

# 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

## 愛称：ブルー・アース

### 運用報告書(全体版)

第1期(決算日2021年5月18日)

作成対象期間(2020年11月30日～2021年5月18日)

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合	
信託期間	2020年11月30日から2025年11月18日までです。	
運用方針	世界各国(新興国を含みます。)の株式、先進国の企業(金融機関を含みます。)が発行する米ドル建ての社債等、米ドル建ての新興国債等、世界各国(新興国を含みます。)の不動産関連有価証券を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目的に運用を行うことを基本とします。各マザーファンド受益証券への投資比率は以下を基本とします。ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド受益証券：25%、米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド受益証券：35%、米ドル建てESG新興国債 マザーファンド受益証券：15%、ACI ESGグローバルREIT マザーファンド受益証券：25%。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	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	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ます。
	ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	世界各国(新興国を含みます。)の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
	米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	先進国の企業(金融機関を含みます。)が発行する米ドル建ての社債等(期限付劣後債、永久劣後債、優先証券を含みます。)を主要投資対象とします。なお、米国債等にも投資する場合があります。
	米ドル建てESG新興国債 マザーファンド	米ドル建ての新興国債等(国債、政府保証債、政府機関債等を含みます。)を主要投資対象とします。なお、米国債にも投資する場合があります。
主な投資制限	ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	世界各国(新興国を含みます。)の不動産関連有価証券を主要投資対象とします。
	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	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。
	ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	米ドル建てESG新興国債 マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

### 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率						
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
2020年11月30日	10,000	—	—	—	—	—	—	—	1,166
1期(2021年5月18日)	11,032	10	10.4	25.2	—	47.2	—	23.0	21,698

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* 当ファンドでは、値動きを表す適切な指標が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率					
(設定日)	円	%	%	%	%	%	%
2020年11月30日	10,000	—	—	—	—	—	—
12月末	10,163	1.6	24.0	—	47.7	—	23.0
2021年1月末	10,326	3.3	23.4	—	47.0	—	23.2
2月末	10,566	5.7	22.6	—	47.8	—	25.0
3月末	10,911	9.1	23.8	—	47.5	—	23.6
4月末	11,138	11.4	24.7	—	46.6	—	23.0
(期 末)							
2021年5月18日	11,042	10.4	25.2	—	47.2	—	23.0

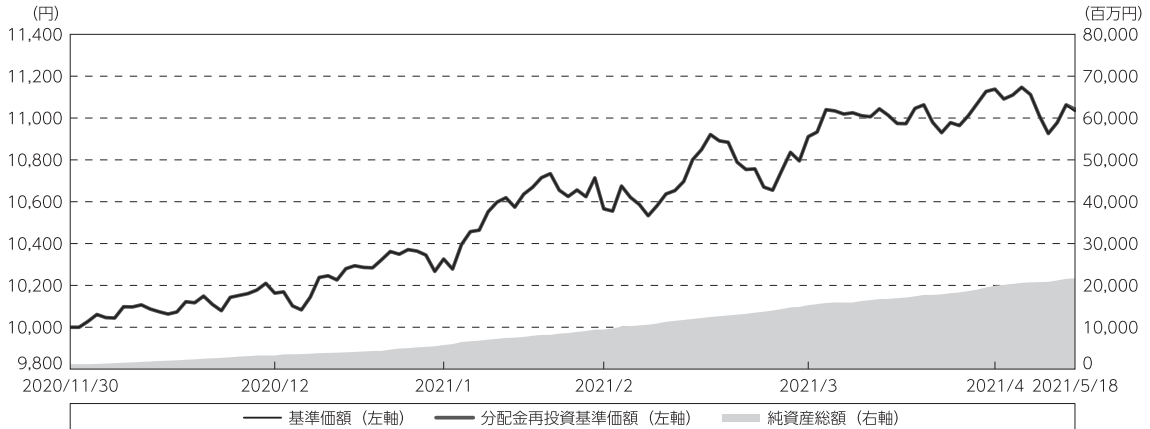
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期 末：11,032円（既払分配金（税込み）：10円）

騰落率： 10.4%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は10,000円から当作成期末には11,032円となりました。

#### (上昇要因)

- ・ 2020年12月に、新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や、FRB（米連邦準備制度理事会）がゼロ金利政策と量的緩和政策の長期維持の方針を表明したことを受けて、米国小型株式市場、世界REIT市場が上昇したこと
- ・ 2021年4月に、3月の雇用統計など米経済指標が市場予想を上回る回復を示したことや、米国や欧州の堅調な1－3月期企業決算や米国の実質GDP（国内総生産）成長率などから先進国社債市場、新興国国債市場、小型株式市場、世界REIT市場が上昇したこと
- ・ 円・ドルの為替相場推移

#### (下落要因)

- ・ 2021年3月に、米長期金利の上昇が加速したことなどを背景に、先進国社債市場、新興国国債市場が下落したこと

## ○投資環境

### ・先進国社債

新型コロナウイルスのワクチン実用化期待を背景とした世界的な景気見通しの改善や、米欧での新型コロナウイルス感染防止のための行動制限の緩和、米長期金利の上昇などを背景に、先進国社債の利回りは上昇（価格は下落）しました。

### ・新興国国債

中国や米国などの堅調な経済指標や米長期金利の上昇などを背景に、新興国国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。

