

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年5月8日提出
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース 募集額 3,000億円を上限とします。 りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース 募集額 3,000億円を上限とします。 りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース 募集額 3,000億円を上限とします。 りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース 募集額 3,000億円を上限とします。 りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース 募集額 3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年11月12日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、有価証券報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第一部【証券情報】

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

<訂正前>

(略)

委託会社である損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社（2020年4月1日付でSOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更する予定です。以下同じ。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

(略)

(4)【発行（売出）価格】

<訂正前>

(略)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>（2020年4月1日付で<https://www.sompo-am.co.jp/>に変更する予定です。以下同じ。）

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

(8)【申込取扱場所】

<訂正前>

(略)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

(略)

<ファンドの特色>

(略)



為替取引の異なる5コース(アジア通貨コース、高金利通貨コース、ブラジルリアルコース、米ドルコース、日本円コース)があります。

●各ファンド(米ドルコースを除きます。)が主要投資対象とする外国投資信託では、それぞれ異なる為替取引(原則として、米ドル等売り/対象通貨買い)を行います。

アジア通貨コース	アジア通貨(インド・ルピー、インドネシア・ルピア、オーストラリア・ドルに原則均等配分)で為替取引を行います。 投資候補通貨:インド・ルピー、インドネシア・ルピア、フィリピン・ペソ、韓国・ウォン、マレーシア・リング、オーストラリア・ドル
高金利通貨コース	高金利通貨(ブラジル・リアル、トルコ・リラ、南アフリカ・ランドに原則均等配分)で為替取引を行います。 投資候補通貨:ブラジル・リアル、メキシコ・ペソ、トルコ・リラ、ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、カナダ・ドル、オーストラリア・ドル、南アフリカ・ランド
ブラジルリアルコース	ブラジル・リアルで為替取引を行います。
米ドルコース	原則として対円での為替ヘッジを行いません。
日本円コース	原則として対円での為替ヘッジを行います。

※ アジア通貨コース及び高金利通貨コースの通貨構成に関しては、投資候補通貨の流動性・金利状況などを総合的に勘案して、定期的に見直しを行います。上記の投資候補通貨及び通貨構成は2019年8月末におけるものであり、今後変更となる可能性があります。なお、通貨構成は必ずしも相対的に金利の高い上位通貨から選定されるとは限りません。

(略)

< 訂正後 >

(略)

<ファンドの特色>

(略)

2

為替取引の異なる5コース(アジア通貨コース、高金利通貨コース、ブラジルリアルコース、米ドルコース、日本円コース)があります。

- 各ファンド(米ドルコースを除きます。)が主要投資対象とする外国投資信託では、それぞれ異なる為替取引(原則として、米ドル等売り/対象通貨買い)を行います。

アジア通貨コース	アジア通貨(インド・ルピー、インドネシア・ルピア、オーストラリア・ドルに原則均等配分)で為替取引を行います。 投資候補通貨:インド・ルピー、インドネシア・ルピア、フィリピン・ペソ、韓国・ウォン、マレーシア・リング、オーストラリア・ドル
高金利通貨コース	高金利通貨(ブラジル・リアル、トルコ・リラ、南アフリカ・ランドに原則均等配分)で為替取引を行います。 投資候補通貨:ブラジル・リアル、メキシコ・ペソ、トルコ・リラ、ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、カナダ・ドル、オーストラリア・ドル、南アフリカ・ランド
ブラジルリアルコース	ブラジル・リアルで為替取引を行います。
米ドルコース	原則として対円での為替ヘッジを行いません。
日本円コース	原則として対円での為替ヘッジを行います。

※ アジア通貨コース及び高金利通貨コースの通貨構成に関しては、投資候補通貨の流動性・金利状況などを総合的に勘案して、定期的に見直しを行います。上記の投資候補通貨及び通貨構成は2020年2月末におけるものであり、今後変更となる可能性があります。なお、通貨構成は必ずしも相対的に金利の高い上位通貨から選定されるとは限りません。

(略)

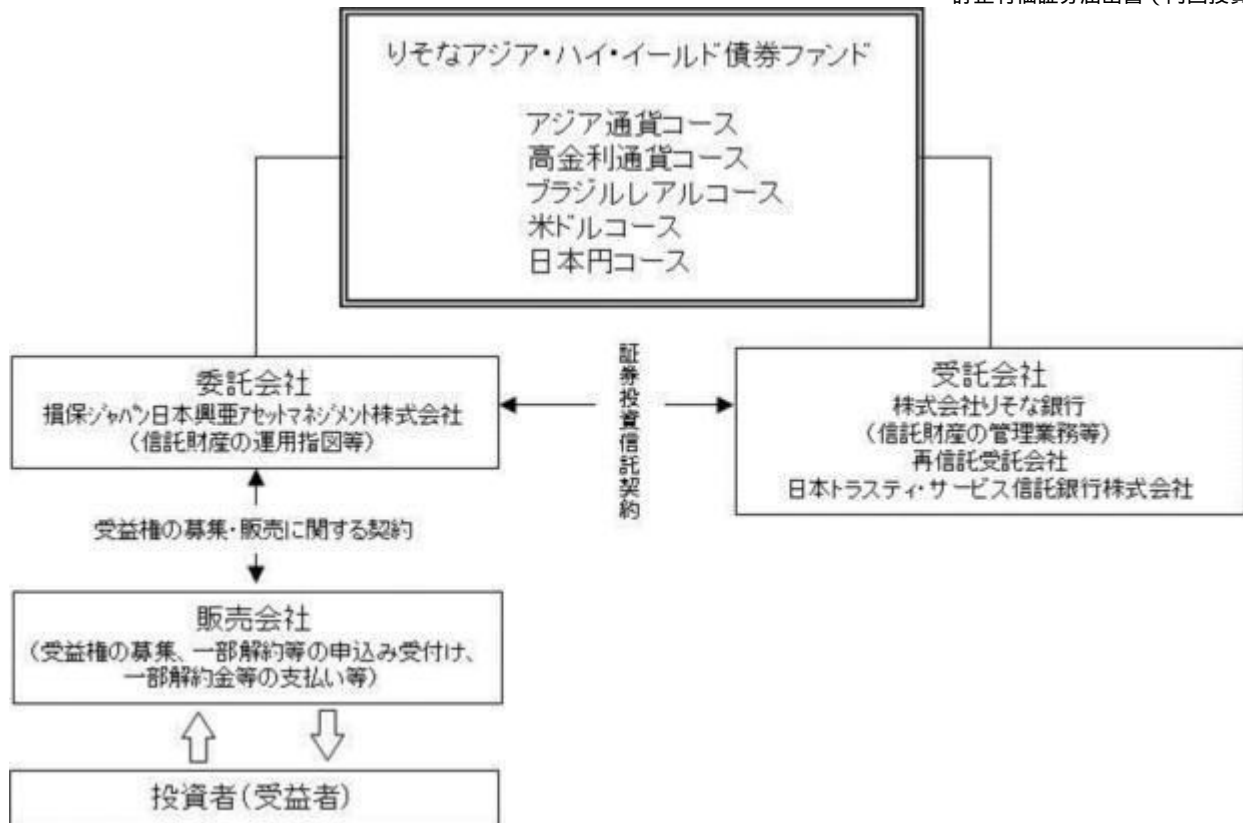
(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

ファンドの仕組み

(略)

ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

- () 委託会社または委託者：損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、目論見書及び運用報告書の作成等を行います。

(略)

- () 受託会社または受託者：株式会社りそな銀行

(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

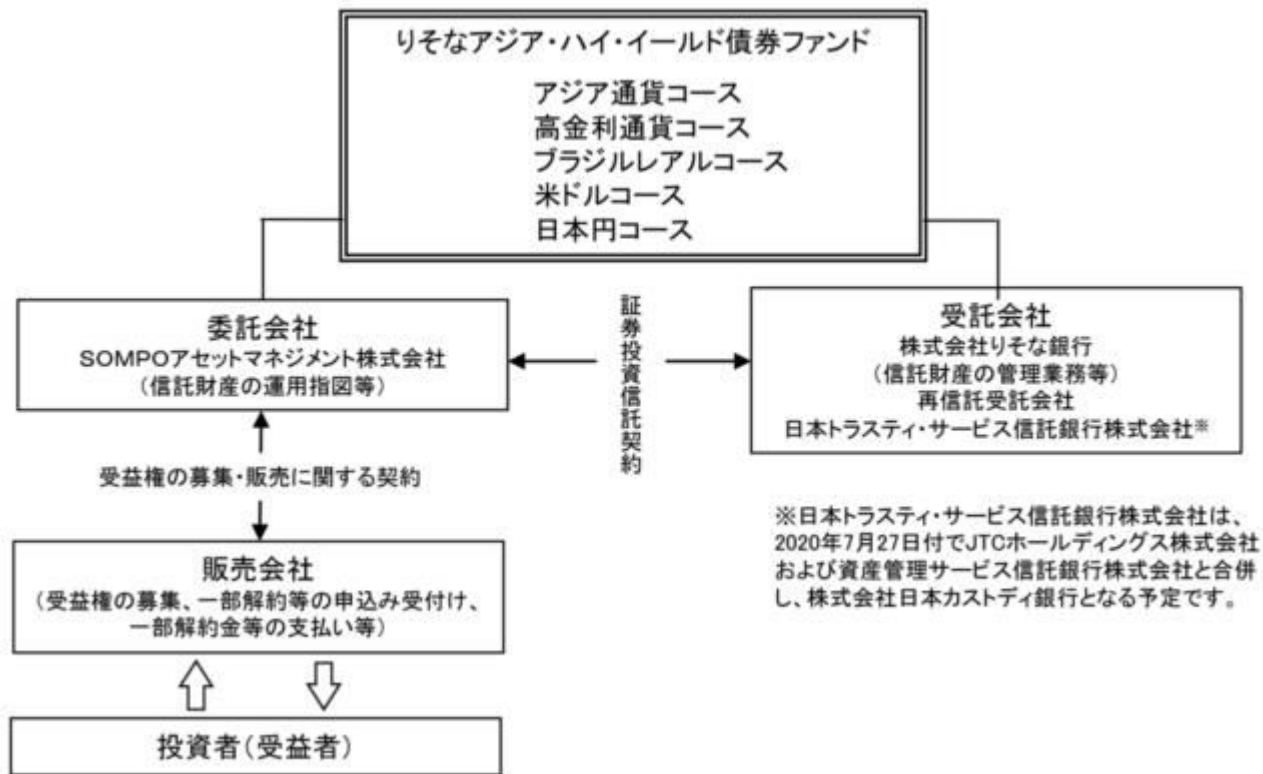
委託会社との証券投資信託契約に基づき、ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金および償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

<訂正後>

ファンドの仕組み

(略)

ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

() 委託会社または委託者：SOMPOアセットマネジメント株式会社

ファンドの委託会社として、信託財産の運用指図、目論見書及び運用報告書の作成等を行います。

(略)

() 受託会社または受託者：株式会社りそな銀行

(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

委託会社との証券投資信託契約に基づき、ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金および償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行となる予定です。以下同じ。

<訂正前>

委託会社等の概況

() 資本金の額 1,550百万円 (2019年8月末現在)

() 委託会社の沿革

1986年	2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
1987年	2月20日	投資顧問業の登録
1987年	9月9日	投資一任業務の認可取得
1991年	6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
1998年	1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

1998年	3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年	3月31日	証券投資信託委託業の免許取得
2002年	7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
2007年	9月30日	金融商品取引業者として登録
2010年	10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更
2020年	4月1日	SOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更(予定)

()大株主の状況(2019年8月末現在)

(略)

<訂正後>

委託会社等の概況

()資本金の額 1,550百万円 (2020年2月末現在)

()委託会社の沿革

1986年	2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
1987年	2月20日	投資顧問業の登録
1987年	9月9日	投資一任業務の認可取得
1991年	6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
1998年	1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
1998年	3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年	3月31日	証券投資信託委託業の免許取得
2002年	7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
2007年	9月30日	金融商品取引業者として登録
2010年	10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更
2020年	4月1日	SOMPOアセットマネジメント株式会社に商号変更

()大株主の状況(2020年2月末現在)

(略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

名 称	マネープールマザーファンド
形 態	国内籍親投資信託(円建て)
運用の基本方針	わが国の公社債等(残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券)に投資を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主 な 投 資 制 限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。 ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
設 定 日	2011年9月30日
信 託 期 間	無期限
決 算 日	原則として、毎年8月10日
信 託 報 酬 等	ありません。
申 込・解 約 手 数 料	ありません。
委 託 会 社	損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	株式会社りそな銀行

※各ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

<訂正後>

(略)

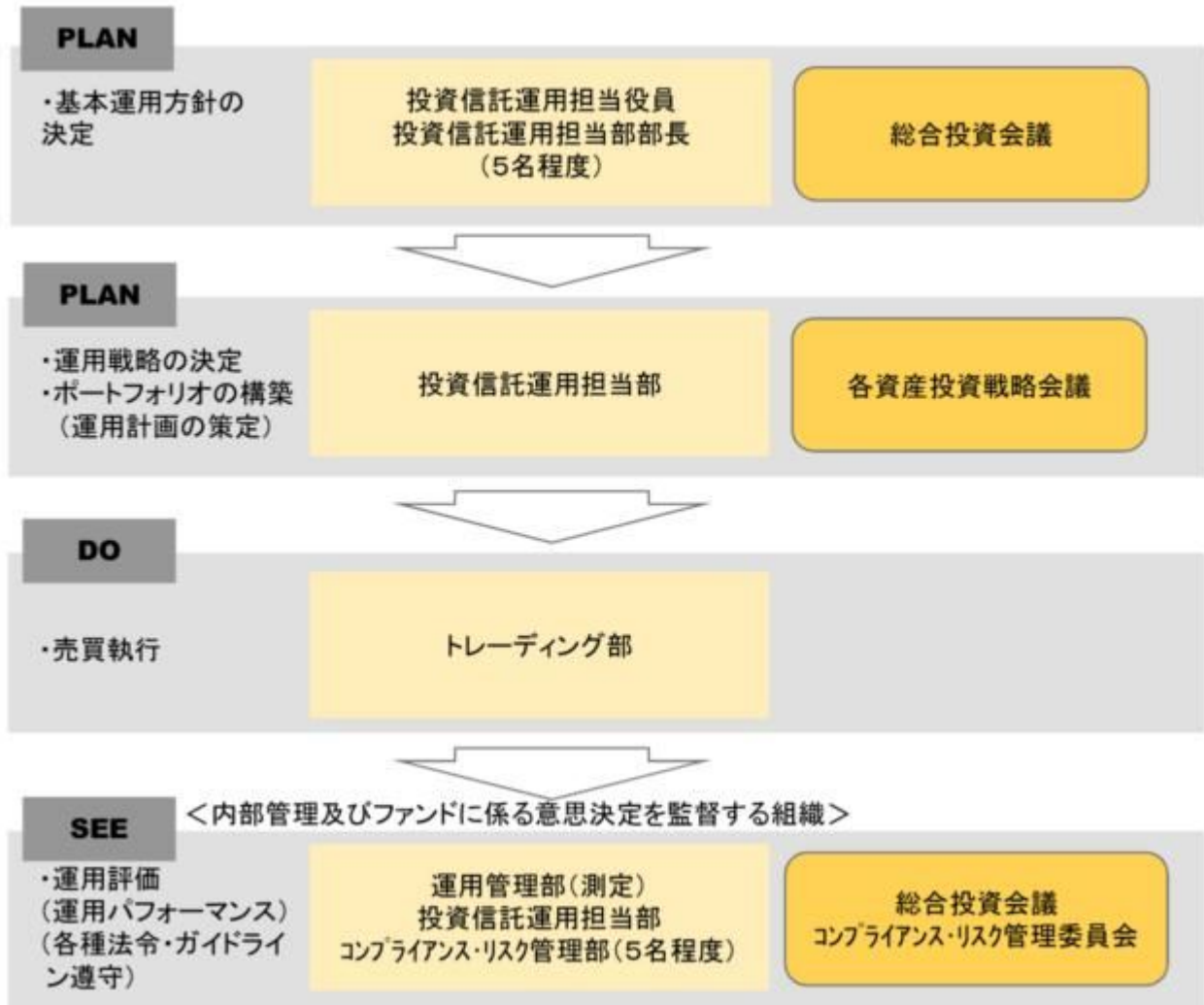
名 称	マネーブルマザーファンド
形 態	国内籍親投資信託(円建て)
運用の基本方針	わが国の公社債等(残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券)に投資を行い、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得したものに限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。 ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
設 定 日	2011年9月30日
信 託 期 間	無期限
決 算 日	原則として、毎年8月10日
信 託 報 酬 等	ありません。
申込・解約手数料	ありません。
委 託 会 社	SOMPOアセットマネジメント株式会社
受 託 会 社	株式会社りそな銀行

