

【表紙】**【提出書類】**

半期報告書

【提出先】

関東財務局長

【提出日】

2019年10月11日

【計算期間】

第10期中（自 2019年1月12日 至 2019年7月11日）

【ファンド名】

マネックス資産設計ファンド エボリューション

【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1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,542,424,531	98.43
内 日本	1,542,424,531	98.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	24,646,543	1.57
純資産総額	1,567,071,074	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）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	252,559,347,270	98.94
内 日本	252,559,347,270	98.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,709,976,574	1.06
純資産総額	255,269,323,844	100.00

その他資産の投資状況

令和1年7月31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）	2,161,080,000	0.85
内 日本	2,161,080,000	0.85

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		225,319,013,800	80.78
	内 日本	225,319,013,800	80.78
地方債証券		21,493,873,077	7.71
	内 日本	21,493,873,077	7.71
特殊債券		17,853,877,085	6.40
	内 日本	17,853,877,085	6.40
社債券		12,647,918,480	4.53
	内 日本	12,241,648,480	4.39
	内 フランス	406,270,000	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,625,626,020	0.58
純資産総額		278,940,308,462	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券		34,920,446,660	97.48
	内 日本	34,920,446,660	97.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		902,208,858	2.52
純資産総額		35,822,655,518	100.00

その他資産の投資状況

令和1年7月31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）		704,106,000	1.97
	内 日本	704,106,000	1.97

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		334,034,241,390	95.59
	内 アメリカ	219,175,912,208	62.72
	内 イギリス	20,192,242,035	5.78
	内 カナダ	12,852,836,732	3.68
	内 スイス	12,539,641,086	3.59
	内 フランス	12,467,409,944	3.57
	内 ドイツ	10,499,528,786	3.00
	内 オーストラリア	8,135,675,217	2.33
	内 アイルランド	6,210,441,298	1.78
	内 オランダ	6,148,126,036	1.76
	内 スペイン	3,577,617,782	1.02
	内 香港	3,431,974,180	0.98
	内 スウェーデン	2,963,749,165	0.85
	内 イタリア	2,337,239,547	0.67
	内 デンマーク	2,081,179,578	0.60
	内 シンガポール	1,545,701,669	0.44
	内 フィンランド	1,406,392,865	0.40
	内 パミュダ	1,380,386,212	0.40
	内 ベルギー	1,285,624,598	0.37
	内 ジャージー	1,205,405,656	0.34
	内 ケイマン諸島	871,331,051	0.25
	内 ノルウェー	802,678,870	0.23
	内 イスラエル	756,340,133	0.22
	内 オランダ領キュラソー	486,052,654	0.14
	内 ルクセンブルグ	364,299,849	0.10
	内 ニュージーランド	324,879,052	0.09
	内 オーストリア	287,812,879	0.08
	内 ポルトガル	183,577,943	0.05
	内 パナマ	183,071,119	0.05
	内 リベリア	177,361,236	0.05
	内 パプアニューギニア	55,698,411	0.02
	内 イギリス領バージン諸島	47,248,029	0.01
	内 マン島	39,799,275	0.01
	内 モーリシャス	17,006,295	0.00
投資信託受益証券		849,554,851	0.24
	内 オーストラリア	695,960,213	0.20
	内 シンガポール	153,594,638	0.04
投資証券		8,335,330,591	2.39
	内 アメリカ	7,479,909,402	2.14
	内 香港	221,673,982	0.06
	内 イギリス	199,338,367	0.06
	内 フランス	194,899,615	0.06
	内 オランダ	165,421,259	0.05
	内 カナダ	74,087,966	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,214,585,610	1.78

純資産総額	349,433,712,442	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）		11,208,670	0.00
	-	11,208,670	0.00
為替予約取引（売建）		420,281,580	0.12
	-	420,281,580	0.12
株価指数先物取引（買建）		5,700,354,583	1.63
	内 アメリカ	4,041,547,874	1.16
	内 ドイツ	943,191,472	0.27
	内 イギリス	340,561,782	0.10
	内 カナダ	210,621,665	0.06
	内 オーストラリア	164,431,790	0.05

（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）為替予約取引の時価は、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で評価しています。

（注4）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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		171,768,471,690	97.58
	内 アメリカ	81,457,669,096	46.27
	内 フランス	17,597,527,382	10.00
	内 イタリア	15,584,046,463	8.85
	内 ドイツ	10,852,889,864	6.17
	内 イギリス	10,469,026,414	5.95
	内 スペイン	10,019,394,442	5.69
	内 ベルギー	4,487,419,474	2.55
	内 オーストラリア	3,435,009,518	1.95
	内 オランダ	3,372,026,749	1.92
	内 カナダ	3,240,919,404	1.84
	内 オーストリア	2,539,175,571	1.44
	内 アイルランド	1,274,988,670	0.72
	内 メキシコ	1,241,367,816	0.71
	内 フィンランド	1,095,628,150	0.62
	内 ポーランド	1,043,218,584	0.59
	内 南アフリカ	963,277,993	0.55
	内 デンマーク	784,760,451	0.45
	内 マレーシア	750,051,519	0.43
	内 シンガポール	652,682,063	0.37
	内 スウェーデン	526,182,490	0.30
	内 ノルウェー	381,209,577	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,268,094,002	2.42
純資産総額		176,036,565,692	100.00

その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）		659,508,728	0.37
	-	659,508,728	0.37

（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）為替予約取引の時価は、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1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券		5,046,926,579	10.77
	内 オーストラリア	3,321,360,708	7.09
	内 シンガポール	1,700,075,503	3.63
	内 カナダ	25,490,368	0.05
投資証券		41,550,450,623	88.70
	内 アメリカ	34,044,181,142	72.68
	内 イギリス	2,137,083,128	4.56
	内 香港	1,077,391,543	2.30
	内 フランス	1,021,190,052	2.18
	内 カナダ	885,451,476	1.89
	内 オランダ	847,481,029	1.81
	内 ベルギー	467,078,812	1.00
	内 スペイン	328,093,865	0.70
	内 ニュージーランド	231,959,219	0.50
	内 ドイツ	127,765,981	0.27
	内 アイルランド	122,164,860	0.26
	内 シンガポール	114,769,069	0.25
	内 ガーンジー	76,679,099	0.16
	内 イスラエル	36,912,923	0.08
	内 マン島	14,837,239	0.03
	内 イタリア	11,283,122	0.02
	内 韓国	6,128,064	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		245,811,610	0.52
純資産総額		46,843,188,812	100.00

その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）		88,976,800	0.19
	-	88,976,800	0.19

（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）為替予約取引の時価は、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で評価しています。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		52,188,012,363	88.49
	内 ケイマン諸島	8,911,169,043	15.11
	内 韓国	6,313,805,523	10.71
	内 中国	5,865,540,806	9.95
	内 台湾	5,841,421,571	9.91
	内 インド	4,568,184,025	7.75
	内 ブラジル	4,258,576,963	7.22
	内 南アフリカ	3,043,509,018	5.16
	内 ロシア	2,040,413,063	3.46

内 香港	1,758,997,841	2.98
内 タイ	1,558,530,912	2.64
内 インドネシア	1,157,125,667	1.96
内 マレーシア	1,116,240,962	1.89
内 メキシコ	1,044,449,005	1.77
内 フィリピン	614,600,101	1.04
内 ポーランド	560,273,527	0.95
内 バミューダ	542,095,989	0.92
内 カタール	534,831,729	0.91
内 チリ	484,685,018	0.82
内 アラブ首長国連邦	406,784,696	0.69
内 トルコ	302,231,946	0.51
内 コロンビア	226,643,373	0.38
内 アメリカ	186,826,758	0.32
内 ギリシャ	165,935,117	0.28
内 ハンガリー	154,040,712	0.26
内 アルゼンチン	153,685,168	0.26
内 チェコ	80,062,484	0.14
内 エジプト	67,867,364	0.12
内 ルクセンブルグ	55,669,418	0.09
内 オランダ	43,653,766	0.07
内 ペルー	34,932,787	0.06
内 ジャージー	31,162,076	0.05
内 マン島	28,201,962	0.05
内 シンガポール	20,426,425	0.03
内 パキスタン	15,437,548	0.03
新株予約権証券	560,098	0.00
内 タイ	560,098	0.00
投資信託受益証券	974,630,871	1.65
内 アイルランド	746,138,101	1.27
内 メキシコ	228,492,770	0.39
投資証券	35,466,950	0.06
内 メキシコ	35,466,950	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,774,708,763	9.79
純資産総額	58,973,379,045	100.00

その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）		176,944,730	0.30
	-	176,944,730	0.30
株価指数先物取引（買建）		5,589,536,691	9.48
	内 アメリカ	5,589,536,691	9.48

（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）為替予約取引の時価は、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で評価しています。

