンド	TRITAX BIG BOX REIT PLC	739,230	1,090,364.25			

小計	銘柄数：1	739,230	1,090,364.25	
	組入時価比率：0.8%		(187,357,289)	13.0%
合計			1,124,572,078	(891,580,078)
合計			1,445,811,843	(1,212,819,843)

(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	2023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	24,280,281	-	24,511,674	231,393
米ドル	15,640,525	-	15,794,187	153,662
ユーロ	8,639,756	-	8,717,487	77,731
売建	24,280,281	-	24,498,248	217,967
米ドル	8,639,756	-	8,709,981	70,225
カナダドル	15,640,525	-	15,788,267	147,742
合計	-	-	-	13,426

(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)

(2023年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,462,813,982
コール・ローン	26,874,314
社債券	29,489,302,613
未収入金	201,073,927
未収利息	278,199,826
前払費用	8,833,961
流動資産合計	31,467,098,623
資産合計	31,467,098,623
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,010,716
未払解約金	64,230,000
未払利息	28
流動負債合計	67,240,744
負債合計	67,240,744
純資産の部	
元本等	
元本	27,648,166,179
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,751,691,700
元本等合計	31,399,857,879
純資産合計	31,399,857,879
負債純資産合計	31,467,098,623

### 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。 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. 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。 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。
------------------------	--

(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)

2023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	1.1357円
(10,000口当たり純資産額)	(11,357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 2022年11月19日 至 2023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、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、附属明細表に記載しております。</p> <p>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>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。</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っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">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っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">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っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">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っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2023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	

## 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

2023年 5月18日現在	
期首	2022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	28,291,182,602円
同期中における追加設定元本額	835,693,522円
同期中における一部解約元本額	1,478,709,945円
期末元本額	27,648,166,179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	2,431,290,469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	23,646,249,329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	189,290,749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	1,381,335,632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(2023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(2023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	3,766,155.54	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E	3,000,000.00	2,216,231.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE E	650,000.00	437,035.88	
		AMAZON.COM INC	3,500,000.00	2,529,493.75	
		AMERICAN ELECTRIC POWER	1,400,000.00	1,121,368.08	
		ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	2,000,000.00	2,089,040.20	
		APPLE INC	1,000,000.00	956,696.20	
		APPLE INC	200,000.00	187,501.74	
		APPLE INC	900,000.00	772,201.62	
		ASHTREAD CAPITAL INC	1,400,000.00	1,301,208.30	
		AVANGRID INC	4,000,000.00	3,741,489.20	

BEST BUY CO INC	3,200,000.00	3,140,573.44	
BOEING CO	1,000,000.00	993,967.10	
BOEING CO	2,000,000.00	1,941,917.40	
BOSTON PROPERTIES LP	500,000.00	368,272.85	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY	1,000,000.00	941,254.20	
CATERPILLAR FINL SERVICE	1,000,000.00	978,479.70	
CATERPILLAR INC	2,000,000.00	1,537,043.40	
CATERPILLAR INC	1,000,000.00	771,839.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	3,000,000.00	2,522,406.30	
CMS ENERGY CORP	2,300,000.00	2,019,919.34	
CNH INDUSTRIAL CAP LLC	500,000.00	487,517.95	
CNH INDUSTRIAL CAP LLC	1,500,000.00	1,339,441.20	
CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	5,000,000.00	4,755,157.50	
CSX CORP	1,600,000.00	1,549,942.08	
CSX CORP	1,000,000.00	618,424.20	
CSX CORP	2,000,000.00	1,759,422.60	
DAIMLER FINANCE NA LLC	3,000,000.00	2,752,584.90	
DAIMLER FINANCE NA LLC	1,800,000.00	1,536,771.42	
DOMINION ENERGY INC	1,550,000.00	1,308,432.50	
DOMINION ENERGY INC	2,950,000.00	2,560,877.59	
DUKE ENERGY CORP	1,600,000.00	1,192,000.00	
DUKE ENERGY CORP	1,000,000.00	932,900.60	
DUKE ENERGY CORP	1,500,000.00	1,464,315.60	
E.ON INTL FINANCE BV	3,150,000.00	3,379,854.55	
EDP FINANCE BV	3,600,000.00	3,092,700.96	
ELECTRICITE DE FRANCE SA	4,000,000.00	3,878,060.00	
ENEL FINANCE AMERICA LLC	5,550,000.00	3,611,566.48	
ENEL FINANCE INTL NV	2,500,000.00	1,948,799.75	
EVERSOURCE ENERGY	1,000,000.00	988,155.40	
EVERSOURCE ENERGY	1,000,000.00	993,758.00	
EVERSOURCE ENERGY	2,700,000.00	2,155,819.59	
EXELON CORP	1,000,000.00	930,407.90	
EXELON CORP	2,000,000.00	1,762,169.20	
EXELON CORP	900,000.00	708,201.09	
FEDEX CORP	1,000,000.00	982,277.90	
FEDEX CORP	4,200,000.00	3,272,599.68	
GENERAL MILLS INC	2,825,000.00	2,786,677.18	
GENERAL MILLS INC	1,600,000.00	1,434,457.76	
HASBRO INC	3,600,000.00	3,271,785.48	
HEALTHPEAK PROPERTIES	1,500,000.00	1,380,070.80	
HEALTHPEAK PROPERTIES	4,800,000.00	4,094,596.32	
HOME DEPOT INC	4,000,000.00	3,637,996.40	
	3,300,000.00	3,254,049.48	