※各ファンドが主要投資対象とする投資信託証券の名称及びその運用会社の名称等は今後変更となる場合があります。

(3) 【運用体制】

<訂正前>

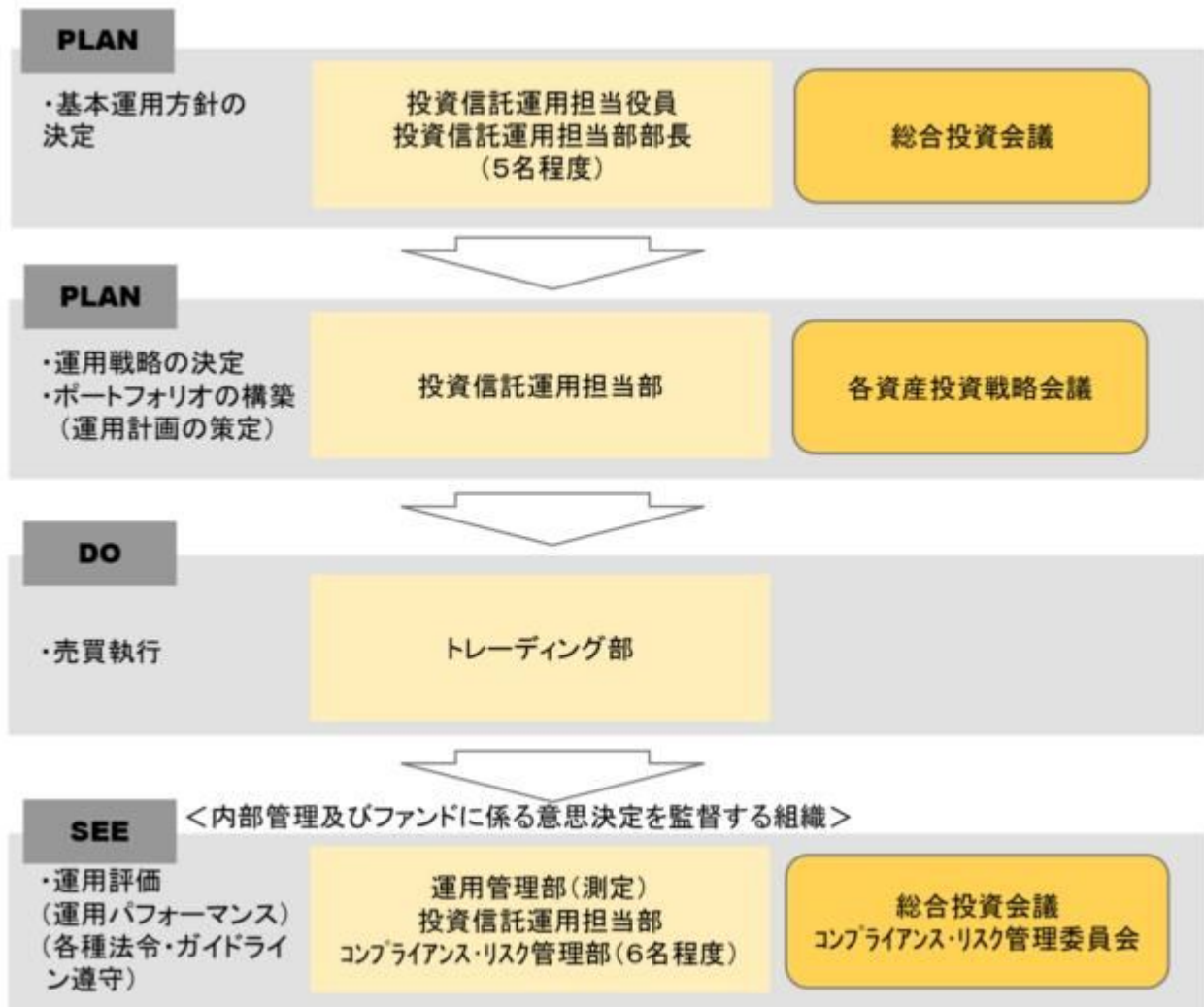
(略)



2019年8月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正後>

(略)



2020年2月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注) 上図は、2019年8月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

米ドルコース：

※ファンドの年間騰落率は、計算可能な期間より掲載して
います。

アジア通貨コース



ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

米ドルコース：

※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なります
で、ご注意ください。



高金利通貨コース



ブラジルリアルコース



米ドルコース



日本円コース



●上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。

●「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

代表的な資産クラスの指数

<p>日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)</p> <p>東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。</p>	<p>先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。</p>
<p>新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。</p>	<p>日本国債:NOMURA-BPI 国債</p> <p>野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>
<p>先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)</p> <p>FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。</p>	<p>新興国債:J PモルガンGBIーEMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)</p> <p>J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。</p>

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注)上図は、2020年2月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移

米ドルコース:

※ファンドの年間騰落率は、計算可能な期間より掲載して
います。

アジア通貨コース



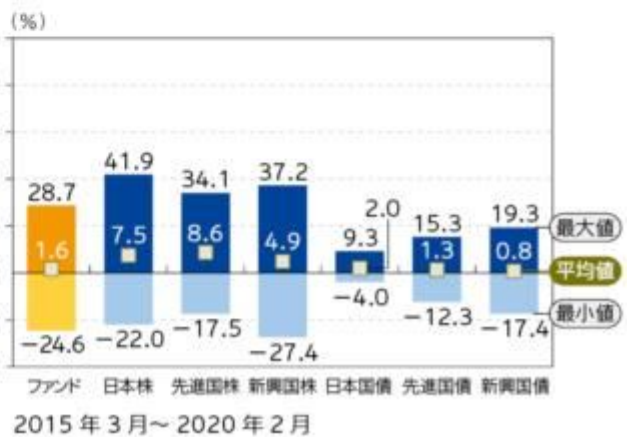
ファンドと他の代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

米ドルコース:

※ファンドと代表的な資産クラスの対象期間が異なります
で、ご注意ください。



高金利通貨コース



ブラジルリアルコース



米ドルコース



日本円コース



● 上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

● 上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。

● 「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

代表的な資産クラスの指数	
<p>日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)</p> <p>東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。</p>	<p>先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。</p>
<p>新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)</p> <p>MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。</p>	<p>日本国債:NOMURA-BPI 国債</p> <p>野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>
<p>先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)</p> <p>FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。</p>	<p>新興国債:J PモルガンGBIーEMグローバル・ディバースファイド(円ベース)</p> <p>J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。</p>

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2019年8月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

(略)

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

2020年2月28日現在

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	ケイマン	8,854,278,985	97.36
親投資信託受益証券	日本	96,199,581	1.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		143,992,145	1.58

純資産総額	9,094,470,711	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）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

2020年2月28日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	3,127,018,514	96.35
親投資信託受益証券	日本	38,665,535	1.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		79,634,603	2.46
純資産総額		3,245,318,652	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）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

2020年2月28日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	3,950,806,710	96.59
親投資信託受益証券	日本	45,374,756	1.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		94,173,434	2.30
純資産総額		4,090,354,900	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）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

2020年2月28日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	176,168,921	96.00
親投資信託受益証券	日本	1,863,910	1.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,483,600	2.98
純資産総額		183,516,431	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）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

2020年2月28日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	ケイマン	291,196,419	96.34
親投資信託受益証券	日本	3,252,063	1.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,797,039	2.58
純資産総額		302,245,521	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）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）マネープールマザーファンド

2020年2月28日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		212,333,644	100.00
純資産総額		212,333,644	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）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

2020年2月28日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	ケイマン	投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 4	23,502,235.16	323.11	7,593,877,709	320.86	7,541,044,684	82.92
2	ケイマン	投資信託受益証券	Lion Asian High Yield Bond 4	3,579,007	371.03	1,327,951,178	366.92	1,313,234,301	14.44
3	日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	95,969,255	1.0024	96,199,581	1.0024	96,199,581	1.06

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年2月28日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	97.36
親投資信託受益証券	1.06
合計	98.42

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

2020年2月28日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ケイマン	投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 3	14,737,849.39	149.98	2,210,397,389	147.28	2,170,664,147	66.89
2	ケイマン	投資信託受益証券	Lion Asian High Yield Bond 3	5,087,722	192.32	978,501,221	187.97	956,354,367	29.47
3	日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	38,572,960	1.0024	38,665,535	1.0024	38,665,535	1.19

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年2月28日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	96.35
親投資信託受益証券	1.19
合計	97.55

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

2020年2月28日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ケイマン	投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 2	16,226,189	154.14	2,501,185,903	149.58	2,427,194,481	59.34
2	ケイマン	投資信託受益証券	Lion Asian High Yield Bond 2	8,965,853	175.64	1,574,762,420	169.93	1,523,612,229	37.25
3	日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	45,266,118	1.0024	45,374,756	1.0024	45,374,756	1.11

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年2月28日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	96.59
親投資信託受益証券	1.11
合計	97.70

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

2020年2月28日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	ケイマン	投資信託受益証券	Lion Asian High Yield Bond 5	129,031	867.77	111,969,359	869.8	112,231,292	61.16
2	ケイマン	投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 5	81,874.33	776.15	63,546,973	780.92	63,937,629	34.84
3	日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	1,859,448	1.0024	1,863,910	1.0024	1,863,910	1.02

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年2月28日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	96.00
親投資信託受益証券	1.02
合計	97.01

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

2020年2月28日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
1	ケイマン	投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 1	476,883.92	398.66	190,118,835	400.19	190,848,467	63.14
2	ケイマン	投資信託受益証券	Lion Asian High Yield Bond 1	168,795	594.87	100,411,250	594.49	100,347,952	33.20
3	日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	3,244,277	1.0024	3,252,063	1.0024	3,252,063	1.08

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年2月28日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	96.34
親投資信託受益証券	1.08
合計	97.42

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）マネープールマザーファンド

該当事項はありません。

投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

該当事項はありません。

（参考）マネープールマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

該当事項はありません。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

該当事項はありません。

(参考) マネープールマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

直近日（2020年2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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末 (2012年 2月10日)	851,788,084	863,734,581	1.1408	1.1568
第2特定期間末 (2012年 8月10日)	2,101,615,189	2,136,044,197	1.0988	1.1168
第3特定期間末 (2013年 2月12日)	5,323,305,909	5,397,065,030	1.4434	1.4634
第4特定期間末 (2013年 8月12日)	9,952,262,424	10,196,207,682	1.2239	1.2539
第5特定期間末 (2014年 2月10日)	13,064,733,811	13,413,058,817	1.1252	1.1552
第6特定期間末 (2014年 8月11日)	30,785,532,920	31,669,582,232	1.0447	1.0747

第7特定期間末	(2015年 2月10日)	70,083,499,566	72,345,409,845	0.9295	0.9595
第8特定期間末	(2015年 8月10日)	77,146,605,253	79,500,590,228	0.8193	0.8443
第9特定期間末	(2016年 2月10日)	50,806,604,605	52,023,330,190	0.6681	0.6841
第10特定期間末	(2016年 8月10日)	33,368,202,584	33,744,258,371	0.6211	0.6281
第11特定期間末	(2017年 2月10日)	23,190,010,406	23,363,011,126	0.6702	0.6752
第12特定期間末	(2017年 8月10日)	18,653,894,273	18,794,119,860	0.6651	0.6701
第13特定期間末	(2018年 2月13日)	15,384,925,808	15,507,130,951	0.6295	0.6345
第14特定期間末	(2018年 8月10日)	12,840,535,771	12,930,657,313	0.5699	0.5739
第15特定期間末	(2019年 2月12日)	11,301,406,220	11,382,250,925	0.5592	0.5632
第16特定期間末	(2019年 8月13日)	9,797,879,858	9,871,688,329	0.5310	0.5350
第17特定期間末	(2020年 2月10日)	9,252,179,951	9,318,735,185	0.5561	0.5601
	2019年 2月末日	11,383,209,439		0.5676	
	3月末日	11,324,406,947		0.5746	
	4月末日	11,116,853,609		0.5752	
	5月末日	10,769,278,738		0.5629	
	6月末日	10,581,589,784		0.5578	
	7月末日	10,340,555,357		0.5585	
	8月末日	9,716,016,426		0.5282	
	9月末日	9,855,260,705		0.5422	
	10月末日	9,866,234,934		0.5527	
	11月末日	9,570,483,855		0.5506	
	12月末日	9,496,503,535		0.5593	
	2020年 1月末日	9,225,550,863		0.5525	
	2月末日	9,094,470,711		0.5516	