### ・世界株式

新型コロナウイルスのワクチン接種加速による経済正常化への期待が高まったことや、米企業の堅調な決算発表などを背景に米国株式市場は上昇しました。

### ・世界REIT

新型コロナウイルスのワクチン接種加速による経済正常化への期待が高まったことや、米欧での新型コロナウイルス感染防止のための行動制限の緩和、好調な米経済指標などが好感され世界REIT市場は上昇しました。

### ・為替

当作成期中において、米国での追加経済対策期待の高まりや、FRBの緩和的な金融政策の縮小が市場で意識されやすくなったことなどから、米ドルは円に対して上昇しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [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]

各マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界各国の債券、株式およびREITに投資しました。

各マザーファンドへの投資比率は、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、ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド、ACI ESGグローバルREIT マザーファンドを、35：15：25：25を基本としました。なお、当ファンドでは実質外貨建て資産に対する為替ヘッジは、行いませんでした。

### [米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド]

先進国の企業（金融機関を含みます。）が発行する米ドル建ての社債等（期限付き劣後債、永久劣後債、優先証券（ハイブリッド証券）を含みます。）（「米ドル建て先進国社債等」と言います。）を主要投資対象とします。

### [米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド]

米ドル建ての新興国国債等（国債、政府保証債、政府機関債等を含みます。）を主要投資対象とします。

### [ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド]

世界各国（新興国を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

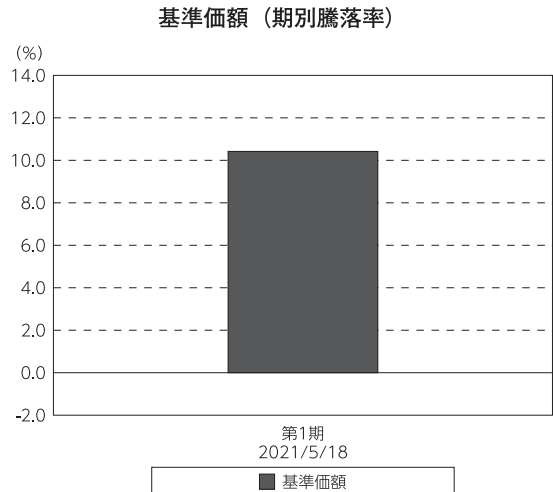
### [ACI ESGグローバルREIT マザーファンド]

世界各国（新興国を含みます。）の不動産関連有価証券を主要投資対象とします。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指標が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

基準価額水準等を勘案し、1万口当たり10円といたしました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第1期
	2020年11月30日～ 2021年5月18日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.091%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,032

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

### [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]

当ファンドは、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、ACI ESGグローバル小型株 マザーファンドおよびACI ESGグローバルREIT マザーファンドを主要投資対象とします。各マザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、REITに投資することにより、信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。

各マザーファンドへの投資比率は、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、ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド、ACI ESGグローバルREIT マザーファンドを、35：15：25：25を基本とし、実質外貨建て資産については為替ヘッジを行わない方針です。

### [米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド]

財政政策と金融緩和に加えて、新型コロナウイルスのワクチン接種による経済正常化への期待等が下支えとなり、クレジットスプレッド（利回り格差）は安定的に推移するものと想定しています。今後も個別発行体の信用力とクレジット市場の動向を注視しながら運用を行いません。

### [米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド]

一部のファンダメンタルズ（経済の基礎的条件）が脆弱な新興国を除き、相対的にファンダメンタルズが堅実である国については、米国の緩和的な金融政策などを背景に、クレジットスプレッドは安定的に推移するものと想定しています。今後も個別新興国の信用力とクレジット市場の動向を注視しながら運用を行いません。

### [ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド]

各国政府の財政・金融政策による下支えや、企業業績回復への期待から、今後の株式市場は堅調に推移すると見込まれています。ファンドは引き続き、ESG（環境・社会・企業統治）の観点も含めた多角的な視点で各企業の成長力を分析し、安定的な成長が見込める企業に投資を行いません。

### [ACI ESGグローバルREIT マザーファンド]

新型コロナウイルスのワクチン接種による経済正常化への期待に加え、各国の財政・金融政策による下支えからREIT市場は堅調に推移するものと想定されます。引き続き、サステイナブル（持続的成長）テーマに着目し、成長力の高いグローバル・リートに投資を行いません。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願いいたします。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年11月30日～2021年5月18日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	84	0.794	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(40)	(0.384)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(40)	(0.384)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	( 3 )	(0.026)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	4	0.041	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 2 )	(0.017)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 3 )	(0.024)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	4	0.041	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 3 )	(0.024)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 2 )	(0.017)	
(d) そ の 他 費 用	4	0.036	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 3 )	(0.033)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	96	0.912	
期中の平均基準価額は、10,517円です。			

\* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

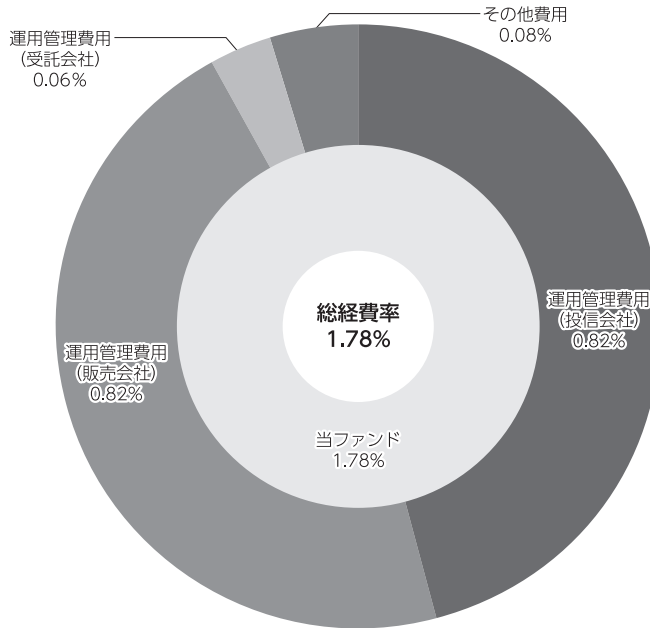
\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



