

【表紙】**【提出書類】**

半期報告書

【提出先】

関東財務局長殿

【提出日】

2020年8月11日提出

【計算期間】

第3期中（自 2019年11月12日 至 2020年5月11日）

【ファンド名】

リスクコントロール世界資産分散ファンド

【発行者名】

アセットマネジメントOne株式会社

【代表者の役職氏名】

取締役社長 菅野 暁

【本店の所在の場所】

東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【事務連絡者氏名】

酒井 隆

【連絡場所】

東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【電話番号】

03-6774-5100

【縦覧に供する場所】

該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	50,022,500,000	37.89
内 日本	50,022,500,000	37.89
親投資信託受益証券	41,100,102,703	31.13
内 日本	41,100,102,703	31.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	40,909,230,954	30.98
純資産総額	132,031,833,657	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	184,652,392,600	80.91
内 日本	184,652,392,600	80.91
地方債証券	16,818,713,000	7.37
内 日本	16,818,713,000	7.37
特殊債券	15,699,575,052	6.88
内 日本	15,699,575,052	6.88
社債券	9,586,376,810	4.20
内 日本	9,183,508,810	4.02
内 フランス	402,868,000	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,471,763,691	0.64
純資産総額	228,228,821,153	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	218,622,795,190	92.21
内 日本	218,622,795,190	92.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	18,471,224,167	7.79
純資産総額	237,094,019,357	100.00

その他資産の投資状況

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,331,780,000	2.25
内 日本	5,331,780,000	2.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		310,891,273,220	97.98
	内 アメリカ	144,414,409,331	45.51
	内 フランス	31,543,825,699	9.94
	内 イタリア	27,737,235,370	8.74
	内 ドイツ	22,868,220,832	7.21
	内 イギリス	20,599,107,277	6.49
	内 スペイン	18,579,459,121	5.86
	内 ベルギー	8,314,991,840	2.62
	内 オーストラリア	6,290,699,810	1.98
	内 オランダ	6,218,546,619	1.96
	内 カナダ	6,046,504,980	1.91
	内 オーストリア	4,547,331,021	1.43
	内 メキシコ	2,344,096,810	0.74
	内 アイルランド	1,943,521,808	0.61
	内 ポーランド	1,699,416,234	0.54
	内 フィンランド	1,515,203,680	0.48
	内 デンマーク	1,507,088,862	0.47
	内 シンガポール	1,217,960,396	0.38
	内 マレーシア	1,137,595,863	0.36
	内 イスラエル	991,987,755	0.31
	内 スウェーデン	727,550,617	0.23
	内 ノルウェー	646,519,295	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,422,321,376	2.02
純資産総額		317,313,594,596	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		320,796,394,111	94.05
	内 アメリカ	219,634,858,689	64.39
	内 イギリス	15,715,426,148	4.61
	内 スイス	12,441,404,119	3.65
	内 カナダ	11,350,660,898	3.33
	内 フランス	11,111,119,213	3.26
	内 ドイツ	9,806,581,695	2.88
	内 オーストラリア	6,806,643,700	2.00
	内 オランダ	5,965,802,031	1.75
	内 アイルランド	5,856,580,848	1.72
	内 スウェーデン	2,988,762,803	0.88
	内 スペイン	2,773,903,086	0.81
	内 香港	2,711,551,159	0.79
	内 デンマーク	2,562,117,795	0.75

内	イタリア	1,934,441,115	0.57
内	フィンランド	1,388,989,589	0.41
内	シンガポール	1,144,146,680	0.34
内	バミューダ	1,098,932,486	0.32
内	ジャージー	1,031,091,538	0.30
内	ベルギー	961,292,662	0.28
内	イスラエル	715,142,117	0.21
内	ケイマン諸島	636,505,863	0.19
内	ノルウェー	636,183,786	0.19
内	ニュージーランド	350,598,697	0.10
内	ルクセンブルグ	269,637,163	0.08
内	オランダ領キュラソー	234,594,901	0.07
内	オーストリア	202,182,832	0.06
内	ポルトガル	189,110,741	0.06
内	リベリア	78,247,161	0.02
内	パナマ	76,507,328	0.02
内	マン島	53,580,217	0.02
内	パプアニューギニア	48,430,942	0.01
内	イギリス領バージン諸島	21,366,109	0.01
投資信託受益証券		625,963,587	0.18
	内 オーストラリア	458,001,395	0.13
	内 シンガポール	167,962,192	0.05
投資証券		7,803,629,654	2.29
	内 アメリカ	7,202,768,985	2.11
	内 イギリス	179,285,529	0.05
	内 香港	136,376,775	0.04
	内 フランス	134,273,832	0.04
	内 オランダ	78,497,139	0.02
	内 カナダ	72,427,394	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,862,826,933	3.48
純資産総額		341,088,814,285	100.00

その他資産の投資状況

令和2年5月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）		11,744,374,381	3.44
	内 アメリカ	8,575,248,675	2.51
	内 ドイツ	1,911,736,292	0.56
	内 イギリス	593,904,038	0.17
	内 カナダ	402,344,376	0.12
	内 オーストラリア	261,141,000	0.08

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

J・REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	37,594,873,120	95.08

	内 日本	37,594,873,120	95.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,945,907,175	4.92
純資産総額		39,540,780,295	100.00