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

直近日（2020年2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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末	(2012年 2月10日)	167,800,161	170,644,579	1.1799	1.1999
第2特定期間末	(2012年 8月10日)	958,155,537	977,603,620	1.0839	1.1059
第3特定期間末	(2013年 2月12日)	5,429,768,172	5,516,853,027	1.3717	1.3937
第4特定期間末	(2013年 8月12日)	9,177,007,467	9,408,446,158	1.1499	1.1789
第5特定期間末	(2014年 2月10日)	9,082,093,888	9,342,993,697	1.0095	1.0385
第6特定期間末	(2014年 8月11日)	15,810,128,615	16,294,075,332	0.9474	0.9764
第7特定期間末	(2015年 2月10日)	19,016,038,800	19,704,278,989	0.8013	0.8303
第8特定期間末	(2015年 8月10日)	12,954,799,999	13,387,904,208	0.6581	0.6801
第9特定期間末	(2016年 2月10日)	8,440,421,146	8,662,807,355	0.4934	0.5064
第10特定期間末	(2016年 8月10日)	7,184,680,949	7,286,217,694	0.4953	0.5023
第11特定期間末	(2017年 2月10日)	6,161,761,924	6,247,545,250	0.5028	0.5098
第12特定期間末	(2017年 8月10日)	5,736,824,966	5,818,868,693	0.4895	0.4965

第13特定期間末	(2018年 2月13日)	5,761,200,016	5,849,351,653	0.4575	0.4645
第14特定期間末	(2018年 8月10日)	4,480,865,725	4,543,134,109	0.3598	0.3648
第15特定期間末	(2019年 2月12日)	4,209,142,581	4,268,920,112	0.3521	0.3571
第16特定期間末	(2019年 8月13日)	3,651,750,363	3,709,435,155	0.3165	0.3215
第17特定期間末	(2020年 2月10日)	3,331,355,720	3,375,179,362	0.3041	0.3081
	2019年 2月末日	4,272,006,719		0.3558	
	3月末日	4,064,648,910		0.3413	
	4月末日	4,023,363,300		0.3381	
	5月末日	3,938,001,949		0.3311	
	6月末日	3,901,209,515		0.3316	
	7月末日	3,903,760,174		0.3382	
	8月末日	3,527,309,516		0.3047	
	9月末日	3,574,709,126		0.3131	
	10月末日	3,625,933,749		0.3188	
	11月末日	3,549,837,525		0.3144	
	12月末日	3,556,027,781		0.3207	
	2020年 1月末日	3,364,625,548		0.3070	
	2月末日	3,245,318,652		0.2982	

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

直近日（2020年2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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末	(2012年 2月10日)	1,531,729,499	1,562,406,989	1.1484	1.1714
第2特定期間末	(2012年 8月10日)	10,467,548,266	10,736,284,398	0.9543	0.9788
第3特定期間末	(2013年 2月12日)	70,118,934,983	71,531,921,657	1.2158	1.2403
第4特定期間末	(2013年 8月12日)	55,543,309,136	57,030,276,822	0.9712	0.9972
第5特定期間末	(2014年 2月10日)	51,649,725,548	53,143,321,421	0.8991	0.9251
第6特定期間末	(2014年 8月11日)	36,124,090,805	37,217,775,926	0.8588	0.8848
第7特定期間末	(2015年 2月10日)	19,344,933,096	19,893,452,938	0.7054	0.7254
第8特定期間末	(2015年 8月10日)	11,498,186,398	11,817,310,304	0.5405	0.5555
第9特定期間末	(2016年 2月10日)	7,969,104,911	8,155,659,752	0.4272	0.4372
第10特定期間末	(2016年 8月10日)	7,856,892,070	7,973,775,621	0.4705	0.4775
第11特定期間末	(2017年 2月10日)	8,983,510,025	9,104,921,563	0.5179	0.5249
第12特定期間末	(2017年 8月10日)	8,880,045,069	9,006,021,229	0.4934	0.5004
第13特定期間末	(2018年 2月13日)	8,472,899,418	8,608,767,292	0.4365	0.4435
第14特定期間末	(2018年 8月10日)	6,511,904,751	6,583,865,885	0.3620	0.3660
第15特定期間末	(2019年 2月12日)	5,750,487,679	5,816,589,870	0.3480	0.3520
第16特定期間末	(2019年 8月13日)	4,883,237,133	4,946,073,184	0.3109	0.3149
第17特定期間末	(2020年 2月10日)	4,243,619,801	4,287,589,628	0.2895	0.2925
	2019年 2月末日	5,850,584,763		0.3546	

3月末日	5,495,266,679		0.3368
4月末日	5,510,177,614		0.3385
5月末日	5,366,901,757		0.3307
6月末日	5,333,016,697		0.3300
7月末日	5,300,289,037		0.3359
8月末日	4,658,043,452		0.2958
9月末日	4,710,577,396		0.2998
10月末日	4,866,560,336		0.3112
11月末日	4,561,133,099		0.2957
12月末日	4,592,513,185		0.3090
2020年 1月末日	4,278,522,798		0.2912
2月末日	4,090,354,900		0.2808

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

直近日（2020年2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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（2014年 8月11日）	269,949,884	271,287,433	1.0091	1.0141
第2特定期間末（2015年 2月10日）	539,615,494	542,063,431	1.1022	1.1072
第3特定期間末（2015年 8月10日）	578,177,946	581,677,137	1.1566	1.1636
第4特定期間末（2016年 2月10日）	754,971,413	760,012,122	1.0484	1.0554
第5特定期間末（2016年 8月10日）	557,380,820	561,467,317	0.9548	0.9618
第6特定期間末（2017年 2月10日）	383,071,938	384,542,807	1.0418	1.0458
第7特定期間末（2017年 8月10日）	355,619,937	357,019,502	1.0164	1.0204
第8特定期間末（2018年 2月13日）	268,672,334	269,768,628	0.9803	0.9843
第9特定期間末（2018年 8月10日）	249,999,138	251,057,707	0.9447	0.9487
第10特定期間末（2019年 2月12日）	220,912,189	221,853,899	0.9383	0.9423
第11特定期間末（2019年 8月13日）	186,266,795	187,084,464	0.9112	0.9152
第12特定期間末（2020年 2月10日）	174,168,014	174,901,209	0.9502	0.9542
2019年 2月末日	220,020,774		0.9484	
3月末日	216,544,477		0.9592	
4月末日	214,679,758		0.9657	
5月末日	210,130,256		0.9490	
6月末日	207,136,328		0.9358	
7月末日	192,405,888		0.9413	
8月末日	191,711,050		0.9142	
9月末日	196,295,978		0.9305	
10月末日	198,658,977		0.9407	
11月末日	199,793,059		0.9451	
12月末日	183,907,795		0.9482	
2020年 1月末日	172,534,309		0.9413	

2月末日	183,516,431		0.9531	
------	-------------	--	--------	--

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

直近日（2020年2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（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間末（2012年 2月10日）	1,578,924,692	1,593,391,266	1.0914	1.1014
第2特定期間末（2012年 8月10日）	3,157,012,975	3,188,416,985	1.1058	1.1168
第3特定期間末（2013年 2月12日）	17,283,645,027	17,456,864,191	1.0976	1.1086
第4特定期間末（2013年 8月12日）	7,814,898,420	7,898,922,130	1.0231	1.0341
第5特定期間末（2014年 2月10日）	4,409,811,394	4,458,901,323	0.9881	0.9991
第6特定期間末（2014年 8月11日）	2,709,435,933	2,740,425,582	0.9617	0.9727
第7特定期間末（2015年 2月10日）	1,614,413,930	1,634,895,667	0.8670	0.8780
第8特定期間末（2015年 8月10日）	1,071,140,064	1,078,770,534	0.8423	0.8483
第9特定期間末（2016年 2月10日）	770,475,585	776,181,558	0.8102	0.8162
第10特定期間末（2016年 8月10日）	645,311,632	648,387,176	0.8393	0.8433
第11特定期間末（2017年 2月10日）	727,085,291	730,620,640	0.8226	0.8266
第12特定期間末（2017年 8月10日）	588,126,818	591,045,068	0.8061	0.8101
第13特定期間末（2018年 2月13日）	458,667,983	461,009,706	0.7835	0.7875
第14特定期間末（2018年 8月10日）	365,334,449	366,837,377	0.7292	0.7322
第15特定期間末（2019年 2月12日）	347,737,626	349,184,716	0.7209	0.7239
第16特定期間末（2019年 8月13日）	296,273,036	297,519,775	0.7129	0.7159
第17特定期間末（2020年 2月10日）	305,608,390	306,889,640	0.7156	0.7186
2019年 2月末日	342,657,790		0.7245	
3月末日	333,095,871		0.7333	
4月末日	324,562,921		0.7315	
5月末日	317,579,142		0.7280	
6月末日	307,184,805		0.7248	
7月末日	300,151,903		0.7207	
8月末日	296,277,681		0.7120	
9月末日	296,901,082		0.7121	
10月末日	298,755,026		0.7156	
11月末日	293,852,851		0.7151	
12月末日	305,218,898		0.7153	
2020年 1月末日	305,739,000		0.7158	
2月末日	302,245,521		0.7168	

【分配の推移】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0640
第2特定期間	0.1080
第3特定期間	0.1120
第4特定期間	0.1700
第5特定期間	0.1800
第6特定期間	0.1800
第7特定期間	0.1800
第8特定期間	0.1600
第9特定期間	0.1050
第10特定期間	0.0510
第11特定期間	0.0320
第12特定期間	0.0300
第13特定期間	0.0300
第14特定期間	0.0250
第15特定期間	0.0240
第16特定期間	0.0240
第17特定期間	0.0240

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0800
第2特定期間	0.1320
第3特定期間	0.1320
第4特定期間	0.1670
第5特定期間	0.1740
第6特定期間	0.1740
第7特定期間	0.1740
第8特定期間	0.1320
第9特定期間	0.0870
第10特定期間	0.0480
第11特定期間	0.0420
第12特定期間	0.0420
第13特定期間	0.0420
第14特定期間	0.0320
第15特定期間	0.0300
第16特定期間	0.0300
第17特定期間	0.0260

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0920
第2特定期間	0.1470
第3特定期間	0.1470
第4特定期間	0.1545
第5特定期間	0.1560
第6特定期間	0.1560
第7特定期間	0.1440
第8特定期間	0.1050
第9特定期間	0.0650
第10特定期間	0.0450
第11特定期間	0.0420
第12特定期間	0.0420
第13特定期間	0.0420
第14特定期間	0.0270
第15特定期間	0.0240
第16特定期間	0.0240
第17特定期間	0.0200

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0100
第2特定期間	0.0300
第3特定期間	0.0360
第4特定期間	0.0420
第5特定期間	0.0420
第6特定期間	0.0270
第7特定期間	0.0240
第8特定期間	0.0240
第9特定期間	0.0240
第10特定期間	0.0240
第11特定期間	0.0240
第12特定期間	0.0240

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0400
第2特定期間	0.0660

第3特定期間	0.0660
第4特定期間	0.0660
第5特定期間	0.0660
第6特定期間	0.0660
第7特定期間	0.0660
第8特定期間	0.0510
第9特定期間	0.0360
第10特定期間	0.0260
第11特定期間	0.0240
第12特定期間	0.0240
第13特定期間	0.0240
第14特定期間	0.0190
第15特定期間	0.0180
第16特定期間	0.0180
第17特定期間	0.0180

【収益率の推移】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

	収益率（％）
第1特定期間	20.5
第2特定期間	5.8
第3特定期間	41.6
第4特定期間	3.4
第5特定期間	6.6
第6特定期間	8.8
第7特定期間	6.2
第8特定期間	5.4
第9特定期間	5.6
第10特定期間	0.6
第11特定期間	13.1
第12特定期間	3.7
第13特定期間	0.8
第14特定期間	5.5
第15特定期間	2.3
第16特定期間	0.8
第17特定期間	9.2

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

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。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

	収益率（％）
第1特定期間	26.0
第2特定期間	3.1
第3特定期間	38.7
第4特定期間	4.0
第5特定期間	2.9
第6特定期間	11.1
第7特定期間	2.9
第8特定期間	1.4
第9特定期間	11.8
第10特定期間	10.1
第11特定期間	10.0
第12特定期間	5.7
第13特定期間	2.0
第14特定期間	14.4
第15特定期間	6.2
第16特定期間	1.6
第17特定期間	4.3

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

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。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

	収益率（％）
第1特定期間	24.0
第2特定期間	4.1
第3特定期間	42.8
第4特定期間	7.4
第5特定期間	8.6
第6特定期間	12.9
第7特定期間	1.1
第8特定期間	8.5
第9特定期間	8.9
第10特定期間	20.7
第11特定期間	19.0
第12特定期間	3.4
第13特定期間	3.0
第14特定期間	10.9

第15特定期間	2.8
第16特定期間	3.8
第17特定期間	0.5

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

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。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

	収益率（％）
第1特定期間	1.9
第2特定期間	12.2
第3特定期間	8.2
第4特定期間	5.7
第5特定期間	4.9
第6特定期間	11.9
第7特定期間	0.1
第8特定期間	1.2
第9特定期間	1.2
第10特定期間	1.9
第11特定期間	0.3
第12特定期間	6.9

（注）各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

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。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

	収益率（％）
第1特定期間	13.1
第2特定期間	7.4
第3特定期間	5.2
第4特定期間	0.8
第5特定期間	3.0
第6特定期間	4.0
第7特定期間	3.0
第8特定期間	3.0
第9特定期間	0.5
第10特定期間	6.8
第11特定期間	0.9
第12特定期間	0.9
第13特定期間	0.2

第14特定期間	4.5
第15特定期間	1.3
第16特定期間	1.4
第17特定期間	2.9

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,251,024,703	504,368,638
第2特定期間	1,565,776,525	399,709,915
第3特定期間	3,615,832,631	1,840,599,243
第4特定期間	7,043,307,704	2,599,755,140
第5特定期間	6,698,200,984	3,218,876,053
第6特定期間	22,113,531,235	4,256,054,367
第7特定期間	51,888,908,576	5,960,209,676
第8特定期間	37,517,110,551	18,754,720,842
第9特定期間	7,823,452,567	25,937,502,524
第10特定期間	2,448,841,278	24,771,935,070
第11特定期間	625,865,580	19,747,976,858
第12特定期間	647,338,579	7,202,365,010
第13特定期間	723,376,462	4,327,465,396
第14特定期間	580,793,043	2,491,436,097
第15特定期間	222,741,062	2,541,950,329
第16特定期間	295,230,488	2,054,289,024
第17特定期間	285,788,134	2,099,097,383

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	167,566,543	25,345,602
第2特定期間	791,713,546	49,930,702
第3特定期間	4,650,846,693	1,576,447,934
第4特定期間	6,802,853,416	2,780,611,434
第5特定期間	3,742,231,276	2,726,330,643
第6特定期間	10,589,634,669	2,898,361,997