**（参考情報）**

**○総経費率**

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.78%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年11月30日～2021年5月18日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	4,378,070	5,087,500	22,025	27,300
ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	4,484,094	4,941,900	20,572	24,200
米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	7,363,382	7,404,600	1,278	1,300
米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド	3,141,259	3,176,100	6,460	6,600

\*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年11月30日～2021年5月18日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	ACI ESGグローバルREIT マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	9,218,940千円	862,223千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,654,162千円	283,421千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.52	3.04

\* (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2020年11月30日～2021年5月18日)

利害関係人との取引状況

<グローバルESGバランスファンド（為替ヘッジなし）年2回決算型>

該当事項はございません。

<ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		百万円	B/A		百万円	D/C
為替直物取引	百万円 9,524	百万円 339	% 3.6	百万円 3,075	百万円 339	% 11.0

平均保有割合 66.1%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

<ACI ESGグローバルREIT マザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	694	1	0.1	167	—	—
投資信託証券	7,952	8	0.1	1,761	—	—

平均保有割合 66.1%

<米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド>

該当事項はございません。

<米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド>

該当事項はございません。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	3,668千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B) / (A)	0.1%

\* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2020年11月30日～2021年5月18日)

設定時残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2021年5月18日現在)

## 親投資信託残高

銘柄	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
		千口	千円
ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド		4,356,045	5,364,470
ACI ESGグローバルREIT マザーファンド		4,463,521	5,368,276
米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド		7,362,104	7,507,874
米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド		3,134,799	3,221,946

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年5月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド	5,364,470	24.5
ACI ESGグローバルREIT マザーファンド	5,368,276	24.5
米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド	7,507,874	34.3
米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド	3,221,946	14.7
コール・ローン等、その他	409,993	2.0
投資信託財産総額	21,872,559	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*ACI ESGグローバル小型株 マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（6,998,639千円）の投資信託財産総額（8,317,909千円）に対する比率は84.1%です。

\*ACI ESGグローバルREIT マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（6,822,696千円）の投資信託財産総額（7,726,200千円）に対する比率は88.3%です。

\*米ドル建てESG先進国社債 マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（10,249,659千円）の投資信託財産総額（10,688,517千円）に対する比率は95.9%です。

\*米ドル建てESG新興国国債 マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,388,263千円）の投資信託財産総額（4,537,064千円）に対する比率は96.7%です。

\*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.22円、1カナダドル=90.56円、1英ポンド=154.57円、1スイスフラン=120.90円、1スウェーデンクローナ=13.12円、1ノルウェークローネ=13.24円、1デンマーククローネ=17.85円、1ユーロ=132.77円、1香港ドル=14.06円、1シンガポールドル=81.80円、1ウォン=0.0962円、1新台幣ドル=3.8878円、1豪ドル=84.93円、1レアル=20.701円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年5月18日現在）

○損益の状況（2020年11月30日～2021年5月18日）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,872,559,237
コール・ローン等	409,991,158
ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド(評価額)	5,364,470,121
ACI ESGグローバルREIT マザーファンド(評価額)	5,368,276,826
米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド(評価額)	7,507,874,347
米ドル建てESG新興国国債 マザーファンド(評価額)	3,221,946,785
(B) 負債	173,932,192
未払収益分配金	19,668,107
未払解約金	75,571,067
未払信託報酬	78,540,750
未払利息	313
その他未払費用	151,955
(C) 純資産総額(A－B)	21,698,627,045
元本	19,668,107,610
次期繰越損益金	2,030,519,435
(D) 受益権総口数	19,668,107,610口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,032円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 14,383
支払利息	△ 14,383
(B) 有価証券売買損益	878,199,143
売買益	912,267,572
売買損	△ 34,068,429
(C) 信託報酬等	△ 78,692,705
(D) 当期損益金(A+B+C)	799,492,055
(E) 追加信託差損益金	1,250,695,487
(配当等相当額)	(△ 15,517)
(売買損益相当額)	( 1,250,711,004)
(F) 計(D+E)	2,050,187,542
(G) 収益分配金	△ 19,668,107
次期繰越損益金(F+G)	2,030,519,435
追加信託差損益金	1,250,695,487
(配当等相当額)	( 29,410,239)
(売買損益相当額)	( 1,221,285,248)
分配準備積立金	779,823,948

(注) 期首元本額は1,166,281,468円、期中追加設定元本額は19,378,943,666円、期中一部解約元本額は877,117,524円、1口当たり純資産額は1,1032円です。

(注) 投資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については、初回の計算期間末が未到来のため支払い実績はありません。

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

\*損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2020年11月30日～2021年5月18日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2020年11月30日～ 2021年5月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	108,742,740円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	690,749,315円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,250,695,487円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,050,187,542円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,042円
g. 分配金	19,668,107円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