（注4）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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		91,145,440,884	96.33
	内 メキシコ	14,061,343,313	14.86
	内 ブラジル	11,036,001,668	11.66
	内 インドネシア	10,934,013,365	11.56
	内 ロシア	10,713,057,754	11.32
	内 コロンビア	9,768,619,704	10.32
	内 フィリピン	8,142,169,284	8.61
	内 南アフリカ	5,471,964,414	5.78
	内 ハンガリー	5,256,699,579	5.56
	内 パナマ	4,773,487,329	5.04
	内 ペルー	4,207,676,412	4.45
	内 ルーマニア	3,767,292,004	3.98
	内 クロアチア	3,013,116,058	3.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,475,087,026	3.67
純資産総額		94,620,527,910	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。

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（令和1年7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23年1月11日)	251	251	1.0795	1.0795
第2計算期間末 (平成24年1月11日)	413	413	0.9400	0.9400
第3計算期間末 (平成25年1月11日)	552	552	1.2495	1.2495
第4計算期間末 (平成26年1月14日)	760	760	1.5426	1.5426
第5計算期間末 (平成27年1月13日)	1,260	1,260	1.8245	1.8245
第6計算期間末 (平成28年1月12日)	1,328	1,328	1.6123	1.6123
第7計算期間末 (平成29年1月11日)	1,504	1,504	1.8427	1.8427
第8計算期間末 (平成30年1月11日)	1,624	1,624	2.2013	2.2013
第9計算期間末 (平成31年1月11日)	1,440	1,440	1.9238	1.9238
平成30年7月末日	1,583	-	2.1247	-
8月末日	1,586	-	2.1244	-
9月末日	1,616	-	2.1686	-
10月末日	1,474	-	1.9803	-
11月末日	1,534	-	2.0474	-
12月末日	1,400	-	1.8829	-
平成31年1月末日	1,500	-	1.9955	-
2月末日	1,563	-	2.0875	-
3月末日	1,560	-	2.0917	-
4月末日	1,600	-	2.1626	-
令和1年5月末日	1,495	-	2.0177	-
6月末日	1,550	-	2.0923	-
7月末日	1,567	-	2.1236	-

【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
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	8.0
第2計算期間	12.9
第3計算期間	32.9
第4計算期間	23.5
第5計算期間	18.3
第6計算期間	11.6
第7計算期間	14.3
第8計算期間	19.5
第9計算期間	12.6
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	10.3

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

2【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	269,849,173	36,948,684
第2計算期間	306,401,840	98,947,769
第3計算期間	166,526,568	164,650,415
第4計算期間	401,888,372	351,206,799
第5計算期間	349,195,243	151,369,883
第6計算期間	321,028,252	187,743,422
第7計算期間	144,022,619	151,648,359
第8計算期間	120,096,408	198,602,077
第9計算期間	109,103,259	98,422,624
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	36,335,248	45,448,493

（注1） 本邦外における設定及び解約はございません。

（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、当中間計算期間（平成31年1月12日から令和1年7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

【マネックス資産設計ファンド エボリューション】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 平成31年1月11日現在	第10期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	37,126,528	31,185,897
親投資信託受益証券	1,409,982,073	1,550,155,636
流動資産合計	1,447,108,601	1,581,341,533
資産合計	1,447,108,601	1,581,341,533
負債の部		
流動負債		
未払解約金	449,357	8,044,178
未払受託者報酬	462,373	331,021
未払委託者報酬	6,057,334	4,221,371
その他未払費用	32,304	31,353
流動負債合計	7,001,368	12,627,923
負債合計	7,001,368	12,627,923
純資産の部		
元本等		
元本	1,748,571,702	1,739,458,457
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	691,535,531	829,255,153
（分配準備積立金）	366,107,871	344,430,015
元本等合計	1,440,107,233	1,568,713,610
純資産合計	1,440,107,233	1,568,713,610
負債純資産合計	1,447,108,601	1,581,341,533

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日	第10期中間計算期間 自 平成31年1月12日 至 令和1年7月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	59,796,855	152,841,563
その他収益	5,749	4,578
営業収益合計	59,791,106	152,846,141
営業費用		
支払利息	13,160	10,135
受託者報酬	581,502	331,021
委託者報酬	7,726,162	4,221,371
その他費用	33,176	31,353
営業費用合計	8,354,000	4,593,880
営業利益又は営業損失（ ）	68,145,106	148,252,261
経常利益又は経常損失（ ）	68,145,106	148,252,261
中間純利益又は中間純損失（ ）	68,145,106	148,252,261
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（ ）	4,807,208	7,393,970
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	886,459,932	691,535,531
剰余金増加額又は欠損金減少額	68,795,332	38,995,082
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	68,795,332	38,995,082
剰余金減少額又は欠損金増加額	65,822,312	42,133,751
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	65,822,312	42,133,751
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	826,095,054	829,255,153

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１． 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第9期 平成31年1月11日現在	第10期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
１． １ 期首元本額	737,891,067円	748,571,702円
期中追加設定元本額	109,103,259円	36,335,248円
期中一部解約元本額	98,422,624円	45,448,493円
２． 受益権の総数	748,571,702口	739,458,457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9期 平成31年1月11日現在	第10期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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）

	第9期 平成31年1月11日現在	第10期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.9238円	2.1214円
（1万口当たり純資産額）	(19,238円)	(21,214円)

（参考）

当ファンドは、「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、「国内債券パッシブ・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、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・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。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,292,310,851	4,913,037,006
株式	2	268,142,003,270	255,087,906,650
派生商品評価勘定		158,349,508	47,585,176
未収入金		82,010,000	-
未収配当金		407,430,514	381,583,415
流動資産合計		274,082,104,143	260,430,112,247
資産合計		274,082,104,143	260,430,112,247
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,175,220	3,251,664
前受金		123,755,000	17,787,000
未払金		8,034,485,480	-
未払解約金		53,755,000	834,484,000
流動負債合計		8,221,170,700	855,522,664
負債合計		8,221,170,700	855,522,664
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,565,679,213	105,093,136,075
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		153,295,254,230	154,481,453,508
元本等合計		265,860,933,443	259,574,589,583
純資産合計		265,860,933,443	259,574,589,583
負債純資産合計		274,082,104,143	260,430,112,247

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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		平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 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	112,835,531,288円	112,565,679,213円
	同期中追加設定元本額	36,549,394,271円	13,644,584,572円
	同期中一部解約元本額	36,819,246,346円	21,117,127,710円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M D C 国内株式インデックスファンド	12,256,998,801円	13,241,614,465円
	D I A M国内株式パッシブ・ファンド	2,386,874,810円	2,774,630,418円
	M I T O ラップ型ファンド（安定型）	3,886,220円	3,161,298円
	M I T O ラップ型ファンド（中立型）	8,201,981円	7,360,034円
	M I T O ラップ型ファンド（積極型）	13,986,982円	12,114,705円
	グローバル8資産ラップファンド（安定型）	29,125,646円	30,269,764円
	グローバル8資産ラップファンド（中立型）	22,563,437円	19,656,275円
	グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,943,092円	14,847,701円
	たわらノーロード T O P I X	382,451,857円	478,955,759円
	たわらノーロード バランス（8資産均等型）	97,173,355円	186,918,049円
	たわらノーロード バランス（堅実型）	2,768,469円	4,991,418円
	たわらノーロード バランス（標準型）	18,790,896円	34,902,734円

たわらノーロード バランス （積極型）	37,831,498円	59,731,351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）	228,637円	382,921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）	9,300,086円	19,982,981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）	31,294,481円	57,541,347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）	23,577,333円	44,360,292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）	60,955,847円	107,805,387円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（保守型）	74,040円	280,014円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定型）	174,817円	599,186円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定成長型）	1,095,745円	1,649,447円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（成長型）	691,039円	1,083,709円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（積極型）	2,411,837円	3,345,591円
D I A M国内株式インデックス ファンド＜D C 年金＞	38,449,340,503円	37,799,529,212円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C 年金＞ 1 安定型	930,601,954円	996,067,259円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C 年金＞ 2 安定・成長型	3,152,850,618円	3,288,639,230円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C 年金＞ 3 成長型	3,152,192,254円	3,386,203,253円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	353,322,394円	375,253,708円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	1,167,901,061円	1,225,800,108円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	1,104,473,614円	1,150,355,129円
マネックス資産設計ファンド＜ 隔月分配型＞	40,917,509円	41,914,007円
マネックス資産設計ファンド＜ 育成型＞	1,083,076,227円	1,122,667,639円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	25,501,335円	26,814,455円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国 1 0 ）	286,731,745円	315,726,619円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国 2 0 ）	194,305,090円	219,871,828円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国 3 0 ）	335,172,615円	380,568,614円
投資のソムリエ	2,176,455,324円	2,330,785,591円
クルーズコントロール	188,360,302円	278,945,492円
投資のソムリエ＜D C 年金＞	199,016,808円	244,354,937円