第7特定期間	11,858,063,864	4,813,461,367
第8特定期間	4,140,506,490	8,186,371,846
第9特定期間	2,060,944,450	4,640,867,905
第10特定期間	1,290,120,330	3,891,502,547
第11特定期間	474,210,876	2,724,699,311
第12特定期間	1,096,120,520	1,630,348,954
第13特定期間	2,344,502,971	1,471,944,368
第14特定期間	992,436,574	1,131,850,669
第15特定期間	437,835,789	936,006,477
第16特定期間	433,479,006	852,026,742
第17特定期間	425,344,107	1,006,391,900

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,592,499,070	258,695,114
第2特定期間	10,576,537,329	941,519,550
第3特定期間	62,490,066,960	15,785,963,216
第4特定期間	32,544,989,384	33,026,849,983
第5特定期間	18,102,773,734	17,847,843,468
第6特定期間	8,892,104,563	24,273,287,358
第7特定期間	5,042,206,493	19,681,026,725
第8特定期間	3,075,409,899	9,226,474,945
第9特定期間	1,073,853,806	3,693,296,716
第10特定期間	1,403,407,683	3,361,241,631
第11特定期間	4,749,615,910	4,102,760,659
第12特定期間	3,364,929,367	2,712,840,515
第13特定期間	3,961,242,159	2,548,140,140
第14特定期間	1,543,559,740	2,962,972,430
第15特定期間	533,787,266	1,998,522,935
第16特定期間	496,619,704	1,313,154,747
第17特定期間	417,357,138	1,469,760,816

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	339,985,662	72,475,747
第2特定期間	505,118,720	283,041,212

第3特定期間	370,122,320	359,825,260
第4特定期間	547,818,414	327,601,584
第5特定期間	60,230,643	196,546,667
第6特定期間	31,775,995	247,843,908
第7特定期間	63,101,021	80,927,000
第8特定期間	10,837,272	86,655,167
第9特定期間	24,772,320	34,203,571
第10特定期間	11,073,316	40,287,890
第11特定期間	16,008,813	47,019,113
第12特定期間	7,533,271	28,651,705

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,524,949,133	78,291,664
第2特定期間	3,180,432,952	1,772,180,398
第3特定期間	16,226,733,830	3,334,447,039
第4特定期間	5,765,180,129	13,873,857,792
第5特定期間	988,006,803	4,163,805,082
第6特定期間	668,789,749	2,314,269,720
第7特定期間	341,705,889	1,296,970,620
第8特定期間	160,888,283	751,119,339
第9特定期間	154,592,037	475,341,487
第10特定期間	37,763,761	219,873,250
第11特定期間	248,823,886	133,872,573
第12特定期間	43,442,040	197,716,898
第13特定期間	24,004,331	168,135,993
第14特定期間	6,124,746	90,579,513
第15特定期間	4,109,110	22,721,931
第16特定期間	12,591,642	79,375,162
第17特定期間	27,898,553	16,394,894

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

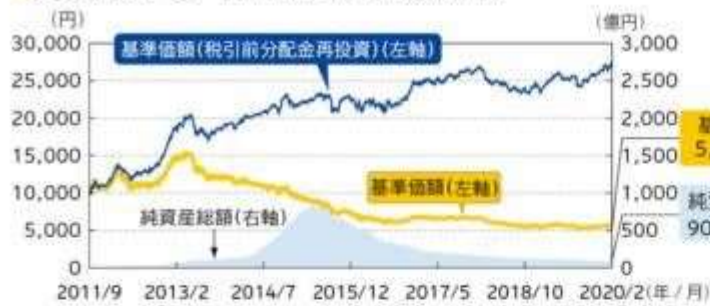
(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

参考情報

基準日:2020年2月28日

基準価額・純資産の推移

●アジア通貨コース 2011/09/30~2020/02/28



●高金利通貨コース 2011/09/30~2020/02/28



●ブラジルリアルコース 2011/09/30~2020/02/28



●米ドルコース 2014/05/23~2020/02/28



分配の推移

●アジア通貨コース

2019年10月	40円
2019年11月	40円
2019年12月	40円
2020年01月	40円
2020年02月	40円
直近1年間累計	480円
設定来累計	14,990円

●高金利通貨コース

2019年10月	50円
2019年11月	40円
2019年12月	40円
2020年01月	40円
2020年02月	40円
直近1年間累計	560円
設定来累計	15,440円

●ブラジルリアルコース

2019年10月	40円
2019年11月	30円
2019年12月	30円
2020年01月	30円
2020年02月	30円
直近1年間累計	440円
設定来累計	14,325円

●米ドルコース

2019年10月	40円
2019年11月	40円
2019年12月	40円
2020年01月	40円
2020年02月	40円
直近1年間累計	480円
設定来累計	3,310円

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

●日本円コース 2011/09/30～2020/02/28



- 基準価額(税引前分配金再投資)は、税引前の分配金を再投資したものとして計算しています。
- 基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

●日本円コース

2019年10月	30円
2019年11月	30円
2019年12月	30円
2020年01月	30円
2020年02月	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	6,940円

- 1万口当たり、税引前

● 主要な資産の状況

● アジア通貨コース

資産別構成	
資産の種類	純資産比
Nikko AsiaHighYieldBondFund 4	82.92%
Lion Asian HighYieldBond 4	14.44%
マネーブルマザーファンド	1.06%
コール・ローン等	1.58%
合計	100.00%

● 高金利通貨コース

資産別構成	
資産の種類	純資産比
Nikko AsiaHighYieldBondFund 3	66.89%
Lion Asian HighYieldBond 3	29.47%
マネーブルマザーファンド	1.19%
コール・ローン等	2.46%
合計	100.00%

● ブラジルリアルコース

資産別構成	
資産の種類	純資産比
Nikko AsiaHighYieldBondFund 2	59.34%
Lion Asian HighYieldBond 2	37.25%
マネーブルマザーファンド	1.11%
コール・ローン等	2.30%
合計	100.00%

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

●米ドルコース

資産別構成	
資産の種類	純資産比
Lion Asian HighYieldBond 5	61.16%
Nikko AsiaHighYieldBondFund 5	34.84%
マネーブルマザーファンド	1.02%
コール・ローン等	2.98%
合 計	100.00%

●日本円コース

資産別構成	
資産の種類	純資産比
Nikko AsiaHighYieldBondFund 1	63.14%
Lion Asian HighYieldBond 1	33.20%
マネーブルマザーファンド	1.08%
コール・ローン等	2.58%
合 計	100.00%

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

《主要投資対象の投資信託証券の運用状況》

● 日興 アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

日興アセットマネジメント アジア リミテッドが作成したデータを掲載しております。

資産別構成

資産の種類	純資産比
債券等	99.2%
現金等	0.8%
合 計	100.0%

組入上位10銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	国/地域	業種	格付	純資産比
1	POWERLONG REAL ESTAT 5.95% 19/07/20 USD	5.950%	2020/07/19	中国	不動産	B	3.6%
2	XINHU ZHONGBAO 6% 01/03/20 USD	6.000%	2020/03/01	中国	不動産	B	3.2%
3	JINKE PROPERTIES GRP 8.375% 20/06/21 USD	8.375%	2021/06/20	中国	不動産	B	3.1%
4	YANGO JUSTICE INTL 9.5% 03/04/21 USD	9.500%	2021/04/03	中国	不動産	B	2.8%
5	RONSHINE CHINA 11.25% 22/08/21 USD	11.250%	2021/08/22	中国	不動産	BB	2.8%
6	ZHONGLIANG HLDGS 11.5% 26/09/21 USD	11.500%	2021/09/26	中国	不動産	B	2.6%
7	HEJUN SHUNZE INVST 12% 25/04/21 USD	12.000%	2021/04/25	中国	不動産	B	2.5%
8	SMC GBL POWER HLDGS 6.5% VAR PERP USD	6.500%	永久債	フィリピン	電力	B	2.5%
9	OXLEY MTN PTE 6.375% 21/04/21 EMTN USD	6.375%	2021/04/21	シンガポール	不動産	BB	2.3%
10	ZHENRO PROPERTIES GRP 9.8% 20/08/21 USD	9.800%	2021/08/20	中国	不動産	B	2.2%
組 入 銘柄 数					60銘柄		

● 格付は、S & P及びムーディーズのうち、最上位の格付を採用しています。

● 格付のない発行体については、日興アセットマネジメント アジア リミテッドの社内格付を採用しています。

● 償還日が「永久債」の銘柄は償還日の定めのない銘柄です。

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

●ライオン アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

ライオングローバルインベスターズが作成したデータを掲載しております。

資産別構成

資産の種類	純資産比
債券等	99.7%
現金等	0.3%
合 計	100.0%

組入上位10銘柄

	銘柄名	クーポン	償還日	国/地域	業種	格付	純資産比
1	POWERLONG REAL ESTATE 5.95% DUE 19/07/2020	5.950%	2020/07/19	中国	不動産	B	5.6%
2	INDIA INFOLINE FIN LTD 5.87% DUE 20/04/2023	5.870%	2023/04/20	インド	各種金融サービス	BB	5.3%
3	CFLD CAYMAN INVESTMENT 6.5% DUE 21/12/2020	6.500%	2020/12/21	中国	不動産	B	5.2%
4	VEDANTA RESOURCES LTD 6.37% DUE 30/07/2022	6.370%	2022/07/30	インド	各種金属・鉱業	B	4.2%
5	PB INTERNATIONAL BV 7.62% DUE 26/01/2022	7.620%	2022/01/26	インドネシア	繊維・アパレル・ 贅沢品	B	3.6%
6	YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% DUE 04/02/2023	8.500%	2023/02/04	中国	不動産	B	2.9%
7	INDORAMA VENTURES GLO SV 4.37% DUE 12/09/2024	4.370%	2024/09/12	タイ	化学	BB	2.8%
8	NETWORK 12I LTD 5.65% DUE 31/12/2199	5.650%	永久債	インド	電気通信サービス	BB	2.8%
9	MEDCO PLATINUM ROAD PTE 6.75% DUE 30/01/2025	6.750%	2025/01/30	インドネシア	石油・ガス	B	2.8%
10	CIFI HOLDINGS GROUP 5.37% DUE 31/12/2199	5.370%	永久債	中国	不動産	B	2.7%
組入銘柄数					69銘柄		

● 格付は、S & P及びムーディーズのうち、最上位の格付を採用しています。

● 格付のない発行体については、ライオングローバルインベスターズの社内格付を採用しています。

● 償還日が「永久債」の銘柄は償還日の定めのない銘柄です。

●マネーブルマザーファンド

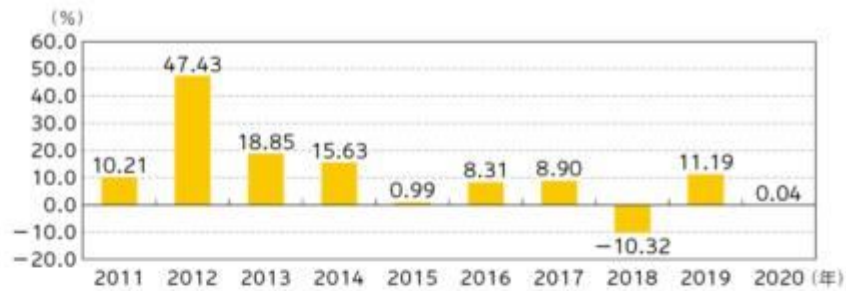
組入上位10銘柄

● 該当事項はありません。

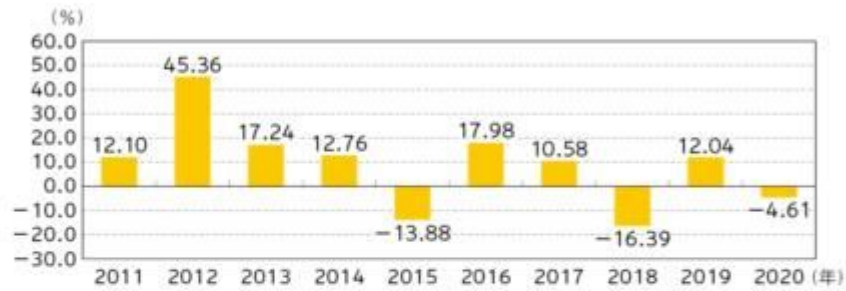
- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

年間収益率の推移（暦年ベース）

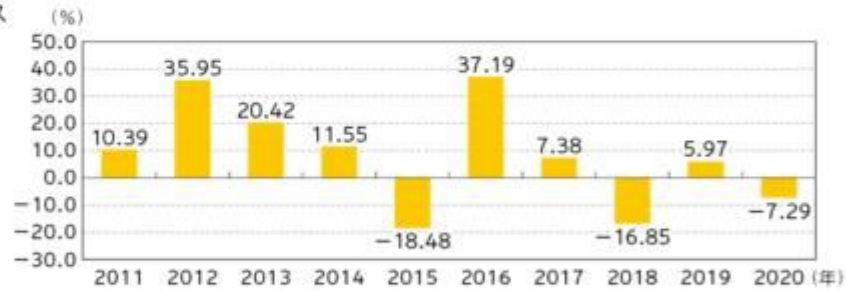
●アジア通貨コース



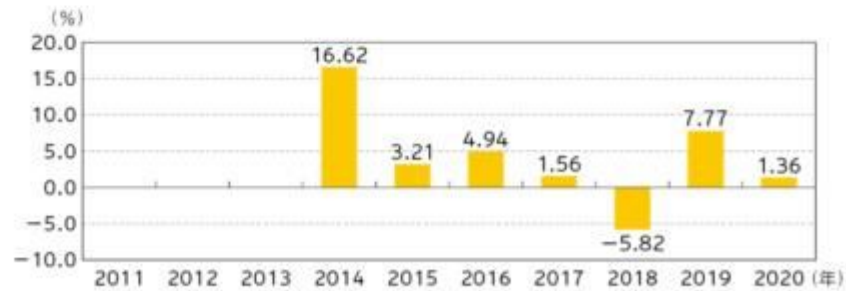
●高金利通貨コース



●ブラジルリアルコース

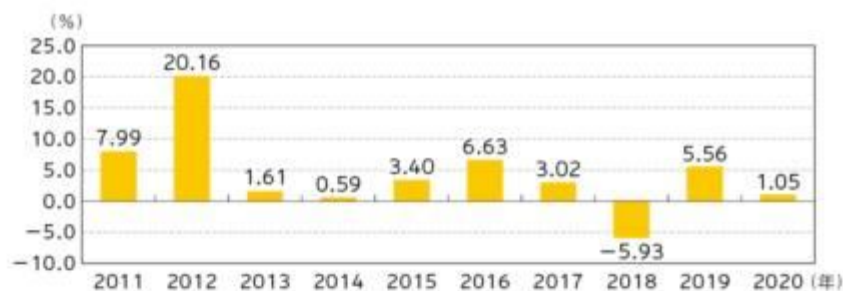


●米ドルコース



- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

●日本円コース



- ファンドの年間収益率は基準価額(税引前分配金再投資)を使用して計算しています。
- アジア通貨コース、高金利通貨コース、ブラジルリアルコース、日本円コース：
2011年は設定日(9月30日)から年末、2020年は年初から基準日までの収益率です。
- 米ドルコース：
2014年は設定日(5月23日)から年末、2020年は年初から基準日までの収益率です。
- 当ファンドはベンチマークを設定していません。