## ○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2021年5月18日現在）

## &lt;ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド&gt;

下記は、ACI ESGグローバル小型株 マザーファンド全体(6,113,276千口)の内容です。

## 国内株式

銘柄	株数	当期	期末
		株数	評価額
化学 (19.1%)		千株	千円
クラレ	28.6		32,861
日本ゼオン	36.2		60,960
機械 (11.9%)			
日本製鋼所	10.6		28,344
CKD	13.1		30,051
電気機器 (2.2%)			
アンリツ	5.4		11,021
その他製品 (8.1%)			
アシックス	16.8		39,597
情報・通信業 (7.8%)			
Appier Group	27.4		38,113
小売業 (33.4%)			
ネクステージ	35.1		58,336
FOOD & LIFE COMPANIE	9.7		46,026
日本瓦斯	30.1		59,447
不動産業 (10.1%)			
オープンハウス	10.6		49,396
サービス業 (7.4%)			
エン・ジャパン	10.3		36,513
合 計	株数・金額	233	490,670
	銘柄数 < 比率 >	12	< 6.5% >

\*各銘柄の業種分類は、期末の時点での分類に基づいています。

\*銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

\*評価額欄の&lt; &gt;内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

外国株式

銘柄	当 期 末			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	243	907	99,108	専門小売り
ARCBEST CORP	72	599	65,434	陸運・鉄道
ARKO CORP	299	315	34,410	専門小売り
AXOGEN INC	229	484	52,931	ヘルスケア機器・用品
BRP GROUP INC-A	156	391	42,811	保険
BLOOMIN BRANDS INC	178	517	56,488	ホテル・レストラン・レジャー
BRUNSWICK CORP	65	699	76,427	レジャー用品
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	126	606	66,191	建設関連製品
CALLAWAY GOLF COMPANY	230	795	86,874	レジャー用品
CANNAE HOLDINGS INC	45	168	18,383	各種金融サービス
CLEAN HARBORS INC	78	739	80,714	商業サービス・用品
CROCS INC	70	729	79,647	繊維・アパレル・贅沢品
DECKERS OUTDOOR CORP	15	529	57,806	繊維・アパレル・贅沢品
DIGITALOCEAN HOLDINGS INC	51	185	20,286	情報技術サービス
ELF BEAUTY INC	242	709	77,466	パーソナル用品
ENDEAVOR GROUP HOLD-CLASS A	121	383	41,904	娯楽
ENCOMPASS HEALTH CORP	36	315	34,445	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EVOQUA WATER TECHNOLOGIES CO	122	356	38,948	機械
FOX FACTORY HOLDING CORP	48	761	83,146	自動車部品
H B FULLER CO	116	801	87,541	化学
GLACIER BANCORP INC	142	873	95,437	銀行
GOOSEHEAD INSURANCE INC -A	7	59	6,453	保険
HEALTH CATALYST INC	34	160	17,542	ヘルスケア・テクノロジー
HUNTSMAN CORP	221	657	71,768	化学
INNOVAGE HOLDING CORP	140	292	31,953	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
I3 VERTICALS INC-CLASS A	139	422	46,197	情報技術サービス
JABIL INC	136	734	80,276	電子装置・機器・部品
JETBLUE AIRWAYS CORPORATION	278	555	60,624	旅客航空輸送業
KINSALE CAPITAL GROUP INC	20	318	34,825	保険
KORN FERRY	104	702	76,771	専門サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	73	349	38,189	半導体・半導体製造装置
LESLIE'S INC	62	168	18,453	専門小売り
LOVESAC CO/THE	70	537	58,705	家庭用耐久財
MGP INGREDIENTS INC	50	340	37,174	飲料
MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS HOLDINGS INC	57	293	32,046	半導体・半導体製造装置
MANHATTAN ASSOCIATES, INC.	34	462	50,485	ソフトウェア
MASONITE INTERNATIONAL CORP	57	713	77,890	建設関連製品
MAXIMUS INC	44	398	43,549	情報技術サービス
NATERA INC	48	446	48,773	バイオテクノロジー
NATIONAL INSTRUMENTS CORP	45	178	19,477	電子装置・機器・部品
NCINO INC	19	100	10,938	ソフトウェア
NEOGENOMICS INC	79	300	32,822	ライフサイエンス・ツール/サービス
NEWMARK GROUP INC-CLASS A	467	617	67,398	不動産管理・開発
ONTO INNOVATION INC	54	316	34,537	半導体・半導体製造装置
OPEN LENDING CORP - CL A	194	683	74,613	資本市場
OPTION CARE HEALTH INC	255	440	48,060	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PLANET FITNESS INC - CL A	64	510	55,722	ホテル・レストラン・レジャー
POWER INTEGRATIONS INC	41	313	34,228	半導体・半導体製造装置
QUINSTREET INC	311	556	60,742	インタラクティブ・メディアおよびサービス