D I A M 8 資産バランスファンドN < D C 年金 >	222,726,425円	251,016,294円
4 資産分散投資・ハイクラス < D C 年金 >	270,071,033円	298,654,853円
クルーズコントロール < D C 年金 >	120,118円	410,234円
D I A M コア資産設計ファンド（堅実型）	1,884,210円	3,430,634円
D I A M コア資産設計ファンド（積極型）	3,452,430円	5,047,482円
投資のソムリエ < D C 年金 > リスク抑制型	27,709,254円	85,033,783円
ダイナミック・ナビゲーション	474,143円	546,021円
リスク抑制世界8 資産バランスファンド	478,027,309円	1,166,155,599円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	1,678,361円	2,216,483円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	1,302,352円	1,870,434円
リスク抑制世界8 資産バランスファンド（D C）	172,989円	605,890円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	2,584,094円	2,810,942円
4 資産分散投資・スタンダード < D C 年金 >	15,567,413円	21,934,983円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	140,293,071円	176,144,529円
9 資産分散投資・スタンダード < D C 年金 >	18,666円	35,296,598円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	- 円	375,930円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	- 円	375,930円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	- 円	375,930円
4 資産分散投資・ミドルクラス < D C 年金 >	- 円	125,361円
D I A M ワールドバランス25 V A（適格機関投資家限定）	72,428,537円	70,055,528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）	24,452,480円	679,077,334円
D I A M グローバル・バランスファンド25 V A（適格機関投資家限定）	121,667,701円	109,413,294円
D I A M グローバル・バランスファンド50 V A（適格機関投資家限定）	288,407,783円	272,840,706円
D I A M 国際分散バランスファンド30 V A（適格機関投資家限定）	15,671,232円	15,505,897円

D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	66,509,812円	58,384,104円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定）	17,420,446円	16,580,518円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	14,049,764円	14,034,027円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限 定）	31,643,366円	32,336,451円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定）	57,429,940円	62,390,364円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	1,088,244,722円	985,364,008円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定）	1,015,093,457円	953,313,403円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	2,796,988,287円	2,672,479,679円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A（適格機関投 資家限定）	199,320,662円	192,506,361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）	54,728,686円	52,605,140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）	585,876,895円	530,814,269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）	387,173,977円	279,805,676円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	10,313,671円	10,473,598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）	7,969,631円	3,389,647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）	52,147,134円	43,136,239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）	9,938,959,954円	4,733,197,994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）	195,148,097円	63,068,248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）	1,880,011,203円	904,582,818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）	10,784,276,752円	6,878,405,259円
	D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	5,201,125円	5,084,371円
	D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	118,453円	307,690円
	D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	4,011,960円	294,829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）	9,606,107,157円	9,392,319,338円
	D I A M世界バランス2 5 V A （適格機関投資家限定）	69,426,099円	64,552,277円
	D I A M国内バランス3 0 V A （適格機関投資家限定）	29,836,616円	26,242,103円
	D I A Mバランス2 0 V A（適 格機関投資家限定）	27,655,542円	27,057,655円
	D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	109,220円	111,785円
	D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	121,295円	125,891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）	426,124,037円	426,124,037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）	1,366,625,210円	1,335,152,689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）	1,837,729,242円	1,766,916,070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）	72,976,941円	72,976,941円
	計	112,565,679,213円	105,093,136,075円
2 .	受益権の総数	112,565,679,213口	105,093,136,075口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,410,500,000円	株式 3,432,500,000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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	5,773,520,000	-	5,922,820,000	149,300,000	6,458,953,000	-	6,503,420,000	44,467,000
合計	5,773,520,000	-	5,922,820,000	149,300,000	6,458,953,000	-	6,503,420,000	44,467,000

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
１口当たり純資産額	2.3618円	2.4699円
（１万口当たり純資産額）	(23,618円)	(24,699円)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,665,269,969	1,807,193,800
国債証券		249,079,246,900	225,834,094,600
地方債証券		22,258,855,068	21,713,988,270
特殊債券		18,733,640,508	18,040,308,421
社債券		14,924,593,070	13,159,474,160
未収利息		582,607,024	509,939,747
前払費用		30,975,267	20,060,046
流動資産合計		310,275,187,806	281,085,059,044
資産合計		310,275,187,806	281,085,059,044
負債の部			
流動負債			
未払解約金		4,426,743,000	1,466,133,000
流動負債合計		4,426,743,000	1,466,133,000
負債合計		4,426,743,000	1,466,133,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	235,499,717,802	210,886,282,664
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		70,348,727,004	68,732,643,380
元本等合計		305,848,444,806	279,618,926,044
純資産合計		305,848,444,806	279,618,926,044
負債純資産合計		310,275,187,806	281,085,059,044

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 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	282,148,441,520円	235,499,717,802円
同期中追加設定元本額	107,335,270,578円	57,275,574,767円
同期中一部解約元本額	153,983,994,296円	81,889,009,905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	17,996,235,320円	19,637,666,236円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	108,081,600円	92,780,551円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	82,802,762円	78,080,655円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	25,181,286円	22,556,909円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	810,160,816円	888,494,976円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	227,772,315円	209,370,246円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	30,531,946円	27,618,876円
たわらノーロード 国内債券	5,300,114,866円	7,265,389,120円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	170,314,416円	333,194,981円
たわらノーロード バランス（堅実型）	43,778,367円	82,280,525円
たわらノーロード バランス（標準型）	79,403,926円	152,802,880円
たわらノーロード バランス（積極型）	13,097,187円	21,340,393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）	5,342,959円	8,812,844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）	97,570,005円	179,795,943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）	128,691,152円	216,450,718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）	33,191,904円	59,322,736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）	18,064,952円	17,407,298円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（保守型）	1,862,270円	5,696,187円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定型）	1,270,410円	3,359,862円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定成長型）	3,572,067円	4,528,075円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（成長型）	613,753円	805,182円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（積極型）	17,517円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド＜D C年金＞	12,967,075,063円	13,458,325,770円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞1 安定型	5,919,885,310円	6,225,337,779円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞2 安定・成長型	8,202,301,648円	8,584,327,097円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞3 成長型	3,408,620,510円	3,414,554,922円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,805,683,819円	1,779,642,841円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,999,358,879円	1,963,720,077円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	316,274,220円	303,597,011円
マネックス資産設計ファンド＜ 隔月分配型＞	87,494,470円	88,911,335円
マネックス資産設計ファンド＜ 育成型＞	2,320,757,716円	2,380,276,474円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,827,451円	2,490,772円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国1 0）	3,136,906,696円	3,299,169,376円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国2 0）	750,943,777円	838,025,492円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド（新興国3 0）	161,069,244円	175,362,247円
投資のソムリエ	4,610,531,799円	5,820,503,576円
クルーズコントロール	397,524,317円	529,226,407円
投資のソムリエ＜D C年金＞	420,762,180円	609,876,331円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN＜D C年金＞	2,285,488,089円	2,636,179,699円
4 資産分散投資・ハイクラス＜ D C年金＞	281,787,055円	307,514,498円
クルーズコントロール＜D C年 金＞	255,346円	781,654円
D I A Mコア資産設計ファンド （堅実型）	1,255,528円	2,155,856円
D I A Mコア資産設計ファンド （積極型）	2,413,600円	3,200,970円
投資のソムリエ＜D C年金＞リ スク抑制型	451,953,189円	830,376,910円

ダイナミック・ナビゲーション	1,704,726円	1,742,663円
リスク抑制世界８資産バランス ファンド	7,797,597,987円	11,373,967,887円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０４５）	1,679,916円	2,292,925円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０５５）	1,314,061円	1,942,253円
リスク抑制世界８資産バランス ファンド（ＤＣ）	2,812,984円	5,904,395円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０３５）	2,675,959円	4,053,835円
４資産分散投資・スタンダード ＜ＤＣ年金＞	73,934,208円	105,996,882円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	1,592,435,784円	2,062,513,475円
９資産分散投資・スタンダード ＜ＤＣ年金＞	290,676円	491,676,216円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０４０）	- 円	391,365円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０５０）	- 円	391,365円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０６０）	- 円	391,365円
４資産分散投資・ミドルクラス ＜ＤＣ年金＞	- 円	280,894円
ＤＩＡＭエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファ ンド（適格機関投資家向け）	22,700,190,772円	7,853,561,008円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ ＶＡ（適格機関投資家限定）	423,862,810円	421,257,916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）	- 円	5,024,920,806円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドⅡ（適格機関 投資家限定）	- 円	2,533,463,372円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドⅡⅡ（適格機 関投資家限定）	- 円	2,510,988,052円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドⅢ（適格機関 投資家限定）	- 円	2,526,463,436円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドⅤ（適格機関 投資家限定）	- 円	2,507,144,354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）	260,162,439円	240,272,154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）	205,011,654円	199,571,069円

D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定）	65,148,400円	66,180,106円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	177,679,515円	160,293,442円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A（適格機関投資家 限定）	77,562,193円	75,833,112円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A（適格機関投資家 限定）	33,341,168円	34,227,268円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A（適格機関投資家限 定）	84,548,966円	88,703,678円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定）	153,438,009円	171,156,082円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	5,165,098,735円	4,810,695,018円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定）	2,708,406,989円	2,617,310,614円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	4,973,738,654円	4,890,696,722円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A（適格機関投 資家限定）	531,889,925円	528,183,732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）	243,809,467円	240,648,790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）	3,132,650,273円	2,917,761,720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）	688,618,271円	512,115,704円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	194,752,933円	188,050,355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）	42,590,827円	18,621,766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）	75,249,648円	63,572,920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）	47,134,774,807円	23,114,860,837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）	346,165,294円	115,416,908円