HP ENTERPRISE CO		
HP INC	1,000,000.00	902,529.50
HP INC	1,000,000.00	945,328.30
HP INC	4,700,000.00	4,116,941.50
INGERSOLL-RAND LUX FINAN	4,000,000.00	3,814,165.60
INTEL CORP	2,000,000.00	1,939,646.00
INTEL CORP	1,000,000.00	872,817.80
INTEL CORP	400,000.00	354,550.88
INTEL CORP	400,000.00	348,088.88
INTL FLAVOR & FRAGRANCES	4,000,000.00	2,753,987.60
KEURIG DR PEPPER INC	2,000,000.00	1,918,913.80
KEURIG DR PEPPER INC	2,000,000.00	1,654,029.60
KROGER CO	4,000,000.00	3,154,297.60
MASSACHUSETTS ELECTRIC	2,500,000.00	1,960,901.50
MCDONALD'S CORP	4,000,000.00	3,747,531.20
MOLSON COORS BREWING CO	4,000,000.00	3,217,800.40
NEXTERA ENERGY CAPITAL	1,500,000.00	1,394,412.45
NEXTERA ENERGY CAPITAL	4,800,000.00	3,990,715.68
NEXTERA ENERGY CAPITAL	1,000,000.00	989,564.30
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,000,000.00	1,740,008.00
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	4,600,000.00	4,071,812.36
NXP BV/NXP FUNDING LLC	2,000,000.00	1,394,905.20
PEPSICO INC	2,750,000.00	2,701,612.10
QUALCOMM INC	2,000,000.00	1,758,410.00
QUALCOMM INC	1,500,000.00	1,616,153.55
RALPH LAUREN CORP	5,200,000.00	4,613,031.28
RAYTHEON TECH CORP	4,600,000.00	3,241,451.64
SCENTRE GROUP TRUST 2	4,400,000.00	3,992,208.00
SEMPRA ENERGY	2,000,000.00	1,905,220.00
SEMPRA ENERGY	2,400,000.00	1,930,407.36
SIEMENS FINANCIERINGSMAT	2,500,000.00	2,216,170.50
SIMON PROPERTY GROUP LP	1,200,000.00	1,032,159.00
SIMON PROPERTY GROUP LP	4,000,000.00	3,227,754.80
STARBUCKS CORP	5,300,000.00	4,570,741.20
SYSCO CORPORATION	3,562,000.00	3,746,265.10
TOTAL CAPITAL INTL SA	3,000,000.00	2,116,596.30
UDR INC	4,000,000.00	3,407,145.60
UNITED PARCEL SERVICE	3,000,000.00	3,101,769.60
VENTAS REALTY LP/CAP CRP	2,600,000.00	2,469,866.10
VF CORP	3,200,000.00	2,653,637.44
VOLKSWAGEN GROUP AMERICA	3,600,000.00	3,278,210.40
VOLKSWAGEN GROUP AMERICA	1,000,000.00	911,856.90
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	4,000,000.00	3,462,356.80



		WEA FINANCE LLC	1,900,000.00	1,650,939.07	
		WEA FINANCE LLC/WESTFIEL	900,000.00	851,368.32	
		WELLTOWER INC	3,000,000.00	2,480,407.80	
		WESTINGHOUSE AIR BRAKE	2,000,000.00	1,906,072.80	
	小計	銘柄数：100	244,987,000.00	214,280,646.81	
		組入時価比率：93.9%		(29,489,302,613)	
				100.0%	
	合計			29,489,302,613	
				(29,489,302,613)	

(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	2023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				
売建	244,668,204	-	247,678,920	3,010,716
米ドル	244,668,204	-	247,678,920	3,010,716
合計	244,668,204	-	247,678,920	3,010,716

(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新興国国債 マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(2023年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	104,808,612
コール・ローン	102,123,573
国債証券	10,593,175,954
特殊債券	335,864,343
社債券	2,187,842,071

(2023年 5月18日現在)

未収利息	198,547,815
前払費用	12,439,644
流動資産合計	13,534,802,012
資産合計	13,534,802,012
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	758
未払解約金	34,700,000
未払利息	107
流動負債合計	34,700,865
負債合計	34,700,865
純資産の部	
元本等	
元本	11,160,054,031
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,340,047,116
元本等合計	13,500,101,147
純資産合計	13,500,101,147
負債純資産合計	13,534,802,012

## 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 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。 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>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。</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)