その他資産の投資状況

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	891,324,000	2.25
内 日本	891,324,000	2.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,719,487,849	10.63
内 オーストラリア	2,250,972,658	6.44
内 シンガポール	1,468,515,191	4.20
投資証券	30,887,124,968	88.31
内 アメリカ	26,038,187,735	74.45
内 イギリス	1,732,463,487	4.95
内 カナダ	633,529,813	1.81
内 香港	586,249,389	1.68
内 フランス	540,472,784	1.55
内 ベルギー	422,103,931	1.21
内 オランダ	319,165,158	0.91
内 スペイン	186,512,647	0.53
内 ニュージーランド	151,000,588	0.43
内 ドイツ	98,140,366	0.28
内 ガーンジー	86,547,239	0.25
内 アイルランド	47,467,557	0.14
内 イスラエル	24,386,165	0.07
内 マン島	8,711,705	0.02
内 韓国	6,636,287	0.02
内 イタリア	5,550,117	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	368,156,765	1.05
純資産総額	34,974,769,582	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	111,523,320,340	97.41
内 メキシコ	17,765,522,868	15.52
内 ロシア	15,759,980,859	13.77
内 インドネシア	14,911,114,250	13.02
内 コロンビア	11,524,309,245	10.07
内 ブラジル	11,304,187,377	9.87
内 フィリピン	10,465,528,616	9.14
内 南アフリカ	6,617,943,567	5.78
内 パナマ	6,270,403,715	5.48
内 ペルー	5,086,801,381	4.44
内 ハンガリー	4,796,591,896	4.19
内 ルーマニア	4,412,047,557	3.85
内 クロアチア	2,608,889,009	2.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,967,391,822	2.59
純資産総額	114,490,712,162	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	26,311,517,678	80.86
内 ケイマン諸島	6,266,659,950	19.26
内 中国	3,379,021,891	10.38
内 台湾	3,170,311,831	9.74
内 韓国	3,103,138,134	9.54
内 インド	2,359,295,232	7.25
内 ブラジル	1,339,197,975	4.12
内 南アフリカ	985,841,301	3.03
内 ロシア	917,642,492	2.82
内 香港	733,130,740	2.25
内 タイ	634,593,850	1.95
内 マレーシア	485,120,955	1.49
内 サウジアラビア	472,812,666	1.45
内 インドネシア	392,830,053	1.21
内 メキシコ	375,816,014	1.15
内 パミュータ	253,777,236	0.78
内 フィリピン	212,635,922	0.65
内 ポーランド	203,983,880	0.63
内 カタール	169,682,845	0.52
内 チリ	159,685,185	0.49
内 アラブ首長国連邦	157,405,444	0.48
内 トルコ	117,607,857	0.36
内 アメリカ	97,310,901	0.30
内 ハンガリー	67,067,053	0.21
内 コロンビア	49,452,647	0.15
内 ギリシャ	35,954,848	0.11

	内 ルクセンブルグ	33,618,724	0.10
	内 エジプト	31,119,665	0.10
	内 ジョージア	27,392,483	0.08
	内 オランダ	22,413,974	0.07
	内 チェコ	21,122,583	0.06
	内 マン島	13,126,290	0.04
	内 シンガポール	7,425,165	0.02
	内 ペルー	5,817,808	0.02
	内 アルゼンチン	5,408,566	0.02
	内 パキスタン	4,095,518	0.01
新株予約権証券		58,224	0.00
	内 タイ	58,224	0.00
投資信託受益証券		151,450,657	0.47
	内 メキシコ	115,627,011	0.36
	内 ブラジル	35,823,646	0.11
投資証券		28,425,387	0.09
	内 南アフリカ	14,623,895	0.04
	内 メキシコ	13,801,492	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,048,196,501	18.59
純資産総額		32,539,648,447	100.00

その他資産の投資状況

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,046,464,589	18.58
内 アメリカ	6,046,464,589	18.58

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（令和2年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	１口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	１口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （平成30年11月12日）	16,055	16,055	0.9834	0.9834
第2計算期間末 （令和1年11月11日）	63,143	63,143	1.0389	1.0389
令和1年5月末日	17,746	-	1.0118	-
6月末日	20,597	-	1.0257	-
7月末日	25,581	-	1.0319	-
8月末日	31,626	-	1.0507	-
9月末日	44,949	-	1.0484	-
10月末日	60,111	-	1.0434	-
11月末日	72,730	-	1.0456	-
12月末日	88,593	-	1.0447	-
令和2年1月末日	107,431	-	1.0542	-
2月末日	120,931	-	1.0434	-
3月末日	130,321	-	1.0123	-
4月末日	131,899	-	1.0128	-
5月末日	132,031	-	1.0140	-

【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
令和1年11月12日～令和2年5月11日	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.7
第2計算期間	5.6
令和1年11月12日～令和2年5月11日	2.5

（注）収益率は期間騰落率です。

２【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	17,241,080,294	914,894,367
第2計算期間	48,308,726,995	3,853,963,676
令和1年11月12日～ 令和2年5月11日	78,439,839,958	8,726,418,390