- 上記の運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。
- 最新の運用状況は別途、委託会社ホームページでご確認いただけます。
- 表中の各数値を四捨五入して表示している場合、合計が100%とならないことがあります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 訂正前 >

(略)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

(略)

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

(略)

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<訂正前>

(略)

委託会社の照会先

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sjnk-am.co.jp/>

<訂正後>

(略)

委託会社の照会先

SOMPOアセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-69-5432 (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

ホームページ <https://www.sompo-am.co.jp/>

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

公告

() 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.sjnk-am.co.jp/>

(略)

<訂正後>

(略)

公告

() 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.sompo-am.co.jp/>

(略)

第3【ファンドの経理状況】

- 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- 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、2019年8月14日から2020年2月10日までの財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース】

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	276,147,949	338,461,385
投資信託受益証券	9,494,426,772	8,921,828,887
親投資信託受益証券	116,241,958	96,199,581
流動資産合計	9,886,816,679	9,356,489,853
資産合計	9,886,816,679	9,356,489,853
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	73,808,471	66,555,234
未払解約金	5,617,091	29,609,850
未払受託者報酬	309,454	263,180
未払委託者報酬	9,180,475	7,807,721
未払利息	711	584
その他未払費用	20,619	73,333
流動負債合計	88,936,821	104,309,902
負債合計	88,936,821	104,309,902
純資産の部		
元本等		
元本	18,452,117,786	16,638,808,537
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,654,237,928	7,386,628,586
元本等合計	9,797,879,858	9,252,179,951
純資産合計	9,797,879,858	9,252,179,951
負債純資産合計	9,886,816,679	9,356,489,853

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
営業収益		
受取配当金	731,442,880	608,948,171
有価証券売買等損益	726,038,578	306,359,738
営業収益合計	5,404,302	915,307,909

	前 期		当 期	
	自	2019年2月13日 至 2019年8月13日	自	2019年8月14日 至 2020年2月10日
営業費用				
支払利息		126,946		94,635
受託者報酬		1,759,196		1,565,612
委託者報酬		52,189,307		46,446,565
その他費用		138,657		168,097
営業費用合計		54,214,106		48,274,909
営業利益又は営業損失（ ）		48,809,804		867,033,000
経常利益又は経常損失（ ）		48,809,804		867,033,000
当期純利益又は当期純損失（ ）		48,809,804		867,033,000
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		7,929,583		9,839,052
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,909,770,102		8,654,237,928
剰余金増加額又は欠損金減少額		900,737,967		960,522,190
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		900,737,967		960,522,190
剰余金減少額又は欠損金増加額		127,956,506		129,992,116
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		127,956,506		129,992,116
分配金		460,509,900		420,114,680
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,654,237,928		7,386,628,586

(3) 【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計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	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。 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月10日及び8月10日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を2019年8月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	前 期		当 期	
	2019年8月13日現在		2020年2月10日現在	
1. 受益権の総数		18,452,117,786口		16,638,808,537口
2. 元本の欠損		8,654,237,928円		7,386,628,586円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5310円 (5,310円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5561円 (5,561円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前 期		当 期	
	自 2019年2月13日	至 2019年8月13日	自 2019年8月14日	至 2020年2月10日
1. 分配金の計算過程	<p>（自2019年2月13日 至2019年3月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（119,896,723円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（10,492,617,746円）及び分配準備積立金（2,088,159,123円）より分配対象収益は12,700,673,592円（1万口当たり6,374.60円）であり、うち79,695,159円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年3月12日 至2019年4月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（120,362,444円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（10,337,318,235円）及び分配準備積立金（2,087,525,483円）より分配対象収益は12,545,206,162円（1万口当たり6,396.28円）であり、うち78,452,898円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年4月11日 至2019年5月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（112,337,526円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（10,176,149,855円）及び分配準備積立金（2,091,161,588円）より分配対象収益は12,379,648,969円（1万口当たり6,414.80円）であり、うち77,194,068円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年5月11日 至2019年6月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（112,360,449円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（10,067,731,135円）及び分配準備積立金（2,099,089,401円）より分配対象収益は12,279,180,985円（1万口当たり6,433.91円）であり、うち76,340,165円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>		<p>（自2019年8月14日 至2019年9月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（113,496,378円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（9,700,304,155円）及び分配準備積立金（2,116,481,033円）より分配対象収益は11,930,281,566円（1万口当たり6,496.45円）であり、うち73,457,012円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年9月11日 至2019年10月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（108,250,456円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（9,553,322,177円）及び分配準備積立金（2,119,780,223円）より分配対象収益は11,781,352,856円（1万口当たり6,516.59円）であり、うち72,315,805円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年10月11日 至2019年11月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（111,230,004円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（9,355,557,447円）及び分配準備積立金（2,105,733,076円）より分配対象収益は11,572,520,527円（1万口当たり6,539.80円）であり、うち70,781,905円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年11月12日 至2019年12月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（79,675,843円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（9,172,533,530円）及び分配準備積立金（2,087,677,563円）より分配対象収益は11,339,886,936円（1万口当たり6,546.50円）であり、うち69,288,097円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	

項目	前 期		当 期	
	自 2019年2月13日	至 2019年8月13日	自 2019年8月14日	至 2020年2月10日
	（自2019年6月11日 至2019年7月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （113,558,546円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （9,898,239,705円）及び分配準備積立金 （2,094,067,247円）より分配対象収益は 12,105,865,498円（1万口当たり6,454.79円） であり、うち75,019,139円（1万口当たり40 円）を分配金額としております。		（自2019年12月11日 至2020年1月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （83,739,685円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （8,968,503,719円）及び分配準備積立金 （2,047,155,154円）より分配対象収益は 11,099,398,558円（1万口当たり6,556.36円） であり、うち67,716,627円（1万口当たり40 円）を分配金額としております。	
	（自2019年7月11日 至2019年8月13日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （109,664,256円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （9,742,940,674円）及び分配準備積立金 （2,094,331,657円）より分配対象収益は 11,946,936,587円（1万口当たり6,474.55円） であり、うち73,808,471円（1万口当たり40 円）を分配金額としております。		（自2020年1月11日 至2020年2月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （76,565,154円）（本ファンドに帰属すべき 親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （8,818,218,361円）及び分配準備積立金 （2,024,778,167円）より分配対象収益は 10,919,561,682円（1万口当たり6,562.68円） であり、うち66,555,234円（1万口当たり40 円）を分配金額としております。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	前 期		当 期	
	自 2019年2月13日	至 2019年8月13日	自 2019年8月14日	至 2020年2月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。		同左	
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。 （2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。		同左	

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期	当 期
	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左

項目	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
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、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
期首元本額	20,211,176,322円	18,452,117,786円
期中追加設定元本額	295,230,488円	285,788,134円
期中一部解約元本額	2,054,289,024円	2,099,097,383円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	588,110,956	54,115,814
親投資信託受益証券	11,592	9,597
合計	588,122,548	54,125,411

(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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2020年2月10日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 4	23,502,235	7,593,877,709	
	Lion Asian High Yield Bond 4	3,579,007	1,327,951,178	
投資信託受益証券 合計		27,081,242	8,921,828,887	
親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	95,969,255	96,199,581	
親投資信託受益証券 合計		95,969,255	96,199,581	
合計			9,018,028,468	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2019年8月13日現在	当期 2020年2月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	205,988,869	156,910,528
投資信託受益証券	3,473,102,248	3,188,898,610
親投資信託受益証券	38,680,964	38,665,535
流動資産合計	3,717,772,081	3,384,474,673
資産合計	3,717,772,081	3,384,474,673
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	57,684,792	43,823,642
未払解約金	4,777,292	6,270,095
未払受託者報酬	115,806	96,833

	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
未払委託者報酬	3,435,592	2,872,607
未払利息	530	270
その他未払費用	7,706	55,506
流動負債合計	66,021,718	53,118,953
負債合計	66,021,718	53,118,953
純資産の部		
元本等		
元本	11,536,958,515	10,955,910,722
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,885,208,152	7,624,555,002
元本等合計	3,651,750,363	3,331,355,720
純資産合計	3,651,750,363	3,331,355,720
負債純資産合計	3,717,772,081	3,384,474,673

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
営業収益		
受取配当金	516,588,839	432,890,637
有価証券売買等損益	559,947,919	259,219,067
営業収益合計	43,359,080	173,671,570
営業費用		
支払利息	57,093	44,171
受託者報酬	646,462	576,312
委託者報酬	19,178,363	17,097,108
その他費用	53,213	90,574
営業費用合計	19,935,131	17,808,165
営業利益又は営業損失()	63,294,211	155,863,405
経常利益又は経常損失()	63,294,211	155,863,405
当期純利益又は当期純損失()	63,294,211	155,863,405
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,957,443	3,409,132
期首剰余金又は期首欠損金()	7,746,363,670	7,885,208,152
剰余金増加額又は欠損金減少額	567,244,478	693,395,900
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	567,244,478	693,395,900
剰余金減少額又は欠損金増加額	286,443,228	292,290,979
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	286,443,228	292,290,979
分配金	354,394,078	292,906,044
期末剰余金又は期末欠損金()	7,885,208,152	7,624,555,002

(3) 【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計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p> <p>特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月10日及び8月10日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を2019年8月13日としております。</p>
----------------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

期別	前期 2019年8月13日現在	当期 2020年2月10日現在
1. 受益権の総数	11,536,958,515口	10,955,910,722口
2. 元本の欠損	7,885,208,152円	7,624,555,002円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.3165円 (1万口当たり純資産額) (3,165円)	1口当たり純資産額 0.3041円 (1万口当たり純資産額) (3,041円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2019年2月13日 至2019年3月11日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(82,459,757円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,502,280,034円)及び分配準備積立金(973,935,355円)より分配対象収益は7,558,675,146円(1万口当たり6,328.42円)であり、うち59,719,895円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年3月12日 至2019年4月10日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(82,433,981円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,488,906,553円)及び分配準備積立金(987,825,149円)より分配対象収益は7,559,165,683円(1万口当たり6,347.75円)であり、うち59,541,902円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2019年8月14日 至2019年9月10日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(83,355,111円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,330,396,737円)及び分配準備積立金(1,051,879,703円)より分配対象収益は7,465,631,551円(1万口当たり6,453.54円)であり、うち57,841,111円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年9月11日 至2019年10月10日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(82,495,333円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,243,208,943円)及び分配準備積立金(1,052,633,257円)より分配対象収益は7,378,337,533円(1万口当たり6,476.18円)であり、うち56,965,034円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>

項目	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
	<p>（自2019年4月11日 至2019年5月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（82,443,910円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,484,330,482円）及び分配準備積立金（1,005,230,761円）より分配対象収益は7,572,005,153円（1万口当たり6,367.14円）であり、うち59,461,380円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年5月11日 至2019年6月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（83,638,842円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,486,468,941円）及び分配準備積立金（1,022,913,905円）より分配対象収益は7,593,021,688円（1万口当たり6,387.56円）であり、うち59,435,846円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年6月11日 至2019年7月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（85,284,573円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,396,075,426円）及び分配準備積立金（1,025,487,461円）より分配対象収益は7,506,847,460円（1万口当たり6,410.58円）であり、うち58,550,263円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年7月11日 至2019年8月13日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（81,490,899円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,308,161,537円）及び分配準備積立金（1,030,330,885円）より分配対象収益は7,419,983,321円（1万口当たり6,431.47円）であり、うち57,684,792円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年10月11日 至2019年11月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（64,010,409円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,210,889,661円）及び分配準備積立金（1,065,308,780円）より分配対象収益は7,340,208,850円（1万口当たり6,482.82円）であり、うち45,290,028円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年11月12日 至2019年12月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（62,619,290円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,146,953,013円）及び分配準備積立金（1,066,566,439円）より分配対象収益は7,276,138,742円（1万口当たり6,498.91円）であり、うち44,783,662円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年12月11日 至2020年1月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（64,160,162円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,073,662,592円）及び分配準備積立金（1,064,074,940円）より分配対象収益は7,201,897,694円（1万口当たり6,517.16円）であり、うち44,202,567円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年1月11日 至2020年2月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（61,469,630円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（6,029,501,770円）及び分配準備積立金（1,067,001,593円）より分配対象収益は7,157,972,993円（1万口当たり6,533.42円）であり、うち43,823,642円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左

項目	前期	当期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
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

金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前期	当期
2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	前期	当期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
期首元本額	11,955,506,251円	11,536,958,515円
期中追加設定元本額	433,479,006円	425,344,107円
期中一部解約元本額	852,026,742円	1,006,391,900円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	230,173,110	189,424,780
親投資信託受益証券	3,857	3,857
合計	230,176,967	189,428,637

（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。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2020年2月10日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 3	14,737,849	2,210,397,389	
	Lion Asian High Yield Bond 3	5,087,722	978,501,221	
投資信託受益証券 合計		19,825,571	3,188,898,610	
親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	38,572,960	38,665,535	
親投資信託受益証券 合計		38,572,960	38,665,535	
合計			3,227,564,145	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	234,197,739	181,067,772
投資信託受益証券	4,670,806,367	4,075,948,323
親投資信託受益証券	60,395,856	45,374,756
流動資産合計	4,965,399,962	4,302,390,851
資産合計	4,965,399,962	4,302,390,851
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	62,836,051	43,969,827
未払解約金	14,467,331	10,944,963
未払受託者報酬	158,098	123,430
未払委託者報酬	4,690,216	3,661,759
未払利息	603	312
その他未払費用	10,530	70,759
流動負債合計	82,162,829	58,771,050
負債合計	82,162,829	58,771,050
純資産の部		
元本等		
元本	15,709,012,935	14,656,609,257
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,825,775,802	10,412,989,456
元本等合計	4,883,237,133	4,243,619,801
純資産合計	4,883,237,133	4,243,619,801
負債純資産合計	4,965,399,962	4,302,390,851