2023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	1.2097円
(10,000口当たり純資産額)	(12,097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 2022年11月19日 至 2023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、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、附属明細表に記載しております。</p> <p>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>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。</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>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2023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>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。</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、附属明細表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>

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2023年 5月18日現在	
期首	2022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	11,560,323,132円
同期中における追加設定元本額	284,584,526円

同期中における一部解約元本額	684,853,627円
期末元本額	11,160,054,031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	980,118,088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	9,546,678,124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	76,309,765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	556,948,054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(2023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(2023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	800,000.00	759,805.60	
		ABU DHABI GOVT INT'L	320,000.00	283,232.00	
		BRAZIL GLOBAL	350,000.00	403,229.01	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	161,461.46	
		COLOMBIA GLOBAL	1,690,000.00	1,579,554.78	
		COSTA RICA GOVERNMENT	200,000.00	201,304.34	
		COSTA RICA GOVERNMENT	200,000.00	199,275.70	
		DOMINICAN REPUBLIC	2,200,000.00	2,182,758.16	
		DOMINICAN REPUBLIC	1,800,000.00	1,580,967.72	
		DOMINICAN REPUBLIC	500,000.00	482,425.90	
		DOMINICAN REPUBLIC	3,300,000.00	2,747,336.13	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	197,142.96	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,120,000.00	2,025,735.68	
		HUNGARY	2,700,000.00	2,659,977.90	
		HUNGARY	1,000,000.00	1,032,400.00	
		INDONESIA GLOBAL	1,080,000.00	1,422,791.78	
		INDONESIA GLOBAL	1,150,000.00	1,340,952.32	
		KINGDOM OF BAHRAIN	2,340,000.00	2,399,962.50	
		KINGDOM OF BAHRAIN	200,000.00	203,998.00	
		KINGDOM OF BAHRAIN	800,000.00	812,192.00	
		KINGDOM OF JORDAN	1,000,000.00	910,520.00	
		KINGDOM OF JORDAN	3,500,000.00	2,982,413.00	
		MEXICO GLOBAL	1,150,000.00	1,266,083.76	
OMAN GOV INTERNTL BOND	1,420,000.00	1,402,960.00			

OMAN GOV INTERNTL BOND	1,800,000.00	1,761,912.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	800,000.00	885,704.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	1,000,000.00	984,290.00	
PANAMA GLOBAL	860,000.00	1,000,171.83	
PANAMA GLOBAL	400,000.00	488,422.00	
PANAMA GLOBAL	3,300,000.00	3,527,589.45	
PERU GLOBAL	2,430,000.00	2,671,889.00	
PHILIPPINES GLOBAL	1,700,000.00	2,178,748.05	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	907,927.92	
REPUBLIC OF ARMENIA	200,000.00	202,750.00	
REPUBLIC OF CHILE	2,800,000.00	2,460,688.72	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	173,742.64	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	161,681.44	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,141,438.09	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,800,000.00	2,198,279.44	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,600,000.00	1,883,997.70	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	669,439.10	
REPUBLIC OF ECUADOR	1,000,000.00	297,470.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	2,400,000.00	2,694,218.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	406,311.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	636,913.20	
REPUBLIC OF PANAMA	100,000.00	88,527.36	
REPUBLIC OF PARAGUAY	500,000.00	485,354.10	
REPUBLIC OF PARAGUAY	500,000.00	478,547.00	
REPUBLIC OF PERU	1,420,000.00	1,252,394.13	
REPUBLIC OF PERU	1,300,000.00	1,653,502.63	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	400,000.00	406,019.84	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,100,000.00	1,948,873.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,560,353.40	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,000,000.00	2,041,125.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,000,000.00	806,710.00	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	400,000.00	402,726.52	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	380,000.00	477,470.00	
ROMANIA	2,000,000.00	1,677,500.00	
ROMANIA	1,000,000.00	855,850.00	
ROMANIA	1,000,000.00	1,065,221.00	
ROMANIA	2,000,000.00	1,980,000.00	
ROMANIA	1,000,000.00	949,035.00	
STATE OF QATAR	440,000.00	487,179.00	
STATE OF QATAR	200,000.00	200,834.40	
TRINIDAD & TOBAGO	1,000,000.00	962,621.40	
UNITED MEXICAN STATES	440,000.00	430,478.13	
UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	191,714.98	