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

3【ファンドの経理状況】

- （１）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- （２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間（令和1年11月12日から令和2年5月11日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 令和1年11月11日現在	第3期中間計算期間末 令和2年5月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,113,628,953	46,932,561,143
国債証券	-	50,028,000,000
親投資信託受益証券	58,252,140,080	34,715,511,299
派生商品評価勘定	9,623,458	-
未収入金	-	1,140,538,711
流動資産合計	63,375,392,491	132,816,611,153
資産合計	63,375,392,491	132,816,611,153
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	39,748,904	17,799,957
未払金	-	16,290,377
未払解約金	19,841,342	78,975,292
未払受託者報酬	5,217,685	17,478,237
未払委託者報酬	166,967,475	559,304,939
その他未払費用	530,613	1,266,394
流動負債合計	232,306,019	691,115,196
負債合計	232,306,019	691,115,196
純資産の部		
元本等		
元本	60,780,949,246	130,494,370,814
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,362,137,226	1,631,125,143
（分配準備積立金）	493,757,030	456,016,389
元本等合計	63,143,086,472	132,125,495,957
純資産合計	63,143,086,472	132,125,495,957
負債純資産合計	63,375,392,491	132,816,611,153

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 平成30年11月13日 至 令和1年5月12日	第3期中間計算期間 自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	385,427,303	3,905,128,781
為替差損益	71,818,859	780,149,898
営業収益合計	457,246,162	3,124,978,883
営業費用		
支払利息	314,777	5,486,797
受託者報酬	2,541,426	17,478,237
委託者報酬	81,327,009	559,304,939
その他費用	332,634	1,272,334
営業費用合計	84,515,846	583,542,307
営業利益又は営業損失（ ）	372,730,316	3,708,521,190
経常利益又は経常損失（ ）	372,730,316	3,708,521,190
中間純利益又は中間純損失（ ）	372,730,316	3,708,521,190
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	45,924,458	83,840,115
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	270,434,510	2,362,137,226
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,526,327	3,255,981,574
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	40,598,939	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,927,388	3,255,981,574
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	362,312,582
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	362,312,582
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	102,897,675	1,631,125,143

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第3期中間計算期間	
	自 令和1年11月12日	至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期中間計算期間末
	令和1年11月11日現在	令和2年5月11日現在
1. 期首元本額	16,326,185,927円	60,780,949,246円
期中追加設定元本額	48,308,726,995円	78,439,839,958円
期中一部解約元本額	3,853,963,676円	8,726,418,390円
2. 受益権の総数	60,780,949,246口	130,494,370,814口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 令和1年11月11日現在	第3期中間計算期間末 令和2年5月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間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、中間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	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第2期			
	令和1年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	10,765,210,454	-	10,795,335,900	30,125,446
アメリカ・ドル	1,536,188,475	-	1,553,250,000	17,061,525
イギリス・ポンド	1,848,219,456	-	1,844,718,800	3,500,656
オーストラリア・ドル	1,844,219,097	-	1,854,547,500	10,328,403
カナダ・ドル	1,843,289,024	-	1,855,648,000	12,358,976
ユーロ	3,693,294,402	-	3,687,171,600	6,122,802
合計	10,765,210,454	-	10,795,335,900	30,125,446

種類	第3期中間計算期間末 令和2年5月11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	2,492,925,443	-	2,510,725,400	17,799,957
アメリカ・ドル	190,299,912	-	191,351,000	1,051,088
イギリス・ポンド	1,144,472,131	-	1,154,118,900	9,646,769
オーストラリア・ドル	580,744,080	-	584,560,800	3,816,720
カナダ・ドル	577,409,320	-	580,694,700	3,285,380
合計	2,492,925,443	-	2,510,725,400	17,799,957

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 令和1年11月11日現在	第3期中間計算期間末 令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0389円 (10,389円)	1.0125円 (10,125円)

（参考）

当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,968,992,966
国債証券	181,358,009,300
地方債証券	17,577,991,000
特殊債券	15,702,711,847
社債券	9,876,577,040
未収利息	417,954,051
前払費用	26,862,876
流動資産合計	227,929,099,080
資産合計	227,929,099,080
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,459,327,000
流動負債合計	2,459,327,000
負債合計	2,459,327,000
純資産の部	
元本等	
元本	171,890,787,271
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,578,984,809
元本等合計	225,469,772,080
純資産合計	225,469,772,080
負債純資産合計	227,929,099,080

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	176,800,196,123円
同期中追加設定元本額	61,320,489,781円
同期中一部解約元本額	66,229,898,633円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	19,170,323,122円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	58,765,912円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	58,706,805円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	13,974,609円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	824,255,105円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	235,495,520円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	20,914,441円
たわらノーロード 国内債券	10,637,702,601円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	690,581,945円
たわらノーロード バランス（堅実型）	239,171,604円
たわらノーロード バランス（標準型）	375,085,366円
たわらノーロード バランス（積極型）	44,926,622円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	17,395,750円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	463,938,386円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	441,945,351円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	104,311,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	8,222,133円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	6,643,137円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	9,223,379円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	11,008,531円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,093,218円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	231,259円
D I A M国内債券インデックスファンド＜DC年金＞	13,985,125,445円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞ 1安定型	6,698,328,172円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞ 2安定・成長型	8,807,200,875円
D I A Mバランス・ファンド＜DC年金＞ 3成長型	3,404,276,906円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,786,419,407円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,889,584,511円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	317,013,647円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	75,324,315円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,202,944,320円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,536,922円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	3,349,501,474円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	927,783,157円