D I A M世界アセットバランス ファンド２５ＶＡ（適格機関投資 家限定）	6,693,326,830円	3,312,659,705円
D I A M世界アセットバランス ファンド３ＶＡ（適格機関投資 家限定）	25,584,090,821円	16,794,060,322円
D I A Mバランス３０ＶＡ（適 格機関投資家限定）	74,330,112円	74,416,976円
D I A Mバランス５０ＶＡ（適 格機関投資家限定）	529,804円	1,402,505円
D I A Mバランス７０ＶＡ（適 格機関投資家限定）	7,143,275円	538,981円
D I A M世界アセットバランス ファンド４ＶＡ（適格機関投資 家限定）	28,504,043,744円	28,651,900,935円
D I A M世界バランス２５ＶＡ （適格機関投資家限定）	405,780,698円	388,117,555円
D I A M国内バランス３０ＶＡ （適格機関投資家限定）	123,848,735円	112,179,649円
D I A Mバランス２０ＶＡ（適 格機関投資家限定）	494,147,950円	495,613,852円
D I A Mバランス４０ＶＡ（適 格機関投資家限定）	685,633円	713,232円
D I A Mバランス６０ＶＡ（適 格機関投資家限定）	360,438円	382,677円
計	235,499,717,802円	210,886,282,664円
２． 受益権の総数	235,499,717,802口	210,886,282,664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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2987円	1.3259円
（1万口当たり純資産額）	(12,987円)	(13,259円)

「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,314,167,249	683,809,435
投資証券		32,839,378,200	33,907,407,120
派生商品評価勘定		8,421,192	29,726,892
未収配当金		305,320,935	242,420,534
差入委託証拠金		10,492,092	10,667,592
流動資産合計		35,477,779,668	34,874,031,573
資産合計		35,477,779,668	34,874,031,573
負債の部			
流動負債			
前受金		2,980,692	25,514,892
未払金		1,776,310,520	-
未払解約金		31,354,000	80,757,000
流動負債合計		1,810,645,212	106,271,892
負債合計		1,810,645,212	106,271,892
純資産の部			
元本等			
元本	1	17,353,251,443	15,854,128,990
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		16,313,883,013	18,913,630,691
元本等合計		33,667,134,456	34,767,759,681
純資産合計		33,667,134,456	34,767,759,681
負債純資産合計		35,477,779,668	34,874,031,573

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 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	19,626,564,592円	17,353,251,443円
同期中追加設定元本額	18,392,838,806円	11,255,190,957円
同期中一部解約元本額	20,666,151,955円	12,754,313,410円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	273,617円	369,566円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,005,641円	949,650円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,030,344円	1,505,516円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,959,291円	3,537,928円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,803,635円	2,579,247円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,391,639円	1,844,313円
たわらノーロード 国内リート	1,829,589,442円	2,718,972,353円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	631,502,662円	636,631,408円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	120,157,449円	212,522,414円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,675,645円	2,850,792円
たわらノーロード バランス（標準型）	32,882,913円	57,055,728円
たわらノーロード バランス（積極型）	46,534,171円	68,323,953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）	13,535,312円	22,906,391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）	47,448,867円	73,286,247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）	28,598,521円	46,933,760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）	64,075,667円	101,768,845円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定型）	318,290円	858,806円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定成長型）	1,772,149円	2,234,182円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（成長型）	1,031,995円	1,319,941円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（積極型）	2,925,114円	3,468,733円
マネックス資産設計ファンド＜ 隔月分配型＞	13,878,394円	12,293,543円
マネックス資産設計ファンド＜ 育成型＞	367,687,724円	329,108,574円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,800,682円	3,869,053円
D I A M D C 8資産 balan スファンド（新興国10）	112,562,702円	110,074,791円
D I A M D C 8資産 balan スファンド（新興国20）	97,972,560円	100,125,827円
D I A M D C 8資産 balan スファンド（新興国30）	193,573,200円	196,178,324円
投資のソムリエ	1,494,850,661円	2,112,926,947円
投資のソムリエ＜D C 年金＞	136,466,780円	220,624,785円
D I A M 8資産 バランスファ ンドN＜D C 年金＞	80,069,705円	86,375,207円
投資のソムリエ＜D C 年金＞リ スク抑制型	26,060,325円	118,639,899円
ダイナミック・ナビゲーション	436,240円	462,781円
リスク抑制世界8資産 バラン スファンド	454,608,007円	1,632,198,716円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2045）	818,404円	1,128,727円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2055）	637,800円	961,678円
リスク抑制世界8資産 バラン スファンド（D C）	163,238円	849,414円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2035）	1,297,694円	1,737,424円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	170,175,871円	302,836,657円
9資産分散投資・スタンダード ＜D C 年金＞	8,057円	12,010,671円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2040）	- 円	192,254円

投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０５０）	- 円	192,254円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０６０）	- 円	192,254円
Ｊリートインデックスファンド （ＤＣ）	6,898,990円	13,470,283円
ＤＩＡＭ Ｊ－ＲＥＩＴイン デックス私募ファンド２０１２ １２（適格機関投資家限定）	90,667,967円	88,865,089円
ＤＩＡＭ Ｊ－ＲＥＩＴイン デックス私募ファンド２０１４ ０１（適格機関投資家限定）	814,638,139円	799,031,482円
ＤＩＡＭ Ｊ－ＲＥＩＴイン デックスファンド（適格機関投 資家向け）	8,542,863,384円	4,098,901,168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）	62,731,397円	400,914,971円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	14,402,370円	15,360,153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）	1,189,092,929円	1,234,686,291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Ⅱ（適格機関投資家限 定）	645,375,859円	- 円
計	17,353,251,443円	15,854,128,990円
２． 受益権の総数	17,353,251,443口	15,854,128,990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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買 建	620,883,900	-	629,343,000	8,459,100	668,725,200	-	698,490,000	29,764,800
合計	620,883,900	-	629,343,000	8,459,100	668,725,200	-	698,490,000	29,764,800

（注）１．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
１口当たり純資産額	1.9401円	2.1930円
（１万口当たり純資産額）	(19,401円)	(21,930円)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,836,684,496	4,132,150,703
コール・ローン		101,330,406	567,754,814
株式		308,327,397,174	332,267,325,819
投資信託受益証券		765,582,162	865,749,246
投資証券		7,344,836,469	8,458,868,904
派生商品評価勘定		342,984,345	162,529,373
未収入金		2,935,713	319,406,147
未収配当金		399,646,537	383,660,059
差入委託証拠金		4,288,210,905	2,429,195,579
流動資産合計		325,409,608,207	349,586,640,644
資産合計		325,409,608,207	349,586,640,644
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,777,780	1,075,704
未払金		191,353,057	-
未払解約金		83,153,000	790,887,000
流動負債合計		280,283,837	791,962,704
負債合計		280,283,837	791,962,704
純資産の部			
元本等			
元本	1	101,086,948,774	94,603,893,162
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		224,042,375,596	254,190,784,778
元本等合計		325,129,324,370	348,794,677,940
純資産合計		325,129,324,370	348,794,677,940
負債純資産合計		325,409,608,207	349,586,640,644

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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期間末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、決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	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 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	87,104,816,912円	101,086,948,774円
同期中追加設定元本額	41,186,554,316円	12,073,878,254円
同期中一部解約元本額	27,204,422,454円	18,556,933,866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	2,834,834,285円	2,964,146,781円
M I T O ラップ型ファンド （安定型）	2,795,385円	2,836,367円
M I T O ラップ型ファンド （中立型）	8,338,508円	7,276,686円
M I T O ラップ型ファンド （積極型）	16,109,487円	11,121,382円
グローバル8資産ラップファン ド（安定型）	20,660,274円	27,163,269円
グローバル8資産ラップファン ド（中立型）	22,937,156円	19,438,991円
グローバル8資産ラップファン ド（積極型）	19,511,274円	13,616,730円
たわらノーロード 先進国株式	8,432,850,323円	9,896,682,450円
たわらノーロード 先進国株式 ＜ラップ向け＞	423,862円	44,534,521円
たわらノーロード 先進国株式 ＜為替ヘッジあり＞	1,113,800,589円	1,264,769,587円
たわらノーロード バランス （8資産均等型）	72,340,579円	124,628,369円
たわらノーロード バランス （堅実型）	5,902,698円	9,867,657円
たわらノーロード バランス （標準型）	53,764,222円	88,715,208円
たわらノーロード バランス （積極型）	86,792,047円	121,320,562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）	251,550円	383,014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）	22,507,488円	30,002,596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）	67,724,316円	82,425,238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）	45,651,641円	64,472,804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）	118,572,173円	152,265,791円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（保守型）	27,125円	75,164円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定型）	129,058円	302,405円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定成長型）	897,827円	1,008,660円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（成長型）	666,772円	728,904円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（積極型）	2,471,010円	2,571,388円
D I A M外国株式インデックス ファンド＜DC年金＞	40,302,652,318円	41,142,517,703円
One DC 先進国株式イン デックスファンド	- 円	85,562,920円