	小計	銘柄数：67 組入時価比率：78.5%	80,890,000.00	76,974,102.27 (10,593,175,954) 80.7%
	合計			10,593,175,954 (10,593,175,954)
特殊債券	米ドル	CHINA DEVELOPMENT BANK	600,000.00	576,707.94
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	1,000,000.00	968,545.30
		PETRONAS CAPITAL LTD	200,000.00	188,304.10
		PETRONAS CAPITAL LTD	200,000.00	184,401.92
		PT PERTAMINA (PERSERO)	500,000.00	522,560.60
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：2.5%	2,500,000.00	2,440,519.86 (335,864,343) 2.6%
	合計			335,864,343 (335,864,343)
社債券	米ドル	CODELCO INC	200,000.00	191,586.40
		CODELCO INC	1,700,000.00	1,568,997.66
		CODELCO INC	960,000.00	1,016,655.74
		CODELCO INC	700,000.00	696,821.09
		PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	1,000,000.00	1,016,255.00
		PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	3,200,000.00	3,232,576.00
		PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR	1,200,000.00	1,041,156.00
		PETROLEOS MEXICANOS	1,400,000.00	1,146,026.56
		PETROLEOS MEXICANOS	1,200,000.00	1,000,435.44
		PETROLEOS MEXICANOS	500,000.00	377,128.05
		PETROLEOS MEXICANOS	2,300,000.00	1,570,251.40
		PETROLEOS MEXICANOS	5,000,000.00	3,039,815.00
		小計	銘柄数：12 組入時価比率：16.2%	19,360,000.00
	合計			2,187,842,071 (2,187,842,071)
合計			13,116,882,368 (13,116,882,368)	

(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	2023年 5月18日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
市場取引以外の取引			

為替予約取引				
売建	72,883,252	-	72,884,010	758
米ドル	72,883,252	-	72,884,010	758
合計	72,883,252	-	72,884,010	758

## (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)

(2023年 5月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	313,787,333
コール・ローン	215,786,935
株式	1,235,768,592
投資証券	20,283,470,343
派生商品評価勘定	505,700
未収入金	245,250,393
未収配当金	15,854,637
流動資産合計	22,310,423,933
資産合計	
22,310,423,933	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	716,872
未払金	238,662,613
未払解約金	14,090,000
未払利息	226
流動負債合計	253,469,711
負債合計	
253,469,711	
純資産の部	
元本等	
元本	15,797,133,668
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,259,820,554
元本等合計	22,056,954,222
純資産合計	
22,056,954,222	
負債純資産合計	
22,310,423,933	

## 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	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	<p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <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 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。</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)

2023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	1.3963円
(10,000口当たり純資産額)	(13,963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 2022年11月19日 至 2023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っております。

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2023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

2023年 5月18日現在	
期首	2022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	15,786,304,965円
同期中における追加設定元本額	769,495,161円
同期中における一部解約元本額	758,666,458円
期末元本額	15,797,133,668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	1,406,525,087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	13,487,399,163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	109,427,974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	793,781,444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(2023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	354,200	739.00	261,753,800		
		小計	銘柄数：1			261,753,800	
						組入時価比率：1.2%	21.2%
	米ドル	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	8,203	144.20	1,182,872.60		
		HYATT HOTELS CORP-CL A	16,024	112.69	1,805,744.56		
		小計	銘柄数：2			2,988,617.16	
						(411,293,493)	33.3%
	ユーロ	CELLNEX TELECOM SA	45,055	38.50	1,734,617.50		
		小計	銘柄数：1			1,734,617.50	
						(258,787,584)	20.9%
	豪ドル	NEXTDC LTD	124,551	11.71	1,458,492.21		
		NEXTDC LTD	30,948	11.71	362,401.08		
		小計	銘柄数：2			1,820,893.29	
						(166,884,870)	13.5%
香港ドル	H WORLD GROUP LIMITED	239,500	32.55	7,795,725.00			
	小計	銘柄数：1			7,795,725.00		
					(137,048,845)	11.1%	
					組入時価比率：0.6%		
合計					1,235,768,592		
					(974,014,792)		

(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(2023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	G L P 投資法人 投資証券	1,841	272,652,100	
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	746	249,164,000	
		インヴィンシブル投資法人 投資証券	3,822	220,147,200	
		ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	3,929	308,033,600	
		小計	銘柄数：4 組入時価比率：4.8%	10,338	1,049,996,900 5.2%
	米ドル	AGREE REALTY CORP	22,927	1,506,762.44	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	144,171	4,904,697.42	
		AMERICAN TOWER CORP	3,941	767,549.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	45,720	8,100,212.40	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	176,333	3,641,276.45	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	42,525	4,066,240.50	
		EQUINIX INC	12,640	9,203,689.60	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	128,676	3,173,150.16	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	29,894	4,460,184.80	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	20,700	1,015,956.00	
		IRON MOUNTAIN INC	82,549	4,562,483.23	
		KILROY REALTY CORP	12,664	340,408.32	
		KITE REALTY GROUP TRUST	185,970	3,832,841.70	
		NETSTREIT CORP	53,198	955,436.08	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	76,172	1,039,747.80	
		PROLOGIS INC	121,325	14,886,577.50	
		PUBLIC STORAGE	22,262	6,389,639.24	
		REALTY INCOME CORP	86,690	5,257,748.50	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	89,086	4,836,478.94	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	29,740	3,161,362.00	
		SUN COMMUNITIES INC	22,333	2,917,136.46	
TERRENO REALTY CORP	65,332	4,044,050.80			
UDR INC	124,229	5,036,243.66			
VENTAS INC	64,778	2,969,423.52			
VICI PROPERTIES INC	166,250	5,236,875.00			