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
営業収益		
受取配当金	535,948,167	419,590,894
有価証券売買等損益	712,830,089	413,879,144
営業収益合計	176,881,922	5,711,750
営業費用		
支払利息	76,545	56,160
受託者報酬	884,416	753,583
委託者報酬	26,237,588	22,356,084
その他費用	71,721	116,692
営業費用合計	27,270,270	23,282,519
営業利益又は営業損失()	204,152,192	17,570,769
経常利益又は経常損失()	204,152,192	17,570,769
当期純利益又は当期純損失()	204,152,192	17,570,769
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,349,200	601,569
期首剰余金又は期首欠損金()	10,775,060,299	10,825,775,802
剰余金増加額又は欠損金減少額	871,710,811	1,029,314,038

	前 期		当 期	
	自	2019年2月13日	自	2019年8月14日
	至	2019年8月13日	至	2020年2月10日
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		871,710,811		1,029,314,038
剰余金減少額又は欠損金増加額		329,226,755		291,681,891
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		329,226,755		291,681,891
分配金		387,698,167		306,673,463
期末剰余金又は期末欠損金()		10,825,775,802		10,412,989,456

(3)【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計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	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。 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月10日及び8月10日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を2019年8月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	前 期		当 期	
	2019年8月13日現在		2020年2月10日現在	
1. 受益権の総数		15,709,012,935口		14,656,609,257口
2. 元本の欠損		10,825,775,802円		10,412,989,456円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.3109円	1口当たり純資産額	0.2895円
	(1万口当たり純資産額)	(3,109円)	(1万口当たり純資産額)	(2,895円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1. 分配金の計算過程	<p>（自2019年2月13日 至2019年3月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（85,903,616円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（8,123,798,412円）及び分配準備積立金（1,326,246,495円）より分配対象収益は9,535,948,523円（1万口当たり5,801.59円）であり、うち65,746,942円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年3月12日 至2019年4月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（84,895,558円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（8,052,603,358円）及び分配準備積立金（1,328,102,422円）より分配対象収益は9,465,601,338円（1万口当たり5,813.86円）であり、うち65,124,089円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年4月11日 至2019年5月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（84,883,760円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（8,055,500,662円）及び分配準備積立金（1,337,282,996円）より分配対象収益は9,477,667,418円（1万口当たり5,826.14円）であり、うち65,069,736円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年5月11日 至2019年6月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（84,975,387円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（8,035,864,233円）及び分配準備積立金（1,343,360,255円）より分配対象収益は9,464,199,875円（1万口当たり5,838.66円）であり、うち64,837,908円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年8月14日 至2019年9月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（84,147,771円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,819,510,970円）及び分配準備積立金（1,349,427,947円）より分配対象収益は9,253,086,688円（1万口当たり5,879.37円）であり、うち62,952,577円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年9月11日 至2019年10月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（84,844,476円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,798,484,018円）及び分配準備積立金（1,353,301,803円）より分配対象収益は9,236,630,297円（1万口当たり5,893.64円）であり、うち62,688,641円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年10月11日 至2019年11月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（59,178,243円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,764,698,062円）及び分配準備積立金（1,362,755,304円）より分配対象収益は9,186,631,609円（1万口当たり5,891.67円）であり、うち46,777,619円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年11月12日 至2019年12月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（57,434,301円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,599,345,120円）及び分配準備積立金（1,341,148,948円）より分配対象収益は8,997,928,369円（1万口当たり5,899.54円）であり、うち45,755,514円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>

項目	前 期		当 期	
	自 2019年2月13日	至 2019年8月13日	自 2019年8月14日	至 2020年2月10日
	（自2019年6月11日 至2019年7月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（86,623,993円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,947,673,310円）及び分配準備積立金（1,342,577,051円）より分配対象収益は9,376,874,354円（1万口当たり5,852.89円）であり、うち64,083,441円（1万口当たり40円）を分配金額としております。		（自2019年12月11日 至2020年1月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（58,930,597円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,399,598,690円）及び分配準備積立金（1,313,040,194円）より分配対象収益は8,771,569,481円（1万口当たり5,909.51円）であり、うち44,529,285円（1万口当たり30円）を分配金額としております。	
	（自2019年7月11日 至2019年8月13日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（82,821,834円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,798,644,063円）及び分配準備積立金（1,333,293,735円）より分配対象収益は9,214,759,632円（1万口当たり5,865.89円）であり、うち62,836,051円（1万口当たり40円）を分配金額としております。		（自2020年1月11日 至2020年2月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（55,470,288円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（7,310,563,783円）及び分配準備積立金（1,307,038,813円）より分配対象収益は8,673,072,884円（1万口当たり5,917.49円）であり、うち43,969,827円（1万口当たり30円）を分配金額としております。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	前 期		当 期	
	自 2019年2月13日	至 2019年8月13日	自 2019年8月14日	至 2020年2月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。		同左	
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。 （2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。		同左	

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左
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

金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期	当 期
	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

項目	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
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、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
期首元本額	16,525,547,978円	15,709,012,935円
期中追加設定元本額	496,619,704円	417,357,138円
期中一部解約元本額	1,313,154,747円	1,469,760,816円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	408,268,913	265,991,714
親投資信託受益証券	6,022	4,527
合計	408,274,935	265,996,241

(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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2020年2月10日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 2	16,226,189	2,501,185,903	
	Lion Asian High Yield Bond 2	8,965,853	1,574,762,420	
投資信託受益証券 合計		25,192,042	4,075,948,323	
親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	45,266,118	45,374,756	
親投資信託受益証券 合計		45,266,118	45,374,756	
合計			4,121,323,079	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2019年8月13日現在	当期 2020年2月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,501,296	5,678,222
投資信託受益証券	176,900,623	167,516,332
親投資信託受益証券	2,864,954	1,863,910
流動資産合計	187,266,873	175,058,464
資産合計	187,266,873	175,058,464
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	817,669	733,195
未払受託者報酬	5,933	5,035
未払委託者報酬	176,069	149,336

	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
未払利息	19	9
その他未払費用	388	2,875
流動負債合計	1,000,078	890,450
負債合計	1,000,078	890,450
純資産の部		
元本等		
元本	204,417,377	183,298,943
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	18,150,582	9,130,929
元本等合計	186,266,795	174,168,014
純資産合計	186,266,795	174,168,014
負債純資産合計	187,266,873	175,058,464

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
営業収益		
受取配当金	7,103,964	6,302,957
有価証券売買等損益	6,289,092	7,614,665
営業収益合計	814,872	13,917,622
営業費用		
支払利息	2,830	2,776
受託者報酬	33,892	31,117
委託者報酬	1,005,372	923,002
その他費用	2,613	4,731
営業費用合計	1,044,707	961,626
営業利益又は営業損失()	229,835	12,955,996
経常利益又は経常損失()	229,835	12,955,996
当期純利益又は当期純損失()	229,835	12,955,996
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	46,182	196,501
期首剰余金又は期首欠損金()	14,515,488	18,150,582
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,787,443	1,789,229
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,787,443	1,789,229
剰余金減少額又は欠損金増加額	962,117	646,613
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	962,117	646,613
分配金	5,276,767	4,882,458
期末剰余金又は期末欠損金()	18,150,582	9,130,929

(3) 【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計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p> <p>特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月10日及び8月10日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を2019年8月13日としております。</p>
----------------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

期別	前期 2019年8月13日現在	当期 2020年2月10日現在
1. 受益権の総数	204,417,377口	183,298,943口
2. 元本の欠損	18,150,582円	9,130,929円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9112円 (9,112円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9502円 (9,502円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1. 分配金の計算過程	<p>(自2019年2月13日 至2019年3月11日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(1,263,091円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(38,585,171円)及び分配準備積立金(10,428,962円)より分配対象収益は50,277,224円(1万口当たり2,224.51円)であり、うち904,050円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年3月12日 至2019年4月10日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(1,208,464円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(38,329,275円)及び分配準備積立金(10,706,005円)より分配対象収益は50,243,744円(1万口当たり2,238.54円)であり、うち897,785円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自2019年8月14日 至2019年9月10日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(996,426円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(36,999,960円)及び分配準備積立金(9,823,044円)より分配対象収益は47,819,430円(1万口当たり2,269.47円)であり、うち842,821円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p> <p>(自2019年9月11日 至2019年10月10日)</p> <p>計算期間末における経費控除後の配当等収益(969,923円)(本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(37,059,041円)及び分配準備積立金(9,976,649円)より分配対象収益は48,005,613円(1万口当たり2,275.45円)であり、うち843,881円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>

項目	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
	<p>（自2019年4月11日 至2019年5月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（960,455円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（37,966,480円）及び分配準備積立金（10,905,010円）より分配対象収益は49,831,945円（1万口当たり2,242.02円）であり、うち889,046円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年5月11日 至2019年6月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（938,568円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（38,137,325円）及び分配準備積立金（10,490,109円）より分配対象収益は49,566,002円（1万口当たり2,245.91円）であり、うち882,768円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年6月11日 至2019年7月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,145,122円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（38,542,339円）及び分配準備積立金（10,304,187円）より分配対象収益は49,991,648円（1万口当たり2,258.35円）であり、うち885,449円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年7月11日 至2019年8月13日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（847,865円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（35,602,594円）及び分配準備積立金（9,792,848円）より分配対象収益は46,243,307円（1万口当たり2,262.18円）であり、うち817,669円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年10月11日 至2019年11月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,164,250円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（37,108,972円）及び分配準備積立金（10,100,686円）より分配対象収益は48,373,908円（1万口当たり2,290.57円）であり、うち844,737円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年11月12日 至2019年12月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（898,372円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（36,998,519円）及び分配準備積立金（10,377,804円）より分配対象収益は48,274,695円（1万口当たり2,293.37円）であり、うち841,980円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年12月11日 至2020年1月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（945,673円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（34,104,550円）及び分配準備積立金（9,640,426円）より分配対象収益は44,690,649円（1万口当たり2,304.08円）であり、うち775,844円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年1月11日 至2020年2月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（773,881円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（32,241,393円）及び分配準備積立金（9,289,158円）より分配対象収益は42,304,432円（1万口当たり2,307.93円）であり、うち733,195円（1万口当たり40円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
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

金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期	当 期
	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、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、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期	当 期
2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
期首元本額	235,427,677円	204,417,377円
期中追加設定元本額	16,008,813円	7,533,271円
期中一部解約元本額	47,019,113円	28,651,705円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	7,072,117	128,681
親投資信託受益証券	286	187
合計	7,072,403	128,868

（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。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2020年2月10日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 5	71,608	55,546,973	
	Lion Asian High Yield Bond 5	129,031	111,969,359	
投資信託受益証券 合計		200,639	167,516,332	
親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	1,859,448	1,863,910	
親投資信託受益証券 合計		1,859,448	1,863,910	
合計			169,380,242	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,736,620	13,484,647
投資信託受益証券	288,426,599	290,530,085
親投資信託受益証券	3,253,360	3,252,063
流動資産合計	298,416,579	307,266,795
資産合計	298,416,579	307,266,795
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,246,739	1,281,250
未払解約金	619,180	109,299
未払受託者報酬	9,034	8,573
未払委託者報酬	267,984	254,357
未払利息	17	23
その他未払費用	589	4,903
流動負債合計	2,143,543	1,658,405
負債合計	2,143,543	1,658,405
純資産の部		
元本等		
元本	415,579,860	427,083,519
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	119,306,824	121,475,129
元本等合計	296,273,036	305,608,390
純資産合計	296,273,036	305,608,390
負債純資産合計	298,416,579	307,266,795

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
営業収益		
受取配当金	13,049,481	12,060,483
有価証券売買等損益	6,648,005	1,897,811
営業収益合計	6,401,476	10,162,672
営業費用		
支払利息	3,811	3,325
受託者報酬	51,708	48,739
委託者報酬	1,533,896	1,446,076
その他費用	4,097	7,772
営業費用合計	1,593,512	1,505,912
営業利益又は営業損失()	4,807,964	8,656,760
経常利益又は経常損失()	4,807,964	8,656,760
当期純利益又は当期純損失()	4,807,964	8,656,760
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	227,876	48,449
期首剰余金又は期首欠損金()	134,625,754	119,306,824
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,965,280	4,776,402

	前 期		当 期	
	自	2019年2月13日	自	2019年8月14日
	至	2019年8月13日	至	2020年2月10日
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		21,965,280		4,776,402
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,414,738		7,977,155
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,414,738		7,977,155
分配金		7,811,700		7,575,863
期末剰余金又は期末欠損金()		119,306,824		121,475,129

(3) 【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計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	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。 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月10日及び8月10日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を2019年8月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	前 期		当 期	
	2019年8月13日現在		2020年2月10日現在	
1. 受益権の総数		415,579,860口		427,083,519口
2. 元本の欠損		119,306,824円		121,475,129円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.7129円	1口当たり純資産額	0.7156円
	(1万口当たり純資産額)	(7,129円)	(1万口当たり純資産額)	(7,156円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	当 期 自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1. 分配金の計算過程	<p>（自2019年2月13日 至2019年3月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （2,129,290円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （100,157,179円）及び分配準備積立金 （46,762,395円）より分配対象収益は 149,048,864円（1万口当たり3,200.11円）で あり、うち1,397,275円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p> <p>（自2019年3月12日 至2019年4月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （2,012,074円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （96,302,480円）及び分配準備積立金 （44,769,371円）より分配対象収益は 143,083,925円（1万口当たり3,216.59円）で あり、うち1,334,486円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p> <p>（自2019年4月11日 至2019年5月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （1,904,016円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （95,167,470円）及び分配準備積立金 （44,832,104円）より分配対象収益は 141,903,590円（1万口当たり3,230.22円）で あり、うち1,317,890円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p> <p>（自2019年5月11日 至2019年6月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （1,812,598円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （91,176,940円）及び分配準備積立金 （43,465,985円）より分配対象収益は 136,455,523円（1万口当たり3,244.29円）で あり、うち1,261,798円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年8月14日 至2019年9月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （1,856,910円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （90,669,732円）及び分配準備積立金 （44,201,393円）より分配対象収益は 136,728,035円（1万口当たり3,286.66円）で あり、うち1,248,020円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p> <p>（自2019年9月11日 至2019年10月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （1,837,781円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （91,859,014円）及び分配準備積立金 （43,937,796円）より分配対象収益は 137,634,591円（1万口当たり3,301.15円）で あり、うち1,250,779円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p> <p>（自2019年10月11日 至2019年11月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （1,834,947円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （90,984,375円）及び分配準備積立金 （44,020,347円）より分配対象収益は 136,839,669円（1万口当たり3,315.85円）で あり、うち1,238,043円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p> <p>（自2019年11月12日 至2019年12月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益 （1,697,724円）（本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む）、費用控除 後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損 益（0円）、信託約款に規定される収益調整金 （95,619,724円）及び分配準備積立金 （44,327,424円）より分配対象収益は 141,644,872円（1万口当たり3,325.85円）で あり、うち1,277,665円（1万口当たり30円） を分配金額としております。</p>