D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞ 1 安定型	177,126,536円	176,650,905円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞ 2 安定・成長型	921,869,976円	880,045,133円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞ 3 成長型	1,083,135,794円	1,077,647,728円
D I A M D C バランス 3 0 インデックスファンド	127,206,341円	126,384,378円
D I A M D C バランス 5 0 インデックスファンド	360,021,829円	355,814,509円
D I A M D C バランス 7 0 インデックスファンド	323,498,598円	310,681,226円
マネックス資産設計ファンド＜ 隔月分配型＞	30,117,672円	29,668,261円
マネックス資産設計ファンド＜ 育成型＞	797,590,298円	794,921,104円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	209,301,312円	199,603,769円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 1 0 ）	213,418,470円	212,887,825円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 2 0 ）	144,027,570円	147,316,450円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド（新興国 3 0 ）	249,535,320円	255,675,336円
投資のソムリエ	678,676,729円	1,067,731,770円
クルーズコントロール	70,085,435円	95,795,914円
投資のソムリエ＜ D C 年金＞	62,512,430円	111,395,952円
D I A M 8 資産バランスマ ンドN＜ D C 年金＞	167,809,740円	169,183,049円
4 資産分散投資・ハイクラス＜ D C 年金＞	94,014,637円	95,388,259円
クルーズコントロール＜ D C 年 金＞	44,663円	140,577円
D I A Mコア資産設計ファンド （堅実型）	449,001円	794,546円
D I A Mコア資産設計ファンド （積極型）	844,676円	1,152,095円
投資のソムリエ＜ D C 年金＞リ スク抑制型	21,167,331円	46,660,190円
ダイナミック・ナビゲーション	343,259円	1,459,114円
リスク抑制世界 8 資産バラン スファンド	357,646,638円	640,465,965円
ワールドアセットバランス（基 本コース）	610,427,443円	511,168,457円
ワールドアセットバランス（リ スク抑制コース）	1,389,438,673円	2,025,496,386円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー 2 0 4 5 ）	1,012,100円	1,153,105円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー 2 0 5 5 ）	789,212円	982,574円
リスク抑制世界 8 資産バラン スファンド（ D C ）	128,251円	332,632円

投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０３５）	806,566円	1,456,920円
４資産分散投資・スタンダード ＜ＤＣ年金＞	5,789,621円	7,328,627円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	105,791,997円	118,508,997円
９資産分散投資・スタンダード ＜ＤＣ年金＞	13,989円	23,534,028円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０４０）	- 円	199,351円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０５０）	- 円	199,351円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー２０６０）	- 円	199,351円
４資産分散投資・ミドルクラス ＜ＤＣ年金＞	- 円	41,872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）	90,254,658円	87,609,932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）	2,390,882,636円	2,342,036,018円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブ ファンド（適格機関投資家限 定）	12,402,698,618円	9,261,112,810円
外国株式パッシブ・ファンド２ （適格機関投資家限定）	206,183,273円	206,084,716円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,840,539円	20,181,928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）	89,701,630円	73,664,706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）	212,654,359円	183,710,080円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファ ンド３０ＶＡ（適格機関投資家 限定）	11,554,549円	10,431,187円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファ ンド５０ＶＡ（適格機関投資家 限定）	73,589,651円	58,971,490円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファ ンド３０ＶＡ（適格機関投資家 限定）	6,413,299円	5,574,124円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファ ンド５０ＶＡ（適格機関投資家 限定）	6,903,870円	6,293,906円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド ４０ＶＡ（適格機関投資家限 定）	23,330,526円	21,752,437円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド ５０ＶＡ（適格機関投資家限 定）	63,541,976円	62,968,491円

D I A Mバランスファンド２５ V A（適格機関投資家限定）	534,544,227円	442,026,146円
D I A Mバランスファンド３ ７．５V A（適格機関投資家限 定）	654,815,220円	561,563,200円
D I A Mバランスファンド５０ V A（適格機関投資家限定）	2,062,322,007円	1,799,290,175円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A（適格機関投 資家限定）	756,981,970円	643,148,820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）	124,735,564円	105,761,230円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド３０V A （適格機関投資家限定）	865,106,063円	715,481,449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）	95,074,329円	62,774,978円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド ５５V A（適格機関投資家限 定）	27,248,619円	10,225,561円
D I A M世界バランスファンド ３５V A（適格機関投資家限 定）	15,458,639円	11,746,417円
D I A M世界アセットバランス ファンド２V A（適格機関投資 家限定）	4,884,528,633円	2,125,221,429円
D I A M世界アセットバランス ファンド４０V A（適格機関投 資家限定）	144,037,122円	42,468,288円
D I A M世界アセットバランス ファンド２５V A（適格機関投 資家限定）	1,386,057,134円	609,147,808円
D I A M世界アセットバランス ファンド３V A（適格機関投資 家限定）	5,298,403,339円	3,088,701,884円
D I A Mバランス３０V A（適 格機関投資家限定）	19,797,555円	17,123,800円
D I A Mバランス５０V A（適 格機関投資家限定）	355,559円	827,766円
D I A Mバランス７０V A（適 格機関投資家限定）	10,994,618円	726,238円
D I A M世界アセットバランス ファンド４V A（適格機関投資 家限定）	7,082,295,609円	6,322,837,855円
D I A Mバランス２０V A（適 格機関投資家限定）	63,114,592円	54,693,394円
D I A Mバランス４０V A（適 格機関投資家限定）	246,843円	225,102円

	D I A Mバランス60VA（適 格機関投資家限定）	272,499円	253,969円
計		101,086,948,774円	94,603,893,162円
2 .	受益権の総数	101,086,948,774口	94,603,893,162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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	-	-	-	-	256,120,109	-	254,611,530	1,508,579
アメリカ・ドル	-	-	-	-	178,532,172	-	177,215,220	1,316,952
イギリス・ポンド	-	-	-	-	15,067,362	-	15,026,070	41,292
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	7,019,826	-	7,005,690	14,136
カナダ・ドル	-	-	-	-	9,461,886	-	9,434,640	27,246
ユーロ	-	-	-	-	46,038,863	-	45,929,910	108,953
買 建	3,879,788,937	-	3,879,951,050	162,113	1,089,597,401	-	1,089,651,660	54,259
アメリカ・ドル	2,662,040,379	-	2,662,064,930	24,551	757,401,784	-	757,438,190	36,406
イギリス・ポンド	262,145,481	-	262,165,400	19,919	70,795,424	-	70,798,510	3,086
オーストラリア・ドル	105,725,286	-	105,727,320	2,034	30,731,947	-	30,734,640	2,693
カナダ・ドル	143,511,225	-	143,523,840	12,615	35,756,726	-	35,752,320	4,406
ユーロ	706,366,566	-	706,469,560	102,994	194,911,520	-	194,928,000	16,480
合計	3,879,788,937	-	3,879,951,050	162,113	1,345,717,510	-	1,344,263,190	1,562,838

（注）時価の算定方法

- 1．計算期間末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。
計算期間末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。
計算期間末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。
・ 計算期間末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。
・ 計算期間末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．計算期間末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、計算期間末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	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	12,045,683,104	-	12,382,727,556	337,044,452	8,005,900,615	-	8,165,791,446	159,890,831
合計	12,045,683,104	-	12,382,727,556	337,044,452	8,005,900,615	-	8,165,791,446	159,890,831

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
１口当たり純資産額	3.2163円	3.6869円
（１万口当たり純資産額）	(32,163円)	(36,869円)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,908,913,542	2,041,572,574
コール・ローン		1,135,808,636	706,278,770
国債証券		183,826,971,003	175,262,230,905
派生商品評価勘定		204,390	2,010,406
未収入金		-	671,356,241
未収利息		1,557,116,947	1,299,885,970
前払費用		22,390,099	19,341,617
流動資産合計		188,451,404,617	180,002,676,483
資産合計		188,451,404,617	180,002,676,483
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1	-
未払金		3,034,790,332	2,063,180,504
未払解約金		61,066,000	802,366,000
流動負債合計		3,095,856,333	2,865,546,504
負債合計		3,095,856,333	2,865,546,504
純資産の部			
元本等			
元本	1	104,514,418,065	95,726,952,071
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		80,841,130,219	81,410,177,908
元本等合計		185,355,548,284	177,137,129,979
純資産合計		185,355,548,284	177,137,129,979
負債純資産合計		188,451,404,617	180,002,676,483

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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期間末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、決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	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 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	125,530,104,029円	104,514,418,065円
同期中追加設定元本額	26,760,792,224円	9,460,902,434円
同期中一部解約元本額	47,776,478,188円	18,248,368,428円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,786,662,853円	8,333,243,800円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	9,822,148円	7,817,708円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	25,893,084円	26,354,122円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	31,409,274円	32,191,957円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	73,651,471円	74,979,498円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	71,228,791円	71,610,659円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	38,058,966円	39,415,440円
たわらノーロード 先進国債券	3,265,662,747円	4,563,463,463円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	77,647,010円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	130,006,533円	247,108,202円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,710,128円	4,970,034円