小計	WELLTOWER INC	68,350	5,297,808.50	
	銘柄数：26	1,898,455	111,603,980.18	(15,358,939,752)
	組入時価比率：69.6%			75.8%
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	90,048	4,424,958.72	
小計	銘柄数：1	90,048	4,424,958.72	(452,452,029)
	組入時価比率：2.1%			2.2%
英ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	161,380	1,886,532.20	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	457,172	2,872,868.84	
	SEGRO PLC	364,314	2,969,159.10	
小計	銘柄数：3	982,866	7,728,560.14	(1,327,998,488)
	組入時価比率：6.0%			6.5%
豪ドル	GOODMAN GROUP	414,781	8,312,211.24	
	STOCKLAND TRUST GROUP	273,398	1,211,153.14	
	VICINITY CENTRES	1,314,262	2,681,094.48	
小計	銘柄数：3	2,002,441	12,204,458.86	(1,118,538,654)
	組入時価比率：5.1%			5.5%
香港ドル	LINK REIT	422,180	21,130,109.00	
小計	銘柄数：1	422,180	21,130,109.00	(371,467,316)
	組入時価比率：1.7%			1.8%
シンガポールドル	KEPPEL DC REIT	1,337,900	2,822,969.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,849,679	3,070,467.14	
小計	銘柄数：2	3,187,579	5,893,436.14	(604,077,204)
	組入時価比率：2.7%			3.0%
合計			20,283,470,343	(19,233,473,443)

(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	2023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	74,236,338	-	74,742,038	505,700
米ドル	21,691,346	-	21,896,835	205,489
豪ドル	30,499,181	-	30,615,234	116,053
シンガポールドル	22,045,811	-	22,229,969	184,158
売建	74,236,338	-	74,953,210	716,872
米ドル	52,544,992	-	53,053,049	508,057
香港ドル	21,691,346	-	21,900,161	208,815
合計	-	-	-	211,172

## (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

2023年6月30日現在

資産総額	14,933,360,801円
負債総額	7,094,822,172円
純資産総額（ - ）	7,838,538,629円

発行済口数	8,843,082,254口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8864円

## 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

2023年6月30日現在

資産総額	79,100,638,662円
負債総額	870,901,478円
純資産総額（ - ）	78,229,737,184円
発行済口数	62,352,565,623口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2546円

## 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

2023年6月30日現在

資産総額	1,188,463,233円
負債総額	565,337,428円
純資産総額（ - ）	623,125,805円
発行済口数	707,367,672口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8809円

## 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

2023年6月30日現在

資産総額	4,684,727,839円
負債総額	53,041,277円
純資産総額（ - ）	4,631,686,562円
発行済口数	3,772,005,860口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2279円

## （参考）ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	22,898,393,985円
負債総額	72,221,713円
純資産総額（ - ）	22,826,172,272円
発行済口数	17,100,713,027口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3348円

## （参考）米ドル建てE S G先進国社債 マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	31,462,792,771円
負債総額	7,080,706円
純資産総額（ - ）	31,455,712,065円
発行済口数	26,275,950,768口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1971円

## （参考）米ドル建てE S G新興国国債 マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	13,483,726,726円
負債総額	20,610,299円
純資産総額（ - ）	13,463,116,427円
発行済口数	10,480,427,863口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2846円

## （参考）A C I E S GグローバルR E I T マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	23,048,778,278円
負債総額	311,380,622円
純資産総額（ - ）	22,737,397,656円
発行済口数	15,316,331,406口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4845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