D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国30)	203,004,179円
投資のソムリエ	6,755,207,584円
クルーズコントロール	772,283,506円
投資のソムリエ<DC年金>	650,795,263円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	2,950,121,600円
4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	350,975,540円
クルーズコントロール<DC年金>	880,213円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	2,156,128円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	7,399,322円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,268,066,596円
リスク抑制世界8 資産バランスファンド	12,080,728,726円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,987,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,333,805円
リスク抑制世界8 資産バランスファンド(DC)	11,617,556円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	9,973,451円
4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	322,227,216円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	867,012,621円
9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,358,188,706円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,027,146円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	455,295円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	651,485円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	480,677円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,401,009円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,102,131,950円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	574,578,764円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	327,868,981円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,293,250,059円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,271,883,975円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,324,036,938円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,297,786,997円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,308,458,386円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	2,429,108円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	198,474,958円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	143,993,175円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	53,536,255円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	125,866,386円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	59,430,093円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,135,556円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	71,415,218円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	156,624,271円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,291,396,842円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,411,267,510円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,489,759,729円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	474,733,428円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2（適格機関投資家限定）	219,505,381円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A（適格機関投資家限定）	2,604,646,337円
D I A M世界アセットバランスファンドV A（適格機関投資家向け）	221,388,986円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A（適格機関投資家限定）	12,337,885円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A（適格機関投資家限定）	50,302,490円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	2,367,137,591円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	70,157,758円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	519,051,604円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A（適格機関投資家限定）	881,990,280円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）	1,207,627,514円
D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家限定）	327,410,720円
D I A M国内バランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	104,863,390円
D I A Mバランス2 0 V A（適格機関投資家限定）	97,690,500円
D I A Mバランス4 0 V A（適格機関投資家限定）	704,369円
D I A Mバランス6 0 V A（適格機関投資家限定）	381,380円
O n eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,683,151,841円
計	171,890,787,271円
2. 受益権の総数	171,890,787,271口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.3117円
（1万口当たり純資産額）	(13,117円)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,699,241,869
株式	216,613,529,510
派生商品評価勘定	258,778,660
未収入金	3,068,781,698
未収配当金	2,342,559,530
流動資産合計	226,982,891,267
資産合計	226,982,891,267
負債の部	
流動負債	
前受金	153,140,100
未払解約金	4,787,084,000
流動負債合計	4,940,224,100
負債合計	4,940,224,100
純資産の部	
元本等	
元本	93,530,083,865
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	128,512,583,302
元本等合計	222,042,667,167
純資産合計	222,042,667,167
負債純資産合計	226,982,891,267

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,335,804,545円
同期中追加設定元本額	32,622,697,027円
同期中一部解約元本額	35,428,417,707円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	14,628,661,741円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,741,564,396円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,711,158円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	6,193,941円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	10,689,013円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	38,222,154円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	24,830,116円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,082,106円
たわらノーロード TOPIX	700,353,129円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	413,618,446円
たわらノーロード バランス（堅実型）	15,490,361円
たわらノーロード バランス（標準型）	91,466,760円
たわらノーロード バランス（積極型）	134,296,721円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	629,194円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	39,326,735円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	120,162,734円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	75,709,757円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	148,081,227円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	263,498円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,013,147円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	2,330,332円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,657,123円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	4,443,471円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,317,776,683円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	1,130,181,902円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,634,911,825円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,591,475,594円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	371,686,992円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,269,637,940円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,137,316,385円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	38,326,565円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,121,011,998円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	22,648,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	354,497,885円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	265,125,387円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	431,507,281円
投資のソムリエ	8,184,811,850円
クルーズコントロール	443,891,157円
投資のソムリエ<DC年金>	788,388,958円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	305,718,385円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	358,198,386円
クルーズコントロール<DC年金>	505,379円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,680,922円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	12,953,113円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	182,413,987円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,740,254,601円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	8,576,751円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,725,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,672,347円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	17,153,998円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	71,248,712円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	566,623,291円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	258,528,260円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,769,559円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	784,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,120,158円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	220,995円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	50,135,055円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	55,973,518円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	194,838,944円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	61,447,948円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	92,766,527円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	202,430,840円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,874,297円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	47,084,104円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,337,087円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,000,517円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,727,155円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	58,604,095円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	902,473,069円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	901,671,414円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,518,686,746円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	177,415,499円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	49,238,326円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	486,772,172円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	124,201,776円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	2,297,457円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	35,244,824円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	499,495,548円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	39,371,664円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	145,557,454円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	372,596,569円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	406,376,498円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	56,025,545円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	25,210,472円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	5,411,810円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	113,210円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	127,887円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	475,341,313円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,523,201,601円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	2,016,755,536円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	81,133,359円
計	93,530,083,865円
2 . 受益権の総数	93,530,083,865口
3 . 差入代用有価証券 株式	1,664,500,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	5,204,059,900	-	5,462,960,000	258,900,100
合計	5,204,059,900	-	5,462,960,000	258,900,100

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	2,374円
（1万口当たり純資産額）	(23,740円)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	16,052,448,477
コール・ローン	7,424,229,440
国債証券	294,103,818,790
派生商品評価勘定	1,575,953,468
未収利息	1,619,162,468
前払費用	401,943,623
流動資産合計	321,177,556,266
資産合計	321,177,556,266
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	85,480,201
未払金	14,091,410,912
未払解約金	1,755,000
流動負債合計	14,178,646,113
負債合計	14,178,646,113
純資産の部	
元本等	
元本	210,129,088,521
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	96,869,821,632
元本等合計	306,998,910,153
純資産合計	306,998,910,153
負債純資産合計	321,177,556,266