たわらノーロード バランス （標準型）	14,081,954円	26,476,779円
たわらノーロード バランス （積極型）	3,828,901円	6,096,925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）	292,673円	752,046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）	21,405,923円	43,706,093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）	35,016,416円	75,510,489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）	10,049,800円	22,389,394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）	5,196,463円	24,965,376円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定型）	335,681円	786,689円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（安定成長型）	1,556,752円	1,574,356円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（成長型）	544,028円	621,788円
たわらノーロード 最適化バラ ンス（積極型）	1,027,964円	835,964円
D I A M外国債券インデックス ファンド＜D C年金＞	5,233,603,399円	5,585,455,628円
O n e D C 先進国債券イン デックスファンド	- 円	536,470円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞1 安定型	517,237,588円	549,583,102円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞2 安定・成長型	1,668,750,000円	1,722,345,333円
D I A Mバランス・ファンド＜ D C年金＞3 成長型	1,750,349,034円	1,770,605,506円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	373,232,148円	370,418,880円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	812,192,171円	800,053,150円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	628,183,246円	612,075,187円
マネックス資産設計ファンド＜ 隔月分配型＞	22,571,041円	22,781,286円
マネックス資産設計ファンド＜ 育成型＞	598,545,875円	610,421,668円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,297,386円	10,065,174円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド（新興国1 0）	116,671,618円	123,561,385円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド（新興国2 0）	67,978,539円	76,408,183円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド（新興国3 0）	113,004,112円	125,523,306円
クルーズコントロール	423,294,781円	564,358,224円

D I A M 8 資産バランスファンドN< D C 年金>	85,525,941円	98,934,802円
4 資産分散投資・ハイクラス< D C 年金>	146,786,408円	159,371,691円
クルーズコントロール< D C 年金>	271,437円	835,455円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	1,371,699円	2,344,328円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	2,586,260円	3,439,266円
ダイナミック・ナビゲーション	1,510,449円	363,905円
4 資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	15,625,341円	21,823,796円
9 資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	11,075円	18,664,645円
4 資産分散投資・ミドルクラス< D C 年金>	- 円	82,111円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,226,746,285円	1,282,866,932円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	7,190,891,462円	6,936,305,981円
D I A M外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	3,749,208,940円	3,762,404,174円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	3,093,632,320円	2,487,091,451円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	6,084,705,149円	6,079,877,835円
D I A Mワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	92,602,048円	91,951,478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）	747,492,851円	690,755,836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）	590,066,412円	573,907,866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）	46,785,848円	47,535,463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）	85,033,887円	76,743,215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）	22,271,660円	21,778,447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）	5,980,093円	6,139,730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）	60,706,694円	63,713,945円

D I A M世界バランスファンド 5 0 V A（適格機関投資家限 定）	73,426,704円	81,939,965円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	3,249,458,679円	3,022,595,229円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限 定）	2,109,670,928円	2,036,673,156円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	3,576,104,598円	3,512,903,051円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A（適格機関投 資家限定）	637,545,838円	632,182,408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）	245,210,091円	242,136,103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）	3,035,022,980円	2,791,295,663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）	1,860,903,792円	1,341,986,211円
D I A Mグローバルβ私募ファ ンド（適格機関投資家向け）	13,975,529円	14,665,687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）	15,293,391円	6,685,226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）	123,782,019円	102,964,909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）	8,469,323,911円	4,148,752,530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）	18,386,940,356円	12,062,752,072円
D I A Mバランス3 0 V A（適 格機関投資家限定）	20,008,473円	20,045,603円
D I A Mバランス5 0 V A（適 格機関投資家限定）	380,438円	1,007,500円
D I A Mバランス7 0 V A（適 格機関投資家限定）	5,128,930円	386,742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）	16,380,805,594円	16,462,391,215円
D I A M世界バランス2 5 V A （適格機関投資家限定）	88,756,482円	84,809,374円
D I A Mバランス2 0 V A（適 格機関投資家限定）	106,400,750円	106,606,660円
D I A Mバランス4 0 V A（適 格機関投資家限定）	351,229円	365,579円
D I A Mバランス6 0 V A（適 格機関投資家限定）	155,194円	164,562円

計	104,514,418,065円	95,726,952,071円
2 . 受益権の総数	104,514,418,065口	95,726,952,071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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	-	-	-	-	285,280,000	-	283,363,627	1,916,373
アメリカ・ドル	-	-	-	-	247,670,000	-	245,843,049	1,826,951
イギリス・ポンド	-	-	-	-	18,830,000	-	18,778,396	51,604
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	18,780,000	-	18,742,182	37,818
買 建	2,991,320,000	-	2,991,524,389	204,389	2,913,790,000	-	2,913,884,033	94,033
アメリカ・ドル	1,399,920,000	-	1,399,919,999	1	1,485,580,000	-	1,485,580,000	-
イギリス・ポンド	204,700,000	-	204,707,406	7,406	186,210,000	-	186,211,376	1,376
オーストラリア・ドル	54,840,000	-	54,844,923	4,923	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	68,800,000	-	68,805,983	5,983
ユーロ	1,331,860,000	-	1,332,052,061	192,061	1,173,200,000	-	1,173,286,674	86,674
合計	2,991,320,000	-	2,991,524,389	204,389	3,199,070,000	-	3,197,247,660	2,010,406

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末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。
計算期間末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。
計算期間末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。
・ 計算期間末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。
・ 計算期間末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. 計算期間末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、計算期間末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)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7735円	1.8504円
(1万口当たり純資産額)	(17,735円)	(18,504円)

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		732,549,513	108,765,282
コール・ローン		78,368,735	94,986,583
投資信託受益証券		4,104,663,329	5,197,203,423
投資証券		40,893,156,516	42,576,203,812
派生商品評価勘定		254,365	-
未収配当金		175,364,522	197,680,479
流動資産合計		45,984,356,980	48,174,839,579
資産合計		45,984,356,980	48,174,839,579
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		48,620	750
未払金		7,488,749,372	-
未払解約金		27,776,000	72,069,000
流動負債合計		7,516,573,992	72,069,750
負債合計		7,516,573,992	72,069,750
純資産の部			
元本等			
元本	1	33,176,902,219	36,007,799,513
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		5,290,880,769	12,094,970,316
元本等合計		38,467,782,988	48,102,769,829
純資産合計		38,467,782,988	48,102,769,829
負債純資産合計		45,984,356,980	48,174,839,579

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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期間末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、決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	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 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	46,402,765,697円	33,176,902,219円
同期中追加設定元本額	46,019,259,577円	21,870,955,742円
同期中一部解約元本額	59,245,123,055円	19,040,058,448円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国RE 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）	250,874,408円	159,817,761円
D I A M先進国RE 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）	91,252,071円	95,189,351円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	4,172,228円	5,718,776円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	15,919,954円	14,621,134円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	31,826,259円	22,970,643円

グローバル8資産ラップファンド（安定型）	30,843,640円	54,761,483円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	43,636,068円	39,196,988円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	38,541,149円	27,781,742円
たわらノーロード 先進国リート	3,063,958,957円	3,952,481,677円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	616,803,762円	604,995,933円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	150,639,471円	157,835,253円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	201,222,909円	347,572,459円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,439,001円	2,311,743円
たわらノーロード バランス（標準型）	27,934,331円	46,940,958円
たわらノーロード バランス（積極型）	72,665,658円	103,837,951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）	7,556,297円	18,923,298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）	55,627,064円	96,870,840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）	47,896,710円	84,009,452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）	140,337,863円	216,191,988円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	296,229円	567,549円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	1,978,581円	1,987,715円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,511,910円	1,667,534円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	5,171,309円	5,429,553円
One DC 先進国リートインデックスファンド	- 円	771,846円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,837,296円	19,510,171円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	604,119,097円	522,158,857円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	52,317,354円	53,216,299円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	172,886,995円	176,778,690円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	153,844,071円	164,672,695円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	305,200,295円	324,075,249円
投資のソムリエ	5,091,609,781円	8,428,116,435円
投資のソムリエ<DC年金>	465,395,016円	884,073,093円

D I A M 8 資産バランスファンドN < D C 年金 >	133,586,692円	142,655,966円
投資のソムリエ < D C 年金 > リスク抑制型	119,937,911円	263,879,427円
ダイナミック・ナビゲーション	695,215円	758,378円
リスク抑制世界8 資産バランスファンド	2,064,821,221円	3,627,808,356円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,107,749,531円	951,671,015円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,627,039,919円	3,679,207,636円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	2,773,084円	4,608,063円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	2,168,352円	3,977,720円
リスク抑制世界8 資産バランスファンド（D C）	740,407円	1,884,146円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	4,412,949円	7,763,761円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	379,757,137円	650,236,523円
9 資産分散投資・スタンダード < D C 年金 >	12,333円	19,533,790円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	- 円	801,699円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	- 円	801,699円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	- 円	801,699円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1,063,616,864円	834,894,408円
D I A M 外国リートインデックスファンド < D C 年金 >	33,855,546円	46,193,240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）	524,032,259円	352,626,090円
D I A M グローバルβ 私募ファンド（適格機関投資家向け）	11,580,328円	12,032,969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）	6,722,401,410円	2,989,019,140円
D I A M 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）	1,664,252,242円	1,762,493,192円
D I A M グローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドI I（適格機関投資家限定）	923,299,332円	- 円
P - O n e マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,461,256,521円	3,461,256,521円