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

銘柄	当 期 末			業 種 等	
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円		
RI RCM INC	344	829	90,586	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
RH	10	636	69,515	専門小売り	
RADNET INC	299	700	76,537	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
REPAY HOLDINGS CORP	159	360	39,343	情報技術サービス	
SP PLUS CORP	198	666	72,749	商業サービス・用品	
SAILPOINT TECHNOLOGIES HOLDI	64	286	31,329	ソフトウェア	
SEASPIKE HOLDINGS CORP	176	353	38,560	ヘルスケア機器・用品	
SEMTECH CORP	53	328	35,913	半導体・半導体製造装置	
SI-BONE INC	107	337	36,862	ヘルスケア機器・用品	
SILK ROAD MEDICAL INC	42	198	21,694	ヘルスケア機器・用品	
SILVERGATE CAPITAL CORP-CL A	40	373	40,777	銀行	
SKYLINE CHAMPION CORP	38	160	17,521	家庭用耐久財	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	155	659	72,034	航空宇宙・防衛	
SPROUT SOCIAL INC - CLASS A	70	441	48,167	ソフトウェア	
SUMMIT MATERIALS INC -CL A	223	763	83,350	建設資材	
TCF FINANCIAL CORP	116	552	60,299	銀行	
TANDEM DIABETES CARE INC	23	186	20,387	ヘルスケア機器・用品	
TRAVEL + LEISURE CO	123	805	87,987	ホテル・レストラン・レジャー	
TRIUMPH BANCORP INC	69	589	64,355	銀行	
21VIANET GROUP INC-ADR	136	339	37,103	情報技術サービス	
VEECO INSTRUMENTS INC	163	364	39,854	半導体・半導体製造装置	
WINTRUST FINANCIAL CORP	145	1,172	128,113	銀行	
WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	91	686	75,024	ホテル・レストラン・レジャー	
CAPRI HOLDINGS LTD	161	933	101,993	繊維・アパレル・贅沢品	
DIVERSEY HOLDINGS LTD	274	447	48,836	化学	
ORTHO CLINICAL DIAGNOSTICS H	305	624	68,207	ヘルスケア機器・用品	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	78	457	49,981	電気設備	
KORNIT DIGITAL LTD	62	554	60,529	機械	
NOVA MEASURING INSTRUMENTS	95	837	91,470	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,642	39,147	4,275,724	
	銘柄 数 < 比 率 >	78	—	<56.8%>	
(カナダ)		千カナダドル			
BRP INC/CA- SUB VOTING	47	468	42,423	レジャー用品	
BORALEX INC -A	89	312	28,280	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
CAPSTONE MINING CORP	2,496	1,515	137,238	金属・鉱業	
COLLIERS INTERNATIONAL GROUP	61	801	72,558	不動産管理・開発	
ECN CAPITAL CORP	1,170	966	87,483	各種金融サービス	
TFI INTERNATIONAL INC	62	688	62,378	陸運・鉄道	
WHITECAP RESOURCES INC	1,074	638	57,804	石油・ガス・消耗燃料	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,004	5,390	488,167	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	—	<6.5%>	
(イギリス)		千英ポンド			
ELECTROCOMPONENTS PLC	575	579	89,641	商社・流通業	
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	630	498	77,040	商社・流通業	
WEIR GROUP PLC	278	511	79,122	機械	
S4 CAPITAL PLC	640	327	50,674	メディア	
BOOHOO GROUP PLC	376	120	18,608	インターネット販売・通信販売	
PETS AT HOME GROUP PLC	589	253	39,257	専門小売り	
DR. MARTENS PLC-WI	800	365	56,511	繊維・アパレル・贅沢品	
FEVERTREE DRINKS PLC	100	256	39,625	飲料	
IWG PLC	809	291	44,987	不動産管理・開発	

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス) HOMESERVE PLC	百株 95	千英ポンド 98	千円 15,227	商業サービス・用品
小計	株数・金額 4,896	3,303	510,696	
	銘柄数<比率>	10	—	<6.8%>
(スイス) SIG COMBIBLOC GROUP AG	73	千スイスフラン 165	20,029	容器・包装
小計	株数・金額 73	165	20,029	
	銘柄数<比率>	1	—	<0.3%>
(スウェーデン) TRELLEBORG AB-B SHS NORDIC ENTERTAINMENT GROUP-B LIFCO AB-B SHS STILLFRONT GROUP AB SINCH AB	261 68 260 184 10	千スウェーデンクローナ 5,799 2,352 4,359 1,350 1,303	76,083 30,861 57,196 17,714 17,095	機械 メディア コングロマリット 娯楽 ソフトウェア
小計	株数・金額 785	15,164	198,952	
	銘柄数<比率>	5	—	<2.6%>
(ノルウェー) BAKKAFROST P/F	66	千ノルウェークローネ 4,587	60,737	食品
小計	株数・金額 66	4,587	60,737	
	銘柄数<比率>	1	—	<0.8%>
(デンマーク) PANDORA A/S	79	千デンマーククローネ 6,023	107,522	繊維・アパレル・贅沢品
小計	株数・金額 79	6,023	107,522	
	銘柄数<比率>	1	—	<1.4%>
(ユーロ…ドイツ) HYPOPORT SE FLATEX AG	6 43	千ユーロ 279 416	37,061 55,351	各種金融サービス 資本市場
小計	株数・金額 49	696	92,413	
	銘柄数<比率>	2	—	<1.2%>
(ユーロ…フランス) S. O. I. T. E. C.	24	362	48,135	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 24	362	48,135	
	銘柄数<比率>	1	—	<0.6%>
(ユーロ…オランダ) APERAM BASIC-FIT NV CORBION NV	134 106 74	625 378 362	83,075 50,258 48,098	金属・鉱業 ホテル・レストラン・レジャー 化学
小計	株数・金額 315	1,366	181,432	
	銘柄数<比率>	3	—	<2.4%>
(ユーロ…ベルギー) D IETEREN SA/NV MELEXIS NV	50 41	450 339	59,793 45,073	販売 半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 92	789	104,867	
	銘柄数<比率>	2	—	<1.4%>
(ユーロ…フィンランド) METSO OUTOTEC OYJ	782	735	97,702	機械
小計	株数・金額 782	735	97,702	
	銘柄数<比率>	1	—	<1.3%>
ユーロ計	株数・金額 1,265	3,950	524,550	
	銘柄数<比率>	9	—	<7.0%>