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	296,277,231,415円
同期中追加設定元本額	262,870,086,116円
同期中一部解約元本額	349,018,229,010円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券＜為替ヘッジあり＞	4,723,150,657円
たわらノーロード バランス（堅実型）	200,975,399円
たわらノーロード バランス（標準型）	472,620,337円
たわらノーロード バランス（積極型）	211,181,381円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	11,114,247円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	425,627,310円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	434,140,963円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	99,436,282円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	14,832,006円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	3,174,889円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	9,118,542円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	11,778,193円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	3,104,480円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,517,095円
投資のソムリエ	70,729,078,761円
投資のソムリエ＜DC年金＞	6,677,360,896円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	5,845,360,020円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	57,235,529,263円
ワールドアセットバランス（基本コース）	3,589,216,283円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,310,540,584円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	44,014,511円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	29,295,204円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	54,999,157円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	95,977,845円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	18,964,870,875円

9 資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	3,035,417,555円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	9,129,579円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	4,037,017円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	5,757,772円
外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	19,978,216,525円
先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	5,943,085,380円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	531,603,762円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	63,167,696円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	467,359,922円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	993,028,902円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	1,087,351,563円
DIAMバランス20VA（適格機関投資家限定）	26,305,404円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1212）（適格機関投資家限定）	669,642,502円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1303）（適格機関投資家限定）	2,151,634,247円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1306）（適格機関投資家限定）	2,849,045,051円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA（1309）（適格機関投資家限定）	115,290,464円
計	210,129,088,521円
2. 受益権の総数	210,129,088,521口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	306,518,785,806	-	305,064,198,506	1,454,587,300
アメリカ・ドル	143,382,160,575	-	143,413,414,546	31,253,971
イギリス・ポンド	20,510,056,188	-	20,206,284,483	303,771,705
イスラエル・シケル	1,185,033,708	-	1,170,332,768	14,700,940
オーストラリア・ドル	6,132,686,486	-	6,119,569,368	13,117,118
カナダ・ドル	5,857,687,711	-	5,838,743,295	18,944,416
シンガポール・ドル	1,359,073,798	-	1,353,721,516	5,352,282
スウェーデン・クローナ	858,123,523	-	856,006,788	2,116,735
デンマーク・クローネ	1,511,476,145	-	1,496,664,175	14,811,970
ノルウェー・クローネ	727,065,189	-	724,877,699	2,187,490
ポーランド・ズロチ	1,789,529,600	-	1,767,015,068	22,514,532
マレーシア・リンギット	1,035,720,882	-	1,032,982,200	2,738,682
メキシコ・ペソ	2,255,886,954	-	2,273,581,800	17,694,846
ユーロ	119,914,285,047	-	118,811,004,800	1,103,280,247
買建	5,969,030,000	-	6,004,915,967	35,885,967
アメリカ・ドル	3,690,270,000	-	3,703,338,205	13,068,205
ユーロ	2,278,760,000	-	2,301,577,762	22,817,762
合計	312,487,815,806	-	311,069,114,473	1,490,473,267

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.4610円
（1万口当たり純資産額）	（14,610円）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,088,288,445
株式	306,904,085,892
投資信託受益証券	570,965,011
投資証券	7,480,968,622
派生商品評価勘定	190,161,938
未収入金	8,315,619,726
未収配当金	429,941,267
差入委託証拠金	3,122,661,172
流動資産合計	339,102,692,073
資産合計	
339,102,692,073	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,025,981
前受金	5,421,542,062
未払金	211,807,036
未払解約金	12,645,791,000
流動負債合計	18,285,166,079
負債合計	
18,285,166,079	
純資産の部	
元本等	
元本	92,726,631,098
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	228,090,894,896
元本等合計	320,817,525,994
純資産合計	320,817,525,994
負債純資産合計	339,102,692,073

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	90,492,519,767円
同期中追加設定元本額	20,860,263,428円
同期中一部解約元本額	18,626,152,097円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	4,977,283,313円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	3,443,607円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	11,383,730円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	12,730,791円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	48,543,130円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	45,630,569円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	19,155,456円
たわらノーロード 先進国株式	14,066,139,439円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	124,834,296円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,893,643,476円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	283,175,064円
たわらノーロード バランス(堅実型)	30,356,898円
たわらノーロード バランス(標準型)	233,071,860円
たわらノーロード バランス(積極型)	280,472,320円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	962,083円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	112,700,244円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	274,323,448円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	171,964,179円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	299,807,401円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	89,092円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,233,650円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,927,958円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,960,914円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,126,602円
たわらノーロード 全世界株式	57,585,091円
D I A M外国株式インデックスファンド<D C年金>	44,062,458,386円
O n e D C 先進国株式インデックスファンド	243,406,885円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 1安定型	198,233,231円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 2安定・成長型	981,732,765円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 3成長型	1,168,180,193円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	124,067,315円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	366,859,098円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	305,189,382円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,179,401円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	822,239,250円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	179,025,158円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	244,994,360円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	182,686,407円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	288,487,295円
投資のソムリエ	1,160,395,950円
クルーズコントロール	151,798,298円
投資のソムリエ<D C年金>	111,749,568円
D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金>	215,592,601円
4資産分散投資・ハイクラス<D C年金>	115,175,589円
クルーズコントロール<D C年金>	172,908円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	827,983円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	2,226,157円
投資のソムリエ<D C年金>リスク抑制型	81,878,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	779,584,572円
ワールドアセットバランス(基本コース)	439,823,625円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	298,326,639円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	857,236円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	572,790円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	749,012円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,713,773円
4資産分散投資・スタンダード<D C年金>	24,382,030円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	227,788,422円