2023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。

< 更新後 >

##### (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

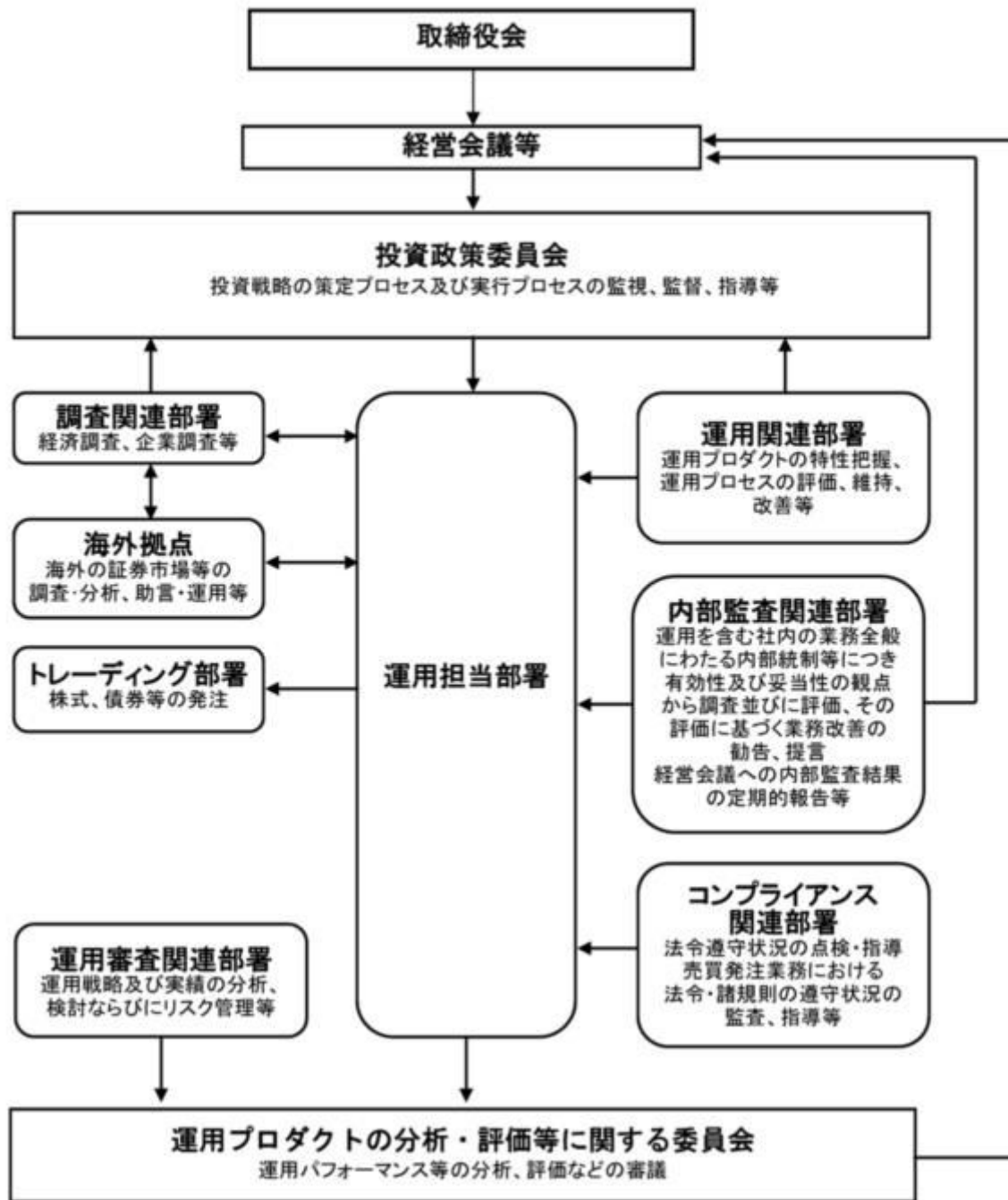
代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

###### 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2023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	998	42,317,159
単位型株式投資信託	191	818,734
追加型公社債投資信託	14	6,467,645
単位型公社債投資信託	475	1,049,011
合計	1,678	50,652,550

### 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(2022年4月1日から2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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		2,006	1,865
金銭の信託		35,894	42,108
有価証券		29,300	21,900
前払金		11	11
前払費用		454	775
未収入金		694	1,775
未収委託者報酬		27,176	26,116
未収運用受託報酬		4,002	3,780
短期貸付金		1,835	1,001
未収還付法人税等		-	2,083
その他		57	84
貸倒引当金		15	15
流動資産計		101,417	101,486
固定資産			
有形固定資産		1,744	1,335
建物	2	1,219	906

器具備品	2	525		428	
無形固定資産			5,210		5,563
ソフトウェア		5,209		5,562	
その他		0		0	
投資その他の資産			16,067		16,336
投資有価証券		2,201		1,793	
関係会社株式		9,214		10,025	
長期差入保証金		443		520	
長期前払費用		13		10	
前払年金費用		1,297		1,553	
繰延税金資産		2,784		2,340	
その他		112		92	
固定資産計			23,023		23,235
資産合計			124,440		124,722

区分	注記 番号	前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023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			120		124
未払金			17,615		17,879
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		17		57	
未払手数料		8,357		8,409	
関係会社未払金		8,149		8,911	
その他未払金		1,089		500	
未払費用	1		9,512		9,682
未払法人税等			1,319		1,024
前受収益			22		22
賞与引当金			4,416		3,635
その他			121		46
流動負債計			33,127		32,414
固定負債					
退職給付引当金			3,194		2,940
時効後支払損引当金			588		595
資産除去債務			1,123		1,123
固定負債計			4,905		4,659
負債合計			38,033		37,074
<b>(純資産の部)</b>					
株主資本					
資本金			86,232		87,419
資本剰余金			17,180		17,180
資本剰余金			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			55,322		56,509
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		54,637		55,823	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,030		31,217	

評価・換算差額等		174	229
その他有価証券評価差額金		174	229
純資産合計		86,407	87,648
負債・純資産合計		124,440	124,722