銘柄	株数	当期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港) CHINA YONGDA AUTOMOBILES SERVICES HOLDIN	百株 4,045	千香港ドル 5,428	千円 76,323	専門小売り
小計	株数・金額 4,045	5,428	76,323	
	銘柄数<比率>	1	<1.0%>	
(韓国) SK MATERIALS CO LTD	17	千ウォン 542,400	52,178	化学
小計	株数・金額 17	542,400	52,178	
	銘柄数<比率>	1	<0.7%>	
(台湾) ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION ALCHIP TECHNOLOGIES LTD AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	270 90 170	千新台幣ドル 7,371 3,744 16,490	28,656 14,555 64,109	通信機器 半導体・半導体製造装置 機械
小計	株数・金額 530	27,605	107,322	
	銘柄数<比率>	3	<1.4%>	
(オーストラリア) SEVEN GROUP HOLDINGS LTD CHAMPION IRON LTD NICKEL MINES LTD	253 969 3,589	千豪ドル 505 696 362	42,954 59,143 30,791	商社・流通業 金属・鉱業 金属・鉱業
小計	株数・金額 4,813	1,564	132,889	
	銘柄数<比率>	3	<1.8%>	
(ブラジル) LOCAWEB SERVICOS DE INTERNET PET CENTER COMERCIO E PARTIC	820 851	千リアル 1,867 1,914	38,651 39,637	情報技術サービス 専門小売り
小計	株数・金額 1,671	3,781	78,288	
	銘柄数<比率>	2	<1.0%>	
合計	株数・金額 32,890	—	6,633,382	
	銘柄数<比率>	122	<88.1%>	

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

銘柄	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) GLOBAL MEDICAL REIT INC HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES SCHWAB US SMALL-CAP ETF SCHWAB INTL SMALL-CAP EQUITY	口 51,467 3,470 10,341 1,696 4,093	千米ドル 735 162 770 170 169	千円 80,383 17,763 84,177 18,670 18,552	% 1.1 0.2 1.1 0.2 0.2
合計	口数・金額 71,067	2,010	219,546	
	銘柄数<比率>	5	<2.9%>	

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

\* 評価額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

<ACI ESGグローバルREIT マザーファンド>

下記は、ACI ESGグローバルREIT マザーファンド全体(6,264,506千口)の内容です。

国内株式

銘柄	株数	当期	期末
		株数	評価額
不動産業 (100.0%)		千株	千円
オープンハウス		18.1	84,346
合計	株数・金額	18	84,346
	銘柄数 < 比率 >	1	< 1.1% >

\*銘柄の業種分類は、期末の時点での分類に基づいています。

\*銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する業種の比率。

\*評価額欄の< >内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

外国株式

銘柄	株数	期末		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) TRAVEL + LEISURE CO	百株 133	千米ドル 871	千円 95,196	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	133 1	871 — <1.3%>	
(カナダ) TRICON RESIDENTIAL INC	467	千カナダドル 616	55,826	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	467 1	616 — <0.7%>	
(イギリス) TAYLOR WIMPEY PLC	2,682	千英ポンド 471	72,825	家庭用耐久財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,682 1	471 — <1.0%>	
(ユーロ…オランダ) CTP NV W/I	344	千ユーロ 492	65,443	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	344 1	492 — <0.9%>	
(ユーロ…スペイン) CELLNEX TELECOM SA	149	686	91,128	各種電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	149 1	686 — <1.2%>	
(ユーロ…ベルギー) VGP NV	19	296	39,303	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19 1	296 — <0.5%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	513 3	1,475 — <2.6%>	
(香港) GDS HOLDINGS LIMITED	566	千香港ドル 4,063	57,138	情報技術サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	566 1	4,063 — <0.8%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,361 7	— — <6.3%>	

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 邦貨換算金額欄の< >内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

国内投資信託証券

銘柄	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	口	千円	%
S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	805	115,839	1.5
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	169	57,122	0.8
ラサールレジポート投資法人 投資証券	448	77,548	1.0
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	176	78,232	1.0
オリックス不動産投資法人 投資証券	641	125,315	1.7
インヴェンシブル投資法人 投資証券	1,321	57,463	0.8
合 計	3,560	511,521	
	口 数 ・ 金 額		
	6	<6.8%>	

\*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄	当 期 末			比 率
	口 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	千米ドル	千円	%
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	13,488	629	68,737	0.9
AMERICOLD REALTY TRUST	19,609	743	81,255	1.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,026	1,009	110,206	1.5
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,402	351	38,352	0.5
CROWN CASTLE INTL CORP	3,967	721	78,856	1.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	81,099	930	101,597	1.3
EQUINIX INC	4,380	3,131	342,058	4.5
EQUITY RESIDENTIAL	29,485	2,181	238,209	3.2
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22,200	556	60,738	0.8
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,368	1,258	137,459	1.8
EXTRA SPACE STORAGE INC	13,201	1,922	209,942	2.8
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	7,056	1,218	133,130	1.8
INVITATION HOMES INC	82,745	2,910	317,845	4.2
IRON MOUNTAIN INC	25,940	1,129	123,384	1.6
KILROY REALTY CORP	16,241	1,081	118,137	1.6
KIMCO REALTY CORP	42,728	901	98,515	1.3
LIFE STORAGE INC	19,390	1,873	204,619	2.7
NETSTREIT CORP	27,422	586	64,093	0.9
PENNYMAC MORTGAGE INVESTMENT TRUST	22,166	424	46,337	0.6
POTLATCHDELTIC CORP	5,412	323	35,312	0.5
PROLOGIS INC	46,166	5,271	575,774	7.6
QTS REALTY TRUST INC CL A	17,702	1,101	120,296	1.6
REALTY INCOME CORP	26,124	1,708	186,603	2.5
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	15,611	842	91,986	1.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	26,725	3,266	356,806	4.7
SUN COMMUNITIES INC	9,739	1,596	174,392	2.3