9 資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	175,819,469円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	176,737円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	78,833円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	112,827円
4 資産分散投資・ミドルクラス＜DC年金＞	76,569円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019 - 12（適格機関投資家限定）	1,458,874円
MSCIコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	263,347,847円
DIAM外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	86,085,641円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	1,773,575,252円
DIAM先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	9,245,416,513円
外国株式パッシブ・ファンド2（適格機関投資家限定）	205,910,044円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	16,196,082円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,951,920円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	62,682,650円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	136,747,695円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	8,697,685円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	47,732,962円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	4,503,150円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	4,953,955円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	18,055,438円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	59,396,754円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	406,579,503円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	533,309,090円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,702,673,497円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	596,707,398円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2（適格機関投資家限定）	99,286,740円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	658,431,312円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	27,948,895円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	7,009,193円
DIAM世界バランスファンド35VA（適格機関投資家限定）	9,527,191円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	224,948,025円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	26,605,559円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	98,393,384円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	167,850,599円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	274,715,654円
DIAMバランス20VA（適格機関投資家限定）	11,278,545円
DIAMバランス40VA（適格機関投資家限定）	229,211円
DIAMバランス60VA（適格機関投資家限定）	260,737円
計	92,726,631,098円
2. 受益権の総数	92,726,631,098口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
----	-------------

1 .	貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2 .	時価の算定方法	(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3 .	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	722,357,598	-	727,958,400	5,600,802
イギリス・ポンド	630,491,205	-	635,639,400	5,148,195
デンマーク・クローネ	75,744,200	-	76,195,000	450,800
ユーロ	16,122,193	-	16,124,000	1,807
買建	35,798,680	-	35,798,160	520
アメリカ・ドル	30,584,840	-	30,584,840	-
オーストラリア・ドル	1,606,872	-	1,607,010	138
カナダ・ドル	3,606,968	-	3,606,310	658
合計	758,156,278	-	763,756,560	5,601,322

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,549,856,046	-	5,739,593,325	189,737,279
合計	5,549,856,046	-	5,739,593,325	189,737,279

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	3.4598円
（1万口当たり純資産額）	(34,598円)

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,082,189,018
投資証券	37,591,113,030
派生商品評価勘定	5,788,650
未収配当金	279,111,169
前払金	90,682,000
差入委託証拠金	105,062,000
流動資産合計	50,153,945,867
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	83,428,290
未払金	11,149,159,714
未払解約金	370,919,000
流動負債合計	11,603,507,004
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	20,464,359,150
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,086,079,713
元本等合計	38,550,438,863
純資産合計	38,550,438,863
負債純資産合計	50,153,945,867

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,448,816,585円
同期中追加設定元本額	17,346,441,166円
同期中一部解約元本額	14,330,898,601円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド（安定型）	378,112円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,263,381円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	1,402,669円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	5,322,154円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	5,059,919円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,113,621円
たわらノーロード 国内リート	3,828,411,852円
たわらノーロード 国内リート＜ラップ向け＞	782,914,155円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	536,532,143円
たわらノーロード バランス（堅実型）	10,039,142円
たわらノーロード バランス（標準型）	169,483,917円
たわらノーロード バランス（積極型）	174,212,336円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	91,454,502円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	178,937,223円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	91,286,228円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	122,636,568円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,422,066円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	4,844,626円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,383,182円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	4,849,745円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,809,922円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	344,889,012円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	121,041,592円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	128,615,446円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	230,121,833円
投資のソムリエ	4,780,125,027円
投資のソムリエ<DC年金>	460,767,407円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	116,385,910円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	74,908,386円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	712,976,935円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	3,529,856円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,360,423円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	684,415円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,059,712円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	224,997,898円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	103,278,415円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	727,528円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	323,346円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	463,462円
Jリートインデックスファンド(DC)	28,416,200円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	85,872,687円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	776,201,858円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	70,945,024円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	174,025,929円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	5,227,622,000円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	11,905,437円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	86,413,425円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	658,204,822円
計	20,464,359,150円
2. 受益権の総数	20,464,359,150口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	955,544,000	-	877,962,000	77,582,000
合計	955,544,000	-	877,962,000	77,582,000

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.8838円
(1万口当たり純資産額)	(18,838円)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	5,885,942,611
コール・ローン	1,780,252,059
投資信託受益証券	3,286,499,679
投資証券	29,350,450,779
派生商品評価勘定	8,444,757
未収入金	5,140,065
未収配当金	39,480,450
流動資産合計	40,356,210,400
資産合計	40,356,210,400
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,751
未払金	7,335,490,825
未払解約金	176,106,000
流動負債合計	7,511,626,576
負債合計	7,511,626,576
純資産の部	
元本等	
元本	31,952,777,143
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	891,806,681
元本等合計	32,844,583,824
純資産合計	32,844,583,824
負債純資産合計	40,356,210,400