## ( 2 ) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		115,733	113,491
運用受託報酬		17,671	18,198
その他営業収益		530	331
営業収益計		133,935	132,021
営業費用			
支払手数料		39,087	38,684
広告宣伝費		804	1,187
公告費		0	0
調査費		26,650	29,050
調査費		4,867	6,045
委託調査費		21,783	23,004
委託計算費		1,384	1,363
営業雑経費		3,094	3,302
通信費		72	89
印刷費		918	903
協会費		79	83
諸経費		2,023	2,225
営業費用計		71,021	73,587
一般管理費			
給料		12,033	11,316
役員報酬		229	226
給料・手当		7,375	7,752
賞与		4,427	3,337
交際費		47	78
寄付金		73	115
旅費交通費		65	283
租税公課		1,049	963
不動産賃借料		1,432	1,232
退職給付費用		1,212	829
固定資産減価償却費		2,525	2,409
諸経費		11,116	12,439
一般管理費計		29,556	29,669
営業利益		33,357	28,763

		前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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	3,530		7,645	
受取利息		10		45	
為替差益		-		49	
その他		1,268		637	
営業外収益計			4,809		8,377
営業外費用					
金銭の信託運用損		1,387		1,736	
時効後支払損引当金繰入額		12		10	
為替差損		23		-	
その他		266		8	
営業外費用計			1,689		1,755
経常利益			36,477		35,385
特別利益					
投資有価証券等売却益		26		10	
株式報酬受入益		53		46	
固定資産売却益		9		-	
資産除去債務履行差額		141		-	
特別利益計			230		57
特別損失					
投資有価証券等売却損		0		16	
関係会社株式評価損		727		-	
固定資産除却損	2	374		52	
資産除去債務履行差額		0		-	
事務所移転費用		54		-	
特別損失計			1,158		69
税引前当期純利益			35,549		35,374
法人税、住民税及び事業税			10,474		8,890
法人税等調整額			171		419
当期純利益			24,904		26,064

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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		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	30,030	55,322	86,232
当期変動額									
剰余金の配当							24,877	24,877	24,877
当期純利益							26,064	26,064	26,064
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,186	1,186	1,186
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,217	56,509	87,419

(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	174	174	86,407
当期変動額			
剰余金の配当			24,877
当期純利益			26,064
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	54	54	54
当期変動額合計	54	54	1,240
当期末残高	229	229	87,648

## [重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない ... 時価法 株式等以外のもの (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない ... 移動平均法による原価法 株式等</p>
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	<p>(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</p> <p>(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。</p>
6．引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p>

## (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、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

確定給付型企業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業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。

## [ 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 ]



（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の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。

これにより、「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。

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

[未適用の会計基準等]

該当事項はありません。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2022年3月31日)	当事業年度末 (2023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 1,223百万円	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 1,350百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 901百万円 器具備品 657 合計 1,559

損益計算書関係

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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 3,525百万円	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 7,634百万円
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 - 合計 374	2. 固定資産除却損 建物 0百万円 器具備品 0 ソフトウェア 52 合計 52

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

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

2023年5月23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	55,782百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	10,830円
基準日	2023年3月31日

効力発生日

2023年6月30日

## 金融商品関係

前事業年度（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。

	前事業年度（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、前事業年度において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）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）で構成されています。

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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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、自ら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

2023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	42,108	42,108	-
資産計	42,108	42,108	-
(2) その他（デリバティブ取引）	46	46	-
負債計	46	46	-

(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（ ）	10,261
組合出資金等	1,557
合計	11,819

( ) 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。

(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	1,865	-	-	-
金銭の信託	42,108	-	-	-
未収委託者報酬	26,116	-	-	-
未収運用受託報酬	3,780	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	21,900	-	-	-
短期貸付金	1,001			
合計	96,772	-	-	-

## 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）	-	42,108	-	42,108
資産計	-	42,108	-	42,108
デリバティブ取引（通貨関連）	-	46	-	46
負債計	-	46	-	46

（注）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。構成物のレベルに基づき、レベル2の時価に分類しております。

#### 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あり、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 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	前事業年度 (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、記載しておりません。

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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．売買目的有価証券(2023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(2023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(2023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	9,919
関連会社株式	106

4．その他有価証券(2023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	21,900	21,900	-
小計	21,900	21,900	-
合計	21,900	21,900	-

市場価格のない株式等（貸借対照表計上額235百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,557百



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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額(百万円)	売却益の合計額(百万円)	売却損の合計額(百万円)
株式	66	-	16
合計	66	-	16

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 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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	952	-	46	46

退職給付関係

前事業年度(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	23,270 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	
確定給付型企业年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.35%
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。	

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	21,967 百万円
勤務費用	853
利息費用	188
数理計算上の差異の発生額	1,476
退職給付の支払額	1,133
その他	83
退職給付債務の期末残高	20,314

## (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	19,687 百万円
期待運用収益	462
数理計算上の差異の発生額	716
事業主からの拠出額	819
退職給付の支払額	874
年金資産の期末残高	19,378

## (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	17,386 百万円
年金資産	19,378
	1,991
非積立型制度の退職給付債務	2,927
未積立退職給付債務	935
未認識数理計算上の差異	398
未認識過去勤務費用	53
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387
退職給付引当金	2,940
前払年金費用	1,553
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,387