銘柄	口数	当期末		比率
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	千米ドル	千円	%
UDR INC	51,264	2,378	259,796	3.4
URBAN EDGE PROPERTIES	45,333	861	94,123	1.2
VENTAS INC	20,818	1,129	123,395	1.6
VICI PROPERTIES INC	46,298	1,444	157,717	2.1
WELLTOWER INC	24,581	1,797	196,307	2.6
XENTIA HOTELS & RESORTS INC	31,016	596	65,176	0.9
小計	口数・金額	854,702	45,881	5,011,169
	銘柄数 < 比率 >	32	—	<66.5%>
(カナダ)		千カナダドル		
CHARTWELL RETIREMENT RESIDENCES	42,989	564	51,116	0.7
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,987	555	50,271	0.7
小計	口数・金額	49,976	1,119	101,387
	銘柄数 < 比率 >	2	—	<1.3%>
(イギリス)		千英ポンド		
SHAFTESBURY PLC	76,503	476	73,729	1.0
SEGRO PLC	87,660	875	135,360	1.8
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	264,368	449	69,508	0.9
WORKSPACE GROUP PLC	27,747	239	37,012	0.5
小計	口数・金額	456,278	2,041	315,611
	銘柄数 < 比率 >	4	—	<4.2%>
(ユーロ…フランス)		千ユーロ		
KLEPIERRE	33,434	757	100,632	1.3
ユーロ計	口数・金額	33,434	757	100,632
	銘柄数 < 比率 >	1	—	<1.3%>
(香港)		千香港ドル		
LINK REIT	160,000	11,576	162,758	2.2
小計	口数・金額	160,000	11,576	162,758
	銘柄数 < 比率 >	1	—	<2.2%>
(シンガポール)		千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	156,100	316	25,921	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	205,200	396	32,395	0.4
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	635,900	1,290	105,593	1.4
小計	口数・金額	997,200	2,003	163,910
	銘柄数 < 比率 >	3	—	<2.2%>
(オーストラリア)		千豪ドル		
GOODMAN GROUP	142,158	2,676	227,343	3.0
CHARTER HALL GROUP	85,793	1,155	98,147	1.3
SCENTRE GROUP	416,506	1,116	94,801	1.3
小計	口数・金額	644,457	4,948	420,293
	銘柄数 < 比率 >	3	—	<5.6%>
合計	口数・金額	3,196,047	—	6,275,763
	銘柄数 < 比率 >	46	—	<83.3%>

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。

\* 評価額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

<米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド>

下記は、米ドル建てESG先進国社債 マザーファンド全体(10,332,923千口)の内容です。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	85,580	92,522	10,105,286	95.9	—	92.7	3.2	—
合 計	85,580	92,522	10,105,286	95.9	—	92.7	3.2	—

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。  
 \* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。  
 \* 金額の単位未満は切り捨て。  
 \* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末						償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		債		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
アメリカ	%	千米ドル	千米ドル	千円			
普通社債券 (含む投資法人債券)							
AES CORP/THE	3.95	3,000	3,233	353,109		2030/7/15	
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR	4.5	1,000	1,149	125,539		2050/6/1	
ASHTAD CAPITAL INC	4.0	3,100	3,266	356,757		2028/5/1	
AVANGRID INC	3.8	2,530	2,808	306,728		2029/6/1	
BEST BUY CO INC	4.45	3,200	3,678	401,801		2028/10/1	
CMS ENERGY CORP	4.75	2,900	3,190	348,411		2050/6/1	
CNH INDUSTRIAL CAPITAL L	3.85	3,700	4,110	448,996		2027/11/15	
DELL INT LLC / EMC CORP	6.1	2,550	3,118	340,654		2027/7/15	
DOMINION ENERGY INC	4.65	2,950	3,112	339,919		2099/12/13	
E.ON INTL FINANCE BV	6.65	2,400	3,395	370,838		2038/4/30	
EDP FINANCE BV	1.71	1,000	975	106,535		2028/1/24	
ENEL FINANCE INTL NV	4.875	2,900	3,414	372,907		2029/6/14	
FEDEX CORP	4.05	3,400	3,679	401,885		2048/2/15	
GENERAL ELECTRIC CO	4.25	1,800	1,993	217,717		2040/5/1	
GENERAL MILLS INC	2.875	1,200	1,250	136,566		2030/4/15	
HASBRO INC	3.9	350	383	41,858		2029/11/19	
HEALTHPEAK PROPERTIES	2.875	3,600	3,699	404,113		2031/1/15	
HP INC	3.4	3,500	3,716	405,865		2030/6/17	
JABIL INC	3.6	3,050	3,276	357,907		2030/1/15	
KROGER CO	1.7	1,000	940	102,736		2031/1/15	
MCDONALD'S CORP	3.6	1,000	1,103	120,513		2030/7/1	
MOLSON COORS BREWING CO	4.2	1,500	1,591	173,814		2046/7/15	
NEXTERA ENERGY CAPITAL	2.25	3,600	3,561	388,961		2030/6/1	
NXP BV/NXP FDG/NXP USA	3.4	3,400	3,641	397,684		2030/5/1	