	D I A M海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	558,597,232円	557,838,959円
計		33,176,902,219円	36,007,799,513円
2 .	受益権の総数	33,176,902,219口	36,007,799,513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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	-	-	-	-	30,456,750	-	30,457,500	750
ユーロ	-	-	-	-	30,456,750	-	30,457,500	750
買 建	7,968,937,355	-	7,969,143,100	205,745	-	-	-	-
アメリカ・ドル	5,746,737,000	-	5,746,790,000	53,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	433,915,030	-	433,948,000	32,970	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	561,373,200	-	561,384,000	10,800	-	-	-	-
カナダ・ドル	152,357,808	-	152,371,200	13,392	-	-	-	-
シンガポール・ドル	291,246,153	-	291,307,500	61,347	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	37,522,842	-	37,525,800	2,958	-	-	-	-
ユーロ	547,967,702	-	548,047,600	79,898	-	-	-	-
香港・ドル	197,817,620	-	197,769,000	48,620	-	-	-	-
合計	7,968,937,355	-	7,969,143,100	205,745	30,456,750	-	30,457,500	750

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末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。
計算期間末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。
計算期間末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。
・ 計算期間末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。
・ 計算期間末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. 計算期間末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、計算期間末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)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1595円	1.3359円
(1万口当たり純資産額)	(11,595円)	(13,359円)

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,299,271,008	3,105,393,841
コール・ローン		32,772,864	218,968,236
株式		44,235,304,878	52,334,255,994
新株予約権証券		78,278	617,207
投資信託受益証券		227,631,777	1,004,971,646
投資証券		73,487,373	36,607,477
派生商品評価勘定		93,745,445	179,670,587
未収入金		1,309,313	4,347,738
未収配当金		40,348,430	329,230,187
差入委託証拠金		368,721,191	1,969,297,009
流動資産合計		46,372,670,557	59,183,359,922
資産合計		46,372,670,557	59,183,359,922
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	13,230,614
未払金		4,923	294,711
未払解約金		7,564,000	257,123,000
流動負債合計		7,568,923	270,648,325
負債合計		7,568,923	270,648,325
純資産の部			
元本等			
元本	1	43,032,611,492	51,431,852,236
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,332,490,142	7,480,859,361
元本等合計		46,365,101,634	58,912,711,597
純資産合計		46,365,101,634	58,912,711,597
負債純資産合計		46,372,670,557	59,183,359,922

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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期間末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、決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		平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 .	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	47,332,729,770円	43,032,611,492円
	同期中追加設定元本額	37,708,746,421円	27,785,967,336円
	同期中一部解約元本額	42,008,864,699円	19,386,726,592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＞	4,229,653,765円	5,170,590,841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）	538,952,510円	497,859,715円
	M I T O ラップ型ファンド（安定型）	5,084,297円	3,158,076円
	M I T O ラップ型ファンド（中立型）	13,283,178円	10,613,946円
	M I T O ラップ型ファンド（積極型）	16,008,746円	13,371,757円
	グローバル8資産ラップファンド（安定型）	38,106,625円	30,235,294円
	グローバル8資産ラップファンド（中立型）	36,541,116円	28,262,517円
	グローバル8資産ラップファンド（積極型）	19,391,290円	16,377,733円
	たわらノーロード 新興国株式	4,503,768,120円	5,059,076,925円
	たわらノーロード 新興国株式＜ラップ向け＞	1,937,088,275円	1,840,804,377円
	たわらノーロード バランス（8資産均等型）	218,593,721円	402,034,527円
	たわらノーロード バランス（堅実型）	1,544,922円	2,683,701円
	たわらノーロード バランス（標準型）	5,991,440円	10,724,323円
	たわらノーロード バランス（積極型）	12,990,571円	19,764,969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）	125,758円	202,871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）	8,172,737円	14,168,351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）	25,788,023円	40,798,655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）	17,269,961円	29,032,717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）	53,574,501円	67,446,053円
	たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	63,713円	158,353円
	たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	534,057円	635,540円

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	349,997円	286,853円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,177,612円	1,015,862円
One DC 新興国株式インデックスファンド	- 円	870,210円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	447,212,307円	453,215,866円
DIAM DC 8資産バランス ファンド（新興国10）	323,578,911円	344,918,448円
DIAM DC 8資産バランス ファンド（新興国20）	283,538,394円	315,334,332円
DIAM DC 8資産バランス ファンド（新興国30）	560,502,321円	611,668,322円
投資のソムリエ	1,125,613,712円	10,528,057,901円
クルーズコントロール	229,645,946円	285,779,318円
投資のソムリエ＜DC年金＞	103,543,744円	1,102,974,789円
DIAM 8資産バランス ファンドN＜DC年金＞	244,460,621円	268,921,823円
クルーズコントロール＜DC年金＞	147,820円	423,564円
DIAMコア資産設計ファンド （堅実型）	3,790,466円	5,932,519円
DIAMコア資産設計ファンド （積極型）	7,033,164円	8,687,072円
投資のソムリエ＜DC年金＞ リスク抑制型	62,324,346円	364,370,602円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産 バランスファンド	1,288,060円 1,075,304,118円	580,633円 4,994,315,586円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,879,064,959円	1,582,552,604円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,890,272,267円	6,277,274,398円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2045）	598,449円	4,729,353円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2055）	470,297円	3,993,071円
リスク抑制世界8資産 バランスファンド（DC）	389,308円	2,597,497円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2035）	947,979円	8,849,610円
リスクコントロール世界資産 分散ファンド	313,785,870円	918,834,779円
9資産分散投資・スタンダード ＜DC年金＞	20,870円	37,958,281円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2040）	- 円	812,459円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2050）	- 円	812,459円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2060）	- 円	812,459円

	エマージング株式パッシブファン ドV A（適格機関投資家専 用）	3,535,043,726円	1,834,300,137円
	エマージング株式パッシブファ ンド（適格機関投資家限定）	2,125,194,681円	- 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）	7,261,569,827円	3,347,895,346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）	7,873,214,394円	4,865,074,842円
計		43,032,611,492円	51,431,852,236円
2 .	受益権の総数	43,032,611,492口	51,431,852,236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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	68,448,232	-	67,943,320	504,912
アメリカ・ドル	-	-	-	-	68,448,232	-	67,943,320	504,912
買 建	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450	1,103,223,627	-	1,103,213,430	10,197
アメリカ・ドル	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450	1,103,223,627	-	1,103,213,430	10,197
合計	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450	1,171,671,859	-	1,171,156,750	494,715

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末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。
計算期間末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。
計算期間末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。
・ 計算期間末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。
・ 計算期間末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. 計算期間末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、計算期間末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	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	4,803,549,477	-	4,897,266,472	93,716,995	6,435,879,906	-	6,601,825,164	165,945,258
合計	4,803,549,477	-	4,897,266,472	93,716,995	6,435,879,906	-	6,601,825,164	165,945,258

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
１口当たり純資産額	1.0774円	1.1455円
（１万口当たり純資産額）	(10,774円)	(11,455円)

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		16,123,382,089	1,275,861,569
コール・ローン		87,215,102	210,080,076
国債証券		107,326,775,455	88,286,521,432
派生商品評価勘定		145,000	-
未収利息		820,451,685	1,014,850,998
前払費用		462,658,928	297,082,178
流動資産合計		124,820,628,259	91,084,396,253
資産合計		124,820,628,259	91,084,396,253
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	20,000
未払金		30,405,438,410	-
未払解約金		7,529,000	273,007,000
流動負債合計		30,412,967,410	273,027,000
負債合計		30,412,967,410	273,027,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	52,757,465,400	46,374,799,702
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		41,650,195,449	44,436,569,551
元本等合計		94,407,660,849	90,811,369,253
純資産合計		94,407,660,849	90,811,369,253
負債純資産合計		124,820,628,259	91,084,396,253