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,743,134,014円
同期中追加設定元本額	33,540,797,520円
同期中一部解約元本額	41,331,154,391円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	76,819,261円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	32,743,796円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,070,177円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	20,094,008円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	22,416,966円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	85,401,591円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	80,522,698円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	33,732,261円
たわらノーロード 先進国リート	5,913,532,150円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	770,756,680円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	253,166,983円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	960,986,227円
たわらノーロード バランス（堅実型）	8,989,804円

たわらノーロード バランス（標準型）	151,670,843円
たわらノーロード バランス（積極型）	287,812,752円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	65,313,896円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	233,550,690円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	152,704,662円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	267,043,209円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,797,416円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	5,908,852円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	3,982,882円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	10,438,315円
One DC 先進国リートインデックスファンド	49,146,216円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	20,914,119円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	613,134,632円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	67,093,669円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	220,950,023円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	230,365,659円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	392,983,551円
投資のソムリエ	3,927,432,217円
投資のソムリエ＜DC年金＞	378,787,879円
DIAM 8資産バランスファンドN＜DC年金＞	207,835,560円
投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型	277,113,238円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,636,562,999円
ワールドアセットバランス（基本コース）	812,123,062円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	557,429,997円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	2,900,718円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	1,933,812円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	2,531,898円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	5,801,436円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	883,051,813円
9資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	178,910,790円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	598,087円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	269,139円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	378,788円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	725,528,421円
DIAM外国リートインデックスファンド＜DC年金＞	89,903,657円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）20 - 04 （適格機関投資家限定）	660,813,403円
DIAM世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	183,586,741円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	368,452,198円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格 機関投資家限定）	4,035,962,084円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,418,271,468円
DIAM海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	556,553,750円
計	31,952,777,143円
2. 受益権の総数	31,952,777,143口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	17,270,071	-	17,269,200	871
イギリス・ポンド	17,270,071	-	17,269,200	871
買建	1,566,744,165	-	1,575,158,300	8,414,135
アメリカ・ドル	211,761,198	-	211,741,200	19,998
イギリス・ポンド	388,618,250	-	391,878,000	3,259,750
オーストラリア・ドル	451,274,850	-	454,155,000	2,880,150
カナダ・ドル	767,404	-	767,300	104
シンガポール・ドル	299,935,400	-	301,126,800	1,191,400
ニュージーランド・ドル	33,151,599	-	33,456,000	304,401
ユーロ	13,919,964	-	13,920,000	36
韓国・ウォン	2,624,100	-	2,634,000	9,900
香港・ドル	164,691,400	-	165,480,000	788,600
合計	1,584,014,236	-	1,592,427,500	8,415,006

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.0279円
（1万口当たり純資産額）	（10,279円）

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	1,461,142,442
コール・ローン	8,924,322,000
国債証券	118,205,774,545
派生商品評価勘定	48,265,162
未収利息	632,398,424
前払費用	661,757,581
流動資産合計	129,933,660,154
資産合計	129,933,660,154
負債の部	
流動負債	
未払金	9,248,172,914
未払解約金	90,400,000
流動負債合計	9,338,572,914
負債合計	9,338,572,914
純資産の部	
元本等	
元本	62,293,745,764
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,301,341,476
元本等合計	120,595,087,240
純資産合計	120,595,087,240
負債純資産合計	129,933,660,154

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	74,574,074,462円
同期中追加設定元本額	52,195,116,630円
同期中一部解約元本額	64,475,445,328円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファン ドラップ）	142,095,953円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	497,846,059円
たわらノーロード バランス（堅実型）	37,272,463円
たわらノーロード バランス（標準型）	94,321,617円
たわらノーロード バランス（積極型）	37,283,036円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	490,182円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,759,215円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	2,479,524円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	855,921円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	971,203円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	44,240,071円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	196,333,833円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	204,014,159円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	376,267,256円
投資のソムリエ	9,472,029,318円
クルーズコントロール	262,178,890円
投資のソムリエ＜D C年金＞	907,171,046円
D I A M 8資産バランスファンドN＜D C年金＞	171,006,640円
クルーズコントロール＜D C年金＞	298,079円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	1,431,478円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	3,833,238円
投資のソムリエ＜D C年金＞リスク抑制型	286,981,500円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,761,296,758円
ワールドアセットバランス（基本コース）	843,793,149円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	490,833,333円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	8,732,849円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	5,821,558円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,677,343円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	17,858,357円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	778,713,341円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	153,959,190円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	1,807,130円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	776,899円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	1,139,382円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	29,437,338,002円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,999,410,798円
エマージング債券パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	81,017,792円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	204,618,595円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	152,593,821円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	5,822,875,061円
Ｐ－Ｏｎｅマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,787,321,725円
計	62,293,745,764円
２． 受益権の総数	62,293,745,764口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	8,700,000,000	-	8,748,265,162	48,265,162
アメリカ・ドル	8,700,000,000	-	8,748,265,162	48,265,162
合計	8,700,000,000	-	8,748,265,162	48,265,162

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.9359円
（1万口当たり純資産額）	(19,359円)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年5月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	3,984,855,675
コール・ローン	186,231,719
株式	18,489,127,109
新株予約権証券	63,037
投資信託受益証券	106,832,092
投資証券	21,319,294
派生商品評価勘定	482,384,280
未収入金	14,544,155,385
未収配当金	35,601,457
差入委託証拠金	3,767,029,830
流動資産合計	41,617,599,878
資産合計	41,617,599,878
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	68,504,589
未払解約金	10,640,133,000
流動負債合計	10,708,637,589
負債合計	10,708,637,589
純資産の部	
元本等	
元本	31,698,326,158
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	789,363,869
元本等合計	30,908,962,289
純資産合計	30,908,962,289
負債純資産合計	41,617,599,878