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
	<p>（自2019年6月11日 至2019年7月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,830,768円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（90,952,583円）及び分配準備積立金（43,367,448円）より分配対象収益は136,150,799円（1万口当たり3,258.44円）であり、うち1,253,512円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年7月11日 至2019年8月13日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,804,693円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（90,518,447円）及び分配準備積立金（43,656,083円）より分配対象収益は135,979,223円（1万口当たり3,272.02円）であり、うち1,246,739円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年12月11日 至2020年1月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,818,940円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（95,887,882円）及び分配準備積立金（44,747,483円）より分配対象収益は142,454,305円（1万口当たり3,338.47円）であり、うち1,280,106円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年1月11日 至2020年2月10日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,667,617円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（96,045,019円）及び分配準備積立金（45,255,960円）より分配対象収益は142,968,596円（1万口当たり3,347.53円）であり、うち1,281,250円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（有価証券に関する注記）に記載しております。</p> <p>（2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左
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

金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期	当 期
	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左

項目	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
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、帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

項目	前 期	当 期
	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
期首元本額	482,363,380円	415,579,860円
期中追加設定元本額	12,591,642円	27,898,553円
期中一部解約元本額	79,375,162円	16,394,894円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前 期 2019年8月13日現在	当 期 2020年2月10日現在
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
投資信託受益証券	5,370,850	1,257,374
親投資信託受益証券	325	324
合計	5,371,175	1,257,698

（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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2020年2月10日現在

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	Nikko Asia High Yield Bond Fund 1	476,883	190,118,835	
	Lion Asian High Yield Bond 1	168,795	100,411,250	
投資信託受益証券 合計		645,678	290,530,085	
親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	3,244,277	3,252,063	
親投資信託受益証券 合計		3,244,277	3,252,063	
合計			293,782,148	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース/高金利通貨コース/ブラジルリアルコース/米ドルコース/日本円コースの主要投資対象の状況は以下のとおりです。

*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	96,332	774,718
コール・ローン	248,321,194	211,477,735
流動資産合計	248,417,526	212,252,453

科 目	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産合計	248,417,526	212,252,453
負債の部		
流動負債		
未払利息	639	365
流動負債合計	639	365
負債合計	639	365
純資産の部		
元本等		
元本	247,715,866	211,739,270
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	701,021	512,818
元本等合計	248,416,887	212,252,088
純資産合計	248,416,887	212,252,088
負債純資産合計	248,417,526	212,252,453

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

期別	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
1. 受益権の総数	247,715,866口	211,739,270口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0028円 (10,028円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0024円 (10,024円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 （2）金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左

項目	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	同左

項目	2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 該当事項はありません。 (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、帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

2019年8月13日現在	2020年2月10日現在
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	自 2019年2月13日 至 2019年8月13日	自 2019年8月14日 至 2020年2月10日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	254,564,300円	247,715,866円
同期中追加設定元本額	1,116,522円	748,076円
同期中一部解約元本額	7,964,956円	36,724,672円
元本の内訳*		
りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース	115,917,390円	95,969,255円
りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース	38,572,960円	38,572,960円
りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース	60,227,220円	45,266,118円
りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース	3,244,277円	3,244,277円
アジア・ハイ・イールド債券ファンド(毎月分配型)為替ヘッジなしコース	5,050,983円	5,050,983円
アジア・ハイ・イールド債券ファンド(毎月分配型)円ヘッジコース	10,772,334円	10,772,334円
日米4資産スマートバランス	6,346,443円	6,027,234円
りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース	2,856,955円	1,859,448円
日米4資産スマートバランス(DC年金)	4,727,304円	4,976,661円
計	247,715,866円	211,739,270円

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（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。

附属明細表

第1 有価証券明細表
（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

NikkoAM Asia Investment Series - NikkoAM Asia High Yield Bond Fund

（1）貸借対照表

2018年12月31日現在
アメリカドル

資産

流動資産

純損益を通じて公正価値で測定される金融資産

153,098,006

現金及び現金同等物

14,680,015

受入担保金

230,000

資産合計

168,008,021

負債

流動負債

純損益を通じて公正価値で測定される金融負債

676,546

未払費用及びその他未払金	391,555
負債合計(償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産を除く)	1,068,101
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産(仲値)	166,939,920
償還可能受益証券クラス当たりの純資産額(仲値)	
クラス1 (3,198,376口)	11,967,343
クラス2 (18,730,396口)	31,911,277
クラス3 (17,137,592口)	28,689,691
クラス4 (29,440,254口)	89,510,936
クラス5 (705,908口)	4,860,673
	166,939,920

Lion Global Investors Asian High Yield Bond Fund

(1) 貸借対照表

2018年12月31日現在
アメリカドル

資産	
流動資産	
純損益を通じて公正価値で測定される金融資産	36,338,757
差入証拠金	2,620,000
現金及び現金同等物	2,439,139
資産合計	41,397,896
負債	
流動負債	
純損益を通じて公正価値で測定される金融負債	357,776
その他未払金	72,815
負債合計(償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産を除く)	430,591
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	40,967,305

(1口当たりの純資産額)

	クラス1 口数	クラス2 口数	クラス3 口数	クラス4 口数	クラス5 口数	クラス6 口数
2018年12月31日現在						
期首発行済み口数	145,537	6,773,702	2,886,935	3,579,007	133,243	-
期中追加発行口数	-	1,948,090	1,438,786	-	24,776	-
期中解約口数	-	-	-	-	-	-
期末発行済み口数	145,537	8,721,792	4,325,721	3,579,007	158,019	-
	クラス1	クラス2	クラス3	クラス4	クラス5	クラス6

	アメリカドル	アメリカドル	アメリカドル	アメリカドル	アメリカドル	アメリカドル
受益証券の保有者に帰属する純資産	794,163	17,487,064	9,216,284	12,252,087	1,217,707	-
1口当たりの純資産額	5.457	2.005	2.131	3.423	7.706	-

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コース

2020年2月28日現在

資産総額	9,156,344,516円
負債総額	61,873,805円
純資産総額(-)	9,094,470,711円
発行済数量	16,485,954,600口
1単位当たりの純資産額(/)	0.5516円

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コース

2020年2月28日現在

資産総額	3,252,241,228円
負債総額	6,922,576円
純資産総額(-)	3,245,318,652円
発行済数量	10,882,088,874口
1単位当たりの純資産額(/)	0.2982円

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコース

2020年2月28日現在

資産総額	4,110,129,019円
負債総額	19,774,119円
純資産総額(-)	4,090,354,900円
発行済数量	14,566,692,418口
1単位当たりの純資産額(/)	0.2808円

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコース

2020年2月28日現在

資産総額	183,609,626円
------	--------------

負債総額	93,195円
純資産総額（ - ）	183,516,431円
発行済数量	192,548,597口
1単位当りの純資産額（ / ）	0.9531円

りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コース

2020年2月28日現在

資産総額	302,400,169円
負債総額	154,648円
純資産総額（ - ）	302,245,521円
発行済数量	421,679,696口
1単位当りの純資産額（ / ）	0.7168円

（参考）マネープールマザーファンド

2020年2月28日現在

資産総額	212,334,101円
負債総額	457円
純資産総額（ - ）	212,333,644円
発行済数量	211,829,057口
1単位当りの純資産額（ / ）	1.0024円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1) 資本金の額（2019年8月末現在）

(略)

(2) 会社の機構（2019年8月末現在）

会社の意思決定機構

定款に基づき15名以内の取締役が株主総会において選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上にあたる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行います。

(略)

<訂正後>

(1) 資本金の額（2020年2月末現在）

(略)

(2) 会社の機構（2020年2月末現在）

会社の意思決定機構

定款に基づき10名以内の取締役が株主総会において選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上にあたる株式を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行います。

(略)

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「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、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびに証券投資信託の募集又は私募（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」に定める投資一任契約に基づく運用（投資運用業）および投資助言業務を行っています。

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2020年2月末現在、計201本（追加型株式投資信託129本、単位型株式投資信託22本、単位型公社債投資信託50本）であり、その純資産総額の合計は887,294百万円です。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 委託会社である損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）、ならびに、同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託会社の中間財務諸表は「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)、ならびに、同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)により作成しております。

2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

また、委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30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。

(1) 【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(資産の部)					
流動資産					
1		現金・預金	4,606,103	5,031,436	
2		前払費用	69,417	77,905	
3		未収委託者報酬	919,027	892,311	
4		未収運用受託報酬	1,371,086	1,133,534	
5		未収収益	57	52	
6		その他	3,144	5,489	
		流動資産合計	6,968,836	7,140,730	
固定資産					
1 有形固定資産					
	1	(1) 建物	27,525	23,660	
	1	(2) 器具備品	19,460	24,492	
		有形固定資産合計	46,986	48,153	
2 無形固定資産					
		(1) 電話加入権	4,535	4,535	
		無形固定資産合計	4,535	4,535	
3 投資その他の資産					
		(1) 投資有価証券	66,370	189,407	
		(2) 長期差入保証金	161,598	161,598	
		(3) 繰延税金資産	273,815	369,181	
		(4) その他	31	31	
		投資その他の資産合計	501,815	720,218	
		固定資産合計	553,337	772,907	
		資産合計	7,522,173	7,913,637	

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					

1	預り金			15,053		12,372
2	未払金					
(1)	未払配当金	2	200,000		240,000	
(2)	未払手数料		332,515		320,577	
(3)	その他未払金		168,587	701,102	193,367	753,944
3	未払費用			1,106,809		985,047
4	未払消費税等			44,927		15,760
5	未払法人税等			71,550		225,326
6	賞与引当金			104,908		125,066
7	役員賞与引当金			5,400		7,200
	流動負債合計			2,049,753		2,124,718
	固定負債					
1	退職給付引当金			112,624		134,243
2	資産除去債務			8,181		8,327
	固定負債合計			120,805		142,570
	負債合計			2,170,558		2,267,288
	(純資産の部)					
	株主資本					
1	資本金			1,550,000		1,550,000
2	資本剰余金					
(1)	資本準備金			413,280		413,280
	資本剰余金合計			413,280		413,280
3	利益剰余金					
(1)	その他利益剰余金					
	繰越利益剰余金			3,385,956		3,675,113
	利益剰余金合計			3,385,956		3,675,113
	株主資本合計			5,349,236		5,638,393
	評価・換算差額等					
1	その他有価証券評価 差額金			2,378		7,956
	評価・換算差額等合 計			2,378		7,956
	純資産合計			5,351,614		5,646,349
	負債・純資産合計			7,522,173		7,913,637

(2)【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1	委託者報酬	5,004,466		4,693,325	
2	運用受託報酬	3,372,949	8,377,416	3,479,650	8,172,976
営業費用					
1	支払手数料	2,340,455		2,096,873	
2	広告宣伝費	40,406		30,230	
3	公告費	2,265		200	
4	調査費	2,634,404		2,532,683	

(1) 調査費		891,711		1,070,321	
(2) 委託調査費		1,738,613		1,457,726	
(3) 図書費		4,078		4,635	
5 営業雑経費		183,871		165,973	
(1) 通信費		6,147		6,109	
(2) 印刷費		162,442		145,335	
(3) 諸会費		15,281	5,201,402	14,528	4,825,961
一般管理費					
1 給料		1,460,280		1,523,789	
(1) 役員報酬		74,540		75,540	
(2) 給料・手当		1,210,435		1,260,953	
(3) 賞与		175,304		187,295	
2 福利厚生費		161,706		183,912	
3 交際費		10,338		10,052	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		49,534		39,791	
6 法人事業税		34,078		41,849	
7 租税公課		15,243		15,555	
8 不動産賃借料		206,575		208,923	
9 退職給付費用		45,062		58,381	
10 賞与引当金繰入		104,908		125,066	
11 役員賞与引当金繰入		5,400		7,200	
12 固定資産減価償却費		7,609		11,976	
13 諸経費		297,581	2,398,617	353,873	2,580,671
営業利益			777,396		766,343
営業外収益					
1 受取配当金		93		98	
2 受取利息		309		281	
3 有価証券売却益		654		12,029	
4 為替差益		1,906		-	
5 雑益		2,023	4,987	2,826	15,236
営業外費用					
1 為替差損		-		3,184	
2 事務過誤費		5		4,341	
3 雑損		115	121	198	7,724
経常利益			782,261		773,855
特別損失					
1 固定資産除却損	1	0	0	7	7
税引前当期純利益			782,261		773,847
法人税・住民税及び事業税			281,742		342,518
法人税等調整額			49,741		97,828
当期純利益			550,260		529,156

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計	
	資本	資本剰余金	その他利益 剰余金	利益剰余金		

	資本金	準備金	合計	繰越利益 剰余金	合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,035,695	3,035,695	4,998,975
当期変動額						
剰余金の配当				200,000	200,000	200,000
当期純利益				550,260	550,260	550,260
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純 額)						
当期変動額合 計	-	-	-	350,260	350,260	350,260
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	902	902	4,999,878
当期変動額			
剰余金の配当			200,000
当期純利益			550,260
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純 額)	1,475	1,475	1,475
当期変動額合 計	1,475	1,475	351,736
当期末残高	2,378	2,378	5,351,614

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,385,956	3,385,956	5,349,236
当期変動額						
剰余金の配当				240,000	240,000	240,000
当期純利益				529,156	529,156	529,156
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純 額)						
当期変動額合 計	-	-	-	289,156	289,156	289,156
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393

	評価・換算差額等
--	----------

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	2,378	2,378	5,351,614
当期変動額			
剰余金の配当			240,000
当期純利益			529,156
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	5,578	5,578	5,578
当期変動額合計	5,578	5,578	294,735
当期末残高	7,956	7,956	5,646,349

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	2～20年

3. 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。

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度における支給見込額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における要支給額を計上しております。

退職給付債務の計算に当たっては、「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号）に定める簡便法によっております。

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「事務過誤費」は、営業外費用の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた121千円は、「事務過誤費」5千円、「その他」115千円として組み替えております。

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用)

「『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)を当事業年度より適用し、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ております。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」55,224千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」273,815千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第5項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)及び同注解(注9)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

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は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	82,540	86,787
器具備品	47,055	52,226

2 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金		
未払配当金	200,000	240,000

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
器具備品	0	7

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度 期末株式数
普通株式	24,085株	-株	-株	24,085株

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
2018年3月27日 取締役会	普通株式	200,000千円	8,303円	2017年3月31日	2018年3月31日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度 期首株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度 期末株式数
普通株式	24,085株	-株	-株	24,085株

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
2019年3月27日 取締役会	普通株式	240,000千円	9,964円	2018年3月31日	2019年3月31日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