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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期間末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、決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	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 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	54,256,447,518円	52,757,465,400円
同期中追加設定元本額	77,661,828,674円	31,334,577,861円
同期中一部解約元本額	79,160,810,792円	37,717,243,559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）	286,716,961円	247,854,333円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	128,371,531円	234,562,608円
たわらノーロード バランス（堅実型）	7,136,042円	12,529,425円
たわらノーロード バランス（標準型）	20,905,547円	37,570,824円
たわらノーロード バランス（積極型）	11,342,432円	17,339,030円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	142,739円	419,818円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	299,198円	654,370円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	1,094,144円	1,308,912円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	341,158円	421,792円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	515,076円	595,683円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,646,088円	65,031,717円
DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国10）	196,510,788円	197,354,708円
DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国20）	172,561,704円	182,270,176円
DIAM DC 8資産バラン スファンド（新興国30）	338,305,279円	358,988,375円
投資のソムリエ	4,780,199,975円	9,791,719,622円
クルーズコントロール	139,177,158円	183,260,238円
投資のソムリエ＜DC年金＞	436,204,954円	1,026,593,590円
DIAM 8資産バランスファ ンドN＜DC年金＞	143,653,316円	156,920,625円
クルーズコントロール＜DC年 金＞	89,225円	270,126円
DIAMコア資産設計ファンド （堅実型）	915,607円	1,500,541円
DIAMコア資産設計ファンド （積極型）	1,691,798円	2,221,045円
投資のソムリエ＜DC年金＞リ スク抑制型	199,792,522円	259,126,482円
ダイナミック・ナビゲーション	454,825円	512,806円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	3,446,924,591円	3,565,443,159円
ワールドアセットバランス（基 本コース）	1,129,715,395円	951,156,570円
ワールドアセットバランス（リ スク抑制コース）	2,262,347,925円	3,697,617,320円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2045）	2,617,018円	4,639,943円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2055）	2,029,113円	3,925,139円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド（DC）	1,240,199円	1,852,291円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2035）	4,146,714円	8,241,094円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	779,406,995円	648,733,942円
9資産分散投資・スタンダード ＜DC年金＞	13,655円	22,145,866円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2040）	- 円	790,977円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2050）	- 円	790,977円
投資のソムリエ（ターゲット・ イヤー2060）	- 円	790,977円
エマージング債券リスク抑制型 （適格機関投資家限定）	16,751,347,027円	10,583,670,917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）	2,044,980,656円	1,057,417,437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）	4,245,286,325円	1,963,944,077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）	4,605,400,717円	2,854,291,863円
	D I A M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）	4,132,286,126円	3,998,328,626円
	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドⅡ（適格機関投資家限 定）	2,192,663,196円	- 円
	P - O n eマルチアセット戦略 ファンド（適格機関投資家限 定）	4,231,991,681円	4,231,991,681円
計		52,757,465,400円	46,374,799,702円
2 .	受益権の総数	52,757,465,400口	46,374,799,702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	平成31年1月11日現在	令和1年7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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000	432,620,000	-	432,600,000	20,000
アメリカ・ドル	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000	432,620,000	-	432,600,000	20,000
合計	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000	432,620,000	-	432,600,000	20,000

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末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。
計算期間末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。
計算期間末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。
・ 計算期間末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。
・ 計算期間末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. 計算期間末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、計算期間末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）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7895円	1.9582円
（1万口当たり純資産額）	(17,895円)	(19,582円)

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

（2019年7月31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。

2019年7月31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	1,188,004,242,151
追加型株式投資信託	873	13,682,222,597,933
単位型公社債投資信託	42	117,985,594,596
単位型株式投資信託	164	1,274,431,192,895
合計	1,105	16,262,643,627,575

（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

2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社（以下「MGAI」といいます。）の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社（新商号：アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社）としました。

（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34期事業年度（自2018年4月1日至2019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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085
未収運用受託報酬	4,574,225	3,295,109
未収投資助言報酬	341,689	327,064
未収収益	59,526	56,925
前払費用	569,431	573,874
その他	427,238	491,914
流動資産計	78,896,169	77,197,195
固定資産		
有形固定資産	1,643,826	1,461,316
建物	1 1,156,953	1 1,096,916
器具備品	1 476,504	1 364,399
建設仮勘定	10,368	-
無形固定資産	1,934,700	2,411,540
ソフトウェア	1,026,319	885,545
ソフトウェア仮勘定	904,389	1,522,040
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	60	23
投資その他の資産	8,270,313	9,269,808
投資有価証券	1,721,433	1,611,931
関係会社株式	3,229,196	4,499,196
長期差入保証金	1,518,725	1,312,328
繰延税金資産	1,699,533	1,748,459
その他	101,425	97,892
固定資産計	11,848,840	13,142,665
資産合計	90,745,010	90,339,861

（単位：千円）

	第33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
（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	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第33期 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）		第34期 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬	84,705,447		84,812,585	
運用受託報酬	19,124,427		16,483,356	
投資助言報酬	1,217,672		1,235,553	
その他営業収益	117,586		113,622	
営業収益計		105,165,133		102,645,117
営業費用				
支払手数料	37,242,284		36,100,556	
広告宣伝費	379,873		387,028	
公告費	1,485		375	
調査費	23,944,438		24,389,003	
調査費	10,677,166		9,956,757	
委託調査費	13,267,272		14,432,246	
委託計算費	1,073,938		936,075	
営業雑経費	1,215,963		1,254,114	
通信費	48,704		47,007	
印刷費	947,411		978,185	
協会費	64,331		63,558	
諸会費	22,412		22,877	
支払販売手数料	133,104		142,485	
営業費用計		63,857,984		63,067,153
一般管理費				
給料	11,304,873		10,859,354	
役員報酬	189,022		189,198	
給料・手当	9,565,921		9,098,957	
賞与	1,549,929		1,571,197	
交際費	58,863		60,115	
寄付金	5,150		7,255	
旅費交通費	395,605		361,479	
租税公課	625,498		588,172	
不動産賃借料	1,534,255		1,511,876	
退職給付費用	595,876		521,184	
固定資産減価償却費	1,226,472		590,667	
福利厚生費	49,797		45,292	
修繕費	4,620		16,247	
賞与引当金繰入額	1,393,911		1,344,466	
役員賞与引当金繰入額	49,986		48,609	
機器リース料	148		130	
事務委託費	3,037,804		3,302,806	
事務用消耗品費	144,804		131,074	
器具備品費	5,253		8,112	
諸経費	149,850		188,367	
一般管理費計		20,582,772		19,585,212
営業利益		20,724,376		19,992,752

（単位：千円）

	第33期 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）		第34期 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	1,430		1,749	
受取配当金	74,278		73,517	
時効成立分配金・償還金	256		8,582	
為替差益	8,530		-	
投資信託解約益	236,398		-	
投資信託償還益	93,177		-	
受取負担金	-		177,066	
雑収入	10,306		24,919	
時効後支払損引当金戻入額	17,429		19,797	
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損	-		17,542	
投資信託解約損	4,138		-	
投資信託償還損	17,065		-	
金銭の信託運用損	99,303		175,164	
雑損失	-		5,659	
営業外費用計		120,507		198,365
経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益	1		-	
投資有価証券売却益	479,323		353,644	
関係会社株式売却益	1 1,492,680		1 -	
本社移転費用引当金戻入額	138,294		-	
その他特別利益	350		-	
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2 36,992		2 19,121	
固定資産売却損	134		-	
退職給付制度終了損	690,899		-	
システム移行損失	76,007		-	
その他特別損失	50		-	
特別損失計		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516

（３）【株主資本等変動計算書】

第33期（自 2017年4月1日 至 2018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	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

	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	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

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

注記事項

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。 (5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる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。

表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。 この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。

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33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
建物	140,580	229,897
器具備品	847,466	927,688

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
関係会社株式売却益	1,492,680	-

2. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウェア	28,472	17,130
電話加入権	3	-

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017年6月22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
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式					

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

2019年6月20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
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					

（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33期（2018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	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

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	-

（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33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
非上場株式	272,464	276,764
関係会社株式	3,229,196	4,499,196

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 其他有価証券」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33期（2018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	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

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 其他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

（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33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円）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、記載しておりません。

2. その他有価証券

第33期（2018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	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
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	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

（注）非上場株式（貸借対照表計上額272,464千円）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276,674千円）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33期（自 2017年4月1日 至 2018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	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

（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、解約又は償還によるものであります。

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	-	-	-

（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。

なお、当社は2017年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,316,796	-
退職一時金制度改定に伴う増加額	526,345	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,417,152	-
年金資産の期末残高	-	-

（3）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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未積立退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未認識数理計算上の差異	204,636	150,568
未認識過去勤務費用	312,836	243,317
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
制度移行に伴う損失(注)	690,899	-

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019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. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	300,927	-
退職給付費用	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	391,600	-
退職一時金制度改定に伴う振替額	108,189	-
退職給付引当金の期末残高	-	-

(2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 53,156千円 当事業年度 - 千円

4. 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86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

（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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	290,493	173,805
未払事業所税	11,683	10,915
賞与引当金	426,815	411,675
未払法定福利費	81,186	80,253
未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額（一括償却資産）	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額（税法上）	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	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
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

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
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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円

(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	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

(2) 損益計算書項目

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,012,128千円	9,043,138千円
経常利益	9,012,128千円	9,043,138千円
税引前当期純利益	9,012,128千円	9,091,728千円
当期純利益	7,419,617千円	7,489,721千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭	187,243円04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	5,233,360千円	5,241,252千円

（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33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）及び第34期（自 2018年4月1日 至 2019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33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

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。

（2）子会社及び関連会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

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。

(3) 兄弟会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018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	6,470,802	未払 手数料	894,336
	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	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

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

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33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92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33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
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	15,650,211千円	14,119,516千円
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

2019年5月30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 業務執行社員	公認会計士	湯原 尚	印
--------------------	-------	------	---

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

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第34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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

監査意見

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2019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すべ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。

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1年8月30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 丘本 正彦 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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド エボリューションの平成31年1月12日から令和1年7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、マネックス資産設計ファンド エボリューションの令和1年7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（平成31年1月12日から令和1年7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）X B R L データは監査の対象には含まれておりません。