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,960,776,794円
同期中追加設定元本額	31,782,970,782円
同期中一部解約元本額	43,045,421,418円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	6,114,951,458円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	312,140,494円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,557,532円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	8,945,691円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	9,485,481円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	36,009,969円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	35,858,209円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,272,399円
たわらノーロード 新興国株式	6,120,334,150円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,874,924,475円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	996,765,303円
たわらノーロード バランス（堅実型）	9,334,629円
たわらノーロード バランス（標準型）	31,495,559円
たわらノーロード バランス（積極型）	49,796,903円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	509,166円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	74,231,031円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	149,462,821円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	115,737,088円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	178,003,502円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	506,796円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	2,403,994円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,327,626円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	3,166,850円
たわらノーロード 全世界株式	29,022,132円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	27,406,835円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	441,719,912円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	398,227,441円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	408,461,199円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	719,736,522円
投資のソムリエ	3,806,568,871円
クルーズコントロール	530,462,496円
投資のソムリエ< D C 年金>	366,993,570円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	363,111,843円
クルーズコントロール< D C 年金>	603,694円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	7,287,401円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	19,375,965円
投資のソムリエ< D C 年金> リスク抑制型	280,168,365円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,663,010,754円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,464,721,356円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	915,052,973円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	2,853,566円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	1,909,274円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（D C）	2,562,793円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	5,869,563円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	921,195,026円
9 資産分散投資・スタンダード＜DC年金＞	312,215,429円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	589,862円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	262,783円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	374,022円
エマージング株式パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	164,289,978円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	402,169,826円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	299,881,581円
計	31,698,326,158円
2. 受益権の総数	31,698,326,158口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は789,363,869円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	11,180,944,774	-	11,249,133,326	68,188,552
アメリカ・ドル	10,556,407,350	-	10,614,971,340	58,563,990
チェコ・コルナ	16,960,000	-	17,040,000	80,000
チリ・ペソ	22,379	-	22,713	334
ブラジル・レアル	175,045	-	179,273	4,228
南アフリカ・ランド	607,380,000	-	616,920,000	9,540,000
買建	624,537,424	-	627,904,954	3,367,530
アメリカ・ドル	624,537,424	-	627,904,954	3,367,530
合計	11,805,482,198	-	11,877,038,280	64,821,022

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	11,789,576,566	-	12,268,277,279	478,700,713
合計	11,789,576,566	-	12,268,277,279	478,700,713

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	0.9751円
（1万口当たり純資産額）	(9,751円)

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

（2020年5月29日現在）

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

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

2020年5月29日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,160,565,284,561
追加型株式投資信託	863	13,062,656,894,856
単位型公社債投資信託	36	97,205,646,710
単位型株式投資信託	185	1,287,535,891,479
合計	1,110	15,607,963,717,606

（３）【その他】

（１）定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

（２）訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

5【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第35期事業年度（自2019年4月1日至2020年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産	1,461,316	1,278,455
建物	1 1,096,916	1 1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア	885,545	3,299,065
ソフトウェア仮勘定	1,522,040	221,784
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産	9,269,808	9,482,127
投資有価証券	1,611,931	261,361
関係会社株式	4,499,196	5,299,196
長期差入保証金	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

（単位：千円）

	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第34期 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）		第35期 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

（単位：千円）

	第34期 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）		第35期 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

（３）【株主資本等変動計算書】

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発 積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備 積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余 金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純額）		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	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	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

重要な会計方針

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1．有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第34期 （2019年3月31日現在）	第35期 （2020年3月31日現在）
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

（損益計算書関係）

1．固定資産除却損の内訳

（千円）

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

（株主資本等変動計算書関係）

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類 株式				

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種 類株式					

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2020年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第34期（2019年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
（1）現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
（2）金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
（3）未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
（4）未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
（5）有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
（1）未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

第35期（2020年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
（1）現金・預金	32,932,013	32,932,013	-
（2）金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
（3）未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
（4）未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
（5）有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
（1）未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(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

第34期（2019年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

第35期（2020年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,764千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第35期（2020年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

（注）非上場株式（貸借対照表計上額259,369千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

区分	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

区分	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
株式	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～4.42%	1.00%～4.42%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額（一括償却資産）	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額（税法上）	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因	被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。	
c. のれんの償却方法及び償却期間	20年間の均等償却	

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円
（注）固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）及び第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手数料	6,048,352	未払手数料	915,980
								子会社株式の取得	1,270,000	-	-
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手数料	10,215,017	未払手数料	1,670,194

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手数料	5,793,912	未払手数料	1,112,061
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手数料	10,294,840	未払手数料	1,231,431

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（注2）子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

（注3）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

（1株当たり情報）

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27銭

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）	第35期 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

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

独立監査人の監査報告書

2020年5月27日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩	印
--------------------	-------	------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬	印
--------------------	-------	-------	---

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2020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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

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）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

令和2年6月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

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」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの令和1年11月12日から令和2年5月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの令和2年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和1年11月12日から令和2年5月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（注１）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注２）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。