(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

当社では、主として短期的な預金及び一部の有価証券によって運用しており、経営として許容できる範囲内にリスクを制御するよう、適切に資産運用を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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、そのほとんどが信託財産から支払われるため、回収リスクは僅少であります。

投資有価証券は、主に投資信託を保有しており、今後の基準価額の下落によっては、売却損・評価損計上による利益減少や、評価差額金の減少により純資産が減少するなど、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、短期的な預金について、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

価格変動リスクについては、四半期ごとに時価の状況等を把握し、当該状況については資産運

用管理規程に従い、経理担当部が取締役会等へ報告し、適切に管理を行っております。

(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めておりません（注2.参照）。

前事業年度（2018年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,606,103	4,606,103	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	919,027	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	1,371,086	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	50,620	50,620	-
資産計	6,946,838	6,946,838	-
(1) 未払費用	1,106,809	1,106,809	-
負債計	1,106,809	1,106,809	-

当事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	5,031,436	5,031,436	-
(2) 未収委託者報酬	892,311	892,311	-
(3) 未収運用受託報酬	1,133,534	1,133,534	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	188,657	188,657	-
資産計	7,245,941	7,245,941	-
(1) 未払費用	985,047	985,047	-
負債計	985,047	985,047	-

注1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

時価については、公表されている基準価額または取引金融機関等から提示された基準価額によっております。

負債

(1) 未払費用

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

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
非上場株式	15,750	750

非上場株式は、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、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	4,605,909	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	919,027	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,371,086	-	-	-
(4) 投資有価証券				
その他有価証券のうち				
満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	37,688	1,126	11,806
合計	6,896,023	37,688	1,126	11,806

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	5,031,283	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	892,311	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	1,133,534	-	-	-
(4) 投資有価証券				
その他有価証券のうち				
満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	177,539	11,118	-
合計	7,057,129	177,539	11,118	-

注4. 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:千円)

	種類	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	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	40,528	36,993	3,534
	小計	40,528	36,993	3,534

貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	10,092	10,199	106
	小計	10,092	10,199	106
合計		50,620	47,193	3,427

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

	種類	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	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	176,630	165,000	11,630
	小計	176,630	165,000	11,630
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	12,027	12,189	161
	小計	12,027	12,189	161
合計		188,657	177,189	11,468

5. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	6,160	668	14
合計	6,160	668	14

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	24,900	9,900	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	13,229	2,130	0
合計	38,129	12,030	0

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要(出向受入者に対する出向元への退職金負担額を除く。)

当社は、従業員の退職給付に充てるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出制度を採用しております。

退職一時金制度(非積立型制度であります。)では、退職給付として、給与と勤務期間に基づいた一時金を支給しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 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

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (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	90,737	112,624
退職給付費用	24,091	23,211
退職給付の支払額	2,204	1,592

退職給付引当金の期末残高	112,624	134,243
--------------	---------	---------

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	112,624	134,243
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	112,624	134,243
退職給付引当金	112,624	134,243
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	112,624	134,243

(3) 退職給付費用

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	24,091	23,211

3. 確定拠出制度

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当社の確定拠出制度への要拠出額	14,515	25,915

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

(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

(単位:千円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
ソフトウェア損金算入限度超過額	172,841	259,327
退職給付引当金	34,485	41,105
賞与引当金	32,123	38,295
未払費用否認	17,276	14,684
未払事業税	6,393	14,487
繰延資産損金算入限度超過額	6,561	5,949
その他	8,285	4,944
繰延税金資産 小計	277,965	378,793
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	-	2,645
評価性引当額 小計	2,595	2,645
繰延税金資産 合計	275,370	376,148
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	1,049	3,512
株式譲渡損益	-	3,031
固定資産除去価額	505	424
繰延税金負債 合計	1,554	6,967
繰延税金資産の純額	273,815	369,181

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間に重要な差異があるときの、当該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。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.7%～1.8%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
期首残高	8,039	8,181
時の経過による調整額	142	145
期末残高	8,181	8,327

（セグメント情報等）

セグメント情報

当社は、投資運用事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。

関連情報

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益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。

2. 地域ごとの情報

- （1）営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えているため、記載を省略しております。

- （2）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%を超えているため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益
B社（注）	972,353

（注）B社との間で守秘義務契約を負っているため、社名の公表は控えております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益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。

2. 地域ごとの情報

- （1）営業収益

（単位：千円）

日本	欧州	中東	米国	アジア	合計
7,315,521	575,733	128,375	117,530	35,814	8,172,976

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 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%を超えているため、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%を占めるものがないため、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) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等

記載すべき重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り (注1)	165,124	未収運用受託報酬	89,703
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払 (注2)	468,486	未払手数料	107,721

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	--------	-----	-------------	-------	----------------	-----------	-------	--------------	----	--------------

同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払（注1）	488,979	未払手数料	107,223
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り（注2）	165,115	未収運用受託報酬	88,523

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

注2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

（注2）運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

（4）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等との取引はありません。

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

SOMPOホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務情報

関連会社はありません。

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
1株当たり純資産額（円）	222,196.99	234,434.27
1株当たり当期純利益金額（円）	22,846.62	21,970.39

（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。

	前事業年度 （自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）	当事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
当期純利益（千円）	550,260	529,156
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益（千円）	550,260	529,156
期中平均株式数（株）	24,085	24,085

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

（1）中間貸借対照表

		第35期中間会計期間 （2019年9月30日）
--	--	----------------------------

区分	注記 番号	金額（千円）
（資産の部）		
流動資産		
1 現金・預金		4,462,716
2 前払費用		85,834
3 未収委託者報酬		1,064,536
4 未収運用受託報酬		1,051,386
5 未収収益		44
6 その他		3,500
流動資産合計		6,668,018
固定資産		
1 有形固定資産	1	108,449
2 無形固定資産		4,535
3 投資その他の資産		
(1) 投資有価証券		198,354
(2) 長期差入保証金		161,598
(3) 繰延税金資産		377,510
(4) その他		33
投資その他の資産合計		737,495
固定資産合計		850,480
資産合計		7,518,498

		第35期中間会計期間 (2019年9月30日)
区分	注記 番号	金額（千円）
（負債の部）		
流動負債		
1 預り金		7,118
2 未払金		
(1) 未払手数料		341,929
(2) その他未払金		274,113
未払金合計		616,043
3 未払費用		612,977
4 未払法人税等		143,352
5 賞与引当金		94,702
6 役員賞与引当金		2,400
7 その他	2	17,246
流動負債合計		1,493,840
固定負債		
1 退職給付引当金		145,393
2 資産除去債務		8,401
固定負債合計		153,794
負債合計		1,647,635
（純資産の部）		
株主資本		
1 資本金		1,550,000
2 資本剰余金		
(1) 資本準備金		413,280
資本剰余金合計		413,280
3 利益剰余金		
(1) その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		3,899,384
利益剰余金合計		3,899,384
株主資本合計		5,862,664
評価・換算差額等		
1 その他有価証券評価差額金		8,198
評価・換算差額等合計		8,198
純資産合計		5,870,862
負債・純資産合計		7,518,498

(2) 中間損益計算書

		第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
区分	注記 番号	金額(千円)	
営業収益			
1 委託者報酬		2,322,007	
2 運用受託報酬		1,597,031	3,919,039
営業費用			
1 支払手数料		995,486	
2 広告宣伝費		10,061	
3 公告費		200	
4 調査費		1,147,700	
(1) 調査費		546,899	
(2) 委託調査費		598,768	
(3) 図書費		2,032	
5 営業雑経費		99,614	
(1) 通信費		2,982	
(2) 印刷費		83,826	
(3) 諸会費		12,805	
一般管理費			2,253,063
1 給料		737,162	
(1) 役員報酬		43,456	
(2) 給料・手当		634,700	
(3) 賞与		59,005	
2 福利厚生費		94,456	
3 交際費		5,697	
4 旅費交通費		27,044	
5 法人事業税		27,501	
6 租税公課		3,807	
7 不動産賃借料		107,624	
8 退職給付費用		33,183	
9 賞与引当金繰入		94,702	
10 役員賞与引当金繰入		2,400	
11 固定資産減価償却費	1	5,810	
12 諸経費		184,843	1,324,235
営業利益			341,740
営業外収益			
1 受取配当金		90	
2 受取利息		132	
3 雑益		781	1,004
営業外費用			
1 有価証券売却損		2	
2 有価証券償還損		11	
3 為替差損		4,207	
4 雑損		128	4,349
経常利益			338,395
特別損失			
1 固定資産除却損		409	
2 商号変更費用		279	689
税引前中間純利益			337,706
法人税、住民税及び事業税			121,869
法人税等調整額			8,435
中間純利益			224,271

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計	
	資本	資本剰余金	その他利益 剰余金	利益剰余金		

	資本金	準備金	合計	繰越利益 剰余金	合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393
当中間期変動額						
中間純利益				224,271	224,271	224,271
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動 額合計	-	-	-	224,271	224,271	224,271
当中間期末残高	1,550,000	413,280	413,280	3,899,384	3,899,384	5,862,664

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7,956	7,956	5,646,349
当中間期変動額			
中間純利益			224,271
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	242	242	242
当中間期変動 額合計	242	242	224,513
当中間期末残高	8,198	8,198	5,870,862

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 15年

器具備品 2～20年

3. 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、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における要支給額を計上しております。

退職給付債務の計算に当たっては、「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号)に定める簡便法によっております。

5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

	第35期中間会計期間 (2019年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	143,605千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1 減価償却実施額 有形固定資産	5,810千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数並びに自己株式の種類及び株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間 末株式数(株)
発行済株式				
普通株式	24,085	-	-	24,085
合計	24,085	-	-	24,085
自己株式				
普通株式	-	-	-	-
合計	-	-	-	-

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

該当事項はありません。

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間の末日後となるもの

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第35期中間会計期間 (2019年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、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めておりません(注2.参照)。

(単位：千円)

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	4,462,716	4,462,716	-
(2) 未収委託者報酬	1,064,536	1,064,536	-
(3) 未収運用受託報酬	1,051,386	1,051,386	-
(4) 投資有価証券			
その他有価証券	197,604	197,604	-
資産計	6,776,242	6,776,242	-
(1) 未払費用	612,977	612,977	-
負債計	612,977	612,977	-

注1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 投資有価証券

時価については、公表されている基準価額または取引金融機関等から提示された基準価額によっております。

負 債

(1) 未払費用

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

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
非上場株式	750

非上場株式は、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、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間 (2019年9月30日)

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

3. その他有価証券

(単位：千円)

	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	186,669	174,700	11,969
	小計	186,669	174,700	11,969
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	10,935	11,087	152
	小計	10,935	11,087	152
合計		197,604	185,787	11,816

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

第35期中間会計期間 (2019年9月30日)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	8,327千円
時の経過による調整額	74千円
中間期末残高	8,401千円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

当社は、投資運用事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。

関連情報

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間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。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

(単位：千円)

日本	欧州	北米	中東	アジア	合計
3,430,451	246,607	120,521	94,487	26,971	3,919,039

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えているため、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中間損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

(1株当たり情報)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1株当たり純資産額	243,755.98 円
1株当たり中間純利益金額	9,311.65 円 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり中間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35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益	224,271 千円
普通株主に帰属しない金額	- 千円

普通株式に係る中間純利益	224,271 千円
普通株式の期中平均株式数	24,085 株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

5【その他】

<訂正前>

(1) 定款の変更

2019年6月27日付で取締役の数の上限を変更する定款の変更を行いました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

<訂正後>

(1) 定款の変更

2019年6月27日付で取締役の数の上限を変更する定款の変更を行いました。

2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更する定款変更を行いました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2020年4月1日付で商号をS O M P Oアセットマネジメント株式会社に変更しました。

第3【その他】

<訂正前>

(略)

ご投資家のみなさまへ

ファンドは、アジア企業が米ドル等の外貨建てで発行する、主としてB B格以下の格付けの債券に投資します。信用力はB B B格以上の債券より劣りますが、その対価としての高利回りと、アジアの高成長を背景とした信用力向上による債券価格の安定推移が期待できます。アジア債券運用の豊富な経験を有するシンガポールの運用会社が、投資先を選別して運用します。

通貨に関しては、為替ヘッジを行わない米ドルコース、為替ヘッジを行う日本円コースに加えて、為替取引により金利差収入と各通貨の為替差益を期待する3コース(アジア通貨・高金利通貨・ブラジルリアル)を含む5つからお選びいただきます。日本円コースを除き、米ドルや各通貨が下落する場合のリスクをご負担いただきます。

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント

<訂正後>
(略)

ご投資家のみなさまへ

ファンドは、アジア企業が米ドル等の外貨建てで発行する、主としてB B格以下の格付けの債券に投資します。信用力はB B B格以上の債券より劣りますが、その対価としての高利回りと、アジアの高成長を背景とした信用力向上による債券価格の安定推移が期待できます。アジア債券運用の豊富な経験を有するシンガポールの運用会社が、投資先を選別して運用します。

通貨に関しては、為替ヘッジを行わない米ドルコース、為替ヘッジを行う日本円コースに加えて、為替取引により金利差収入と各通貨の為替差益を期待する3コース(アジア通貨・高金利通貨・ブラジルリアル)を含む5つからお選びいただきます。日本円コースを除き、米ドルや各通貨が下落する場合のリスクをご負担いただきます。

SOMPOアセットマネジメント

独立監査人の監査報告書

2020年4月3日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	蒲 谷 剛 史
--------------------	-------	------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊 藤 志 保
--------------------	-------	------------

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」に掲げられているりそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コースの2019年8月14日から2020年2月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド アジア通貨コースの2020年2月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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

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

以 上

- (注) 1. 上記は、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。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年4月3日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	蒲 谷 剛 史
--------------------	-------	------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊 藤 志 保
--------------------	-------	------------

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」に掲げられているりそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コースの2019年8月14日から2020年2月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 高金利通貨コースの2020年2月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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

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

以 上

(注) 1. 上記は、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。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年4月3日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志
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」に掲げられているりそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコースの2019年8月14日から2020年2月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド ブラジルリアルコースの2020年2月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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

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

以 上

(注) 1. 上記は、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。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年4月3日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	蒲 谷 剛 史
--------------------	-------	------------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊 藤 志 保
--------------------	-------	------------

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」に掲げられているりそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコースの2019年8月14日から2020年2月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 米ドルコースの2020年2月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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

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

以 上

- (注) 1. 上記は、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。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年4月3日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志
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」に掲げられているりそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コースの2019年8月14日から2020年2月10日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、りそなアジア・ハイ・イールド債券ファンド 日本円コースの2020年2月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を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

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

以 上

(注) 1. 上記は、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。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2019年6月3日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛史
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
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、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の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、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の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の状況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。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月26日

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 蒲 谷 剛 史指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊 藤 志 保

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」に掲げられている損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績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

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。