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

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	普通社債券 (含む投資法人債券)	RALPH LAUREN CORP	2.95	3,500	3,648	398,522	2030/6/15
		RAYTHEON TECH CORP	3.125	3,100	3,005	328,302	2050/7/1
		SSE PLC	4.75	2,500	2,594	283,339	2077/9/16
		STARBUCKS CORP	2.55	3,600	3,637	397,297	2030/11/15
		SYSCO CORPORATION	5.95	1,000	1,270	138,796	2030/4/1
		VENTAS REALTY LP/CAP CRP	4.4	2,600	2,945	321,692	2029/1/15
		VF CORP	2.95	1,300	1,357	148,276	2030/4/23
		WALGREENS BOOTS ALLIANCE	3.2	3,450	3,640	397,567	2030/4/15
		WEA FINANCE LLC/WESTFIEL	3.75	2,900	3,093	337,893	2024/9/17
		WELLTOWER INC	2.75	3,000	3,037	331,773	2031/1/15
合	計				10,105,286		

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<米ドル建てESG新興国債 マザーファンド>

下記は、米ドル建てESG新興国債 マザーファンド全体(4,399,713千口)の内容です。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	33,340	38,961	4,255,391	94.1	27.6	77.8	16.3	—
合 計	33,340	38,961	4,255,391	94.1	27.6	77.8	16.3	—

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

\* S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千米ドル	千米ドル	千円		
国債証券						
	ABU DHABI GOVT INT'L	3.125	200	217	23,788	2030/4/16
	ABU DHABI GOVT INT'L	4.125	1,420	1,655	180,791	2047/10/11
	BRAZIL GLOBAL	8.25	150	207	22,702	2034/1/20
	CHINA GOVT INTL BOND	1.95	300	314	34,356	2024/12/3
	CHINA GOVT INTL BOND	2.625	500	542	59,205	2027/11/2
	CHINA GOVT INTL BOND	1.2	1,200	1,139	124,438	2030/10/21
	COLOMBIA GLOBAL	7.375	1,090	1,433	156,611	2037/9/18
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2.875	400	411	44,911	2025/6/6
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.5	1,620	1,726	188,617	2029/5/30
	HUNGARY	5.75	580	655	71,597	2023/11/22
	INDONESIA GLOBAL	8.5	680	1,073	117,281	2035/10/12
	INDONESIA GLOBAL	6.625	950	1,280	139,850	2037/2/17
	KINGDOM OF BAHRAIN	6.125	200	216	23,626	2023/8/1
	KINGDOM OF BAHRAIN	7.0	1,540	1,772	193,615	2026/1/26
	MEXICO GLOBAL	6.75	1,450	1,903	207,909	2034/9/27
	OMAN GOV INTERNL BOND	4.875	1,820	1,905	208,123	2025/2/1
	OMAN GOV INTERNL BOND	4.75	400	416	45,435	2026/6/15
	OMAN GOV INTERNL BOND	7.375	400	457	49,980	2032/10/28
	PANAMA GLOBAL	8.875	1,260	1,749	191,091	2027/9/30
	PANAMA GLOBAL	6.7	300	402	43,965	2036/1/26
	PERU GLOBAL	6.55	1,230	1,670	182,441	2037/3/14
	REPUBLIC OF AZERBAIJAN	3.5	750	760	83,044	2032/9/1
	REPUBLIC OF CHILE	2.45	200	199	21,751	2031/1/31
	REPUBLIC OF CHILE	3.86	840	891	97,335	2047/6/21

## 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

銘柄	銘柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.875	200	213	23,319	2027/4/25
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.5	800	871	95,137	2029/3/15
		REPUBLIC OF PANAMA	3.16	200	209	22,848	2030/1/23
		REPUBLIC OF PERU	2.844	820	840	91,760	2030/6/20
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4.375	1,100	1,259	137,592	2027/10/27
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	7.625	80	120	13,180	2036/3/21
		ROMANIA	4.875	200	222	24,255	2024/1/22
		ROMANIA	3.0	850	870	95,032	2031/2/14
		STATE OF QATAR	5.75	1,240	1,718	187,711	2042/1/20
		STATE OF QATAR	5.103	200	259	28,309	2048/4/23
	UNITED MEXICAN STATES	3.75	400	434	47,495	2028/1/11	
	UNITED MEXICAN STATES	4.5	440	494	54,040	2029/4/22	
	特殊債券 (除く金融債)	BANCO CENTRAL COSTA RICA	4.375	1,000	1,026	112,088	2025/4/30
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	3.625	200	219	23,930	2024/7/31
		EXPORT IMPORT BANK CHINA	4.0	200	234	25,569	2047/11/28
		PETROLIAM NASIONAL BERHD	7.625	1,110	1,459	159,425	2026/10/15
	普通社債券 (含む投資法人債券)	CODELCO INC	3.75	400	432	47,268	2031/1/15
		CODELCO INC	5.625	760	990	108,225	2035/9/21
		CODELCO INC	5.625	200	258	28,207	2043/10/18
		KAZMUNAYGAS NATIONAL CO	5.375	1,460	1,734	189,413	2030/4/24
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR		5.375	600	692	75,597	2029/1/25	
PERUSAHAAN LISTRIK NEGAR		3.0	600	599	65,442	2030/6/30	
PETROLEOS MEXICANOS		5.35	600	592	64,722	2028/2/12	
PETROLEOS MEXICANOS	6.5	200	204	22,340	2029/1/23		
合 計					4,255,391		

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。