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	853 百万円
利息費用	188
期待運用収益	462
数理計算上の差異の費用処理額	127
過去勤務費用の費用処理額	52
確定給付制度に係る退職給付費用	653

## (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	34%
株式	27%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	21%
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	1.4%
退職一時金制度の割引率	1.1%
長期期待運用収益率	2.35%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。	

## 税効果会計関係

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

前事業年度末 (2022年3月31日)		当事業年度末 (2023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	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,381	賞与引当金	1,138
退職給付引当金	990	退職給付引当金	911
関係会社株式評価減	1,010	関係会社株式評価減	1,010
未払事業税	285	未払事業税	227
投資有価証券評価減	110	投資有価証券評価減	11
減価償却超過額	272	減価償却超過額	331
時効後支払損引当金	182	時効後支払損引当金	184
関係会社株式売却損	505	関係会社株式売却損	505
ゴルフ会員権評価減	92	ゴルフ会員権評価減	78
資産除去債務	348	資産除去債務	348
未払社会保険料	114	未払社会保険料	85
その他	84	その他	44
繰延税金資産小計	5,376	繰延税金資産小計	4,878
評価性引当額	1,795	評価性引当額	1,696
繰延税金資産合計	3,581	繰延税金資産合計	3,181
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	233	資産除去債務に対応する除去費用	171
関係会社株式評価益	81	関係会社株式評価益	84
その他有価証券評価差額金	78	その他有価証券評価差額金	102
前払年金費用	402	前払年金費用	481
繰延税金負債合計	796	繰延税金負債合計	840
繰延税金資産の純額	2,784	繰延税金資産の純額	2,340
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	0.3%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.4%
タックスヘイブン税制	1.8%	タックスヘイブン税制	2.1%
外国税額控除	0.5%	外国税額控除	0.6%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.4%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%
その他	0.1%	その他	0.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.3%

## 2. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

## 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	2021年4月 1日 至 2022年3月31日	自	2022年4月 1日 至 2023年3月31日
期首残高		1,371		1,123
有形固定資産の取得に伴う増加		48	-	
資産除去債務の履行による減少		296		-
期末残高		1,123		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

前事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

区分	前事業年度 (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。

当事業年度（自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）

区分	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	113,491百万円
運用受託報酬	17,245百万円
成功報酬（注）	952百万円
その他営業収益	331百万円
合計	132,021百万円

（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 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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 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	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	野村証券株式 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 及び売上の取 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	5,736	短期貸付 金	1,001
							資金の返済	6,489		
							貸付金利息	44	未収利息	11

(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	野村証券株式会社	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 及び売上の取 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)	27,180	未払手 数料	5,773

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,775円81銭	1株当たり純資産額	17,016円74銭
1株当たり当期純利益	4,835円10銭	1株当たり当期純利益	5,060円34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おりません。		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おりません。	
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	24,904百万円	損益計算書上の当期純利益	26,064百万円
普通株式に係る当期純利益	24,904百万円	普通株式に係る当期純利益	26,064百万円
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

< 更新後 >

#### (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。

\* 2023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
野村證券株式会社	10,000百万円	「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。
F F G 証券株式会社	3,000百万円	
ぐんぎん証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
静銀ティーエム証券株式会社	3,000百万円	
第四北越証券株式会社	600百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
百五証券株式会社	3,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	

北洋証券株式会社	500百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいません。
株式会社青森銀行	19,562百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社神奈川銀行	6,191百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社きらやか銀行	24,200百万円	
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社高知銀行	22,944百万円	
株式会社佐賀銀行	16,062百万円	
株式会社三十三銀行	37,400百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社静岡銀行	90,845百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
株式会社常陽銀行	85,113百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社中京銀行	31,879百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社トマト銀行	14,310百万円	
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	
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	12,495百万円	
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	

\* 2023年5月末現在

## (3) 運用の委託先

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(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	投資運用業を営んでいます。
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>**</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。

\* 2022年12月末現在

\*\* 2023年3月末現在

## 2 関係業務の概要

< 更新後 >

### (1) 受託者

ファンドの受託会社(受託者)として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行いません。

### (2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いを行ない、信託契約の一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

### (3) 運用の委託先

委託会社から運用の指図に関する権限の一部委託を受け、信託財産の運用の指図を行いません。

## 3 資本関係

< 訂正前 >

(持株比率5.0%以上を記載します。)

### (1) 受託者

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### (3) 運用の委託先

委託会社は、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)の株式の100.0%を所有しています。

< 訂正後 >

(2023年3月末現在の持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 運用の委託先

委託会社は、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）の株式の100.0%を保有しています。

## 独立監査人の監査報告書

2023年7月25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2022年11月19日から2023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2023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

2023年7月25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2022年11月19日から2023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2023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

2023年7月25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2022年11月19日から2023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2023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

2023年7月25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2022年11月19日から2023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2023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

2023年6月9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  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 水 永 真太郎  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の財務諸表、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2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示の

ない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社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。