

【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7月13日提出
【発行者名】	日興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 安倍 秀雄
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【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】	世界のサイフ
【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】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので2020年1月15日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

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>に記載している内容は原届出書が更新されます。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。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

1 原則として、高金利の10通貨を選定し、当該通貨建ての短期債券などに投資します。

- 投資対象は日本を除く経済協力開発機構(OECD)加盟国およびこれらに準ずる国の通貨建ての短期債券などとしします。
- 原則として、相対的に高金利の10通貨に均等分散します。
- 投資対象債券は、原則として高格付の短期債券とします。
- 原則として為替ヘッジは行ないません。

2 毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

- 主に組入債券の利子収入などを原資として、毎決算時に安定した収益分配を行なうことをめざします。
- 毎月12日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

【収益分配のイメージ】



※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行わない場合もあります。

※上図はイメージであり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

相対的に高金利の通貨建て資産に投資し、利子収入などを中心とする安定的な収益の確保をめざします。

- 日本を除く経済協力開発機構(OECD)*1加盟国およびこれらに準ずる国*2の中から、相対的に高金利の通貨を選んで投資します。

<投資対象通貨となる国・地域の格付>

国名	通貨	S&P社	ムーディーズ社
カナダ	ドル	AAA	Aaa
ドイツ	ユーロ	AAA	Aaa
デンマーク	クローネ	AAA	Aaa
スイス	フラン	AAA	Aaa
スウェーデン	クローナ	AAA	Aaa
ノルウェー	クローネ	AAA	Aaa
オーストラリア	ドル	AAA	Aaa
アメリカ	ドル	AA+	Aaa
ニュージーランド	ドル	AA+	Aaa
チェコ	コルナ	AA	Aa3
イギリス	ポンド	AA	Aa2
韓国	ウォン	AA	Aa2
チリ	ペソ	AA-	A1
イスラエル	シェケル	AA-	A1
アイスランド	クローネ	A	A2
ポーランド	ズロチ	A	A2
メキシコ	ペソ	BBB+	Baa1
ハンガリー	フォリント	BBB	Baa3
トルコ	リラ	BB-	B1
シンガポール	ドル	AAA	Aaa
香港	ドル	AA+	Aa3

※左記の格付は2020年4月末時点で自国通貨建長期債務に対して付与されているものです。

(*1) OECD(経済協力開発機構)とは

①財政金融上の安定を維持しながら雇用、生活水準の向上を達成し、世界経済の発展に貢献する。
②発展途上国経済の健全な拡大に寄与する。
③世界貿易の多角的・無差別的な拡大に貢献する。
などを目的として1961年に発足した機構であり、30カ国を超える国が加盟しています。

(*2) OECD加盟国に準ずる国とは

当ファンドでは、自国通貨建長期債務に対してS&P社よりAマイナス格以上、もしくはムーディーズ社よりA3格以上の格付を取得している国と定義しています。

原則として、10通貨に均等分散します。

- 通貨選定にあたっては、各通貨の金利水準を最重要視しますが、各国のファンダメンタルズや短期市場の流動性等も考慮します。
- 投資通貨の見直しは年2回行ないます。ただし、必要と判断した場合は別のタイミングで一部投資通貨の入れ替えを行なうことがあります。
- 原則として為替ヘッジは行なわず、投資通貨を分散することで為替変動リスクの低減をめざします。ただし、投資通貨が日本円に対して全般的に急激に変動するような局面においては、リスクが大きくなる場合があります。

※原則として、10通貨への投資配分は概ね均等を維持しますが、流動性や金利状況などを勘案して、組入通貨数が10とならない場合や各通貨への投資配分を均等としない場合があります。

※流動性などを考慮して、限定的に為替予約取引等を利用して各通貨への実質的な投資を行なう場合があります。

ご参考

<短期(3ヵ月)金利の水準>



※上記の金利と実際の組入債券の金利水準は異なります。

※上記は切り捨てにて端数処理しています。

※上記グラフおよびデータは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものでも、上記の国・地域の債券を組み入れることを約束するものでも推奨するものでもありません。

複数の通貨に投資し、為替変動リスクの低減をめざします。

●高金利通貨への投資は、単一通貨ではややリスクが高いものの、組み合わせて投資することで、リスク水準を低減することが期待できます。

※ただし、投資通貨が日本円に対して全般的に急激に変動するような局面においては、リスクが大きくなる場合があります。

ご参考 <為替変動リスク(対円)の比較>



(信頼できると判断した情報をもとに日興アセットマネジメントが作成)

※上記の国の通貨建て債券を組入れることを約束するものでも、推奨するものでもありません。

※上記は過去のものであり、将来の運用成果、リスク水準等を約束するものではありません。

※リスクは、日次リターン標準偏差を年率換算したものです。

※基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の分配金再投資基準価額の値です。分配金再投資基準価額とは、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

※グラフ中の当ファンドのリスクは、通貨の動き、債券の金利収入・価格変動の影響を受けますので、為替変動リスク以外のリスク(金利変動リスク、信用リスクなど)も含まれます。

※上記は2020年4月末現在の投資通貨です。当ファンドの投資通貨は時期によって異なります。

高格付の債券に投資し、信用リスクの低減をめざします。

●安全性を重視した資産に投資し、安定した運用をめざします。

【投資対象となる有価証券・金融商品の格付】

長期格付	短期格付	投資対象
Aaa	P-1	↑ 高信用度 ↓ 低信用度
Aa	P-2	
A	P-3	
Baa	NP	
Ba		
B		
Caa		

※上記の格付表記はムーディーズ社の表記です。

■国債、政府機関債、政府保証債、国際機関債、社債、ABS、コマーシャルペーパーなどを主要投資対象とします。

■原則として、買付時において長期格付でA格相当以上(*)または短期格付でP-2格相当以上の格付が付与されているものに投資します。

(*)S&P社でAマイナス格以上、ムーディーズ社でA3格以上を表します。

※格付は、買付後に変更になる場合があります。

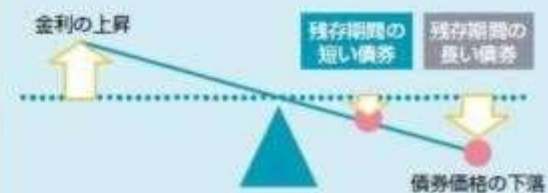
短期債券に投資し、金利変動に伴う価格変動リスクの低減をめざします。

●残存期間は1年以内(変動利付債券の場合は10年以内)の債券に投資します。

●ポートフォリオの平均残存期間は180日以内とします。

【債券の価格特性】

一般に金利が上昇すると、債券の価格は下落します。残存期間の短い債券は、残存期間の長い債券に比べ、金利変動時の価格変動が相対的に軽微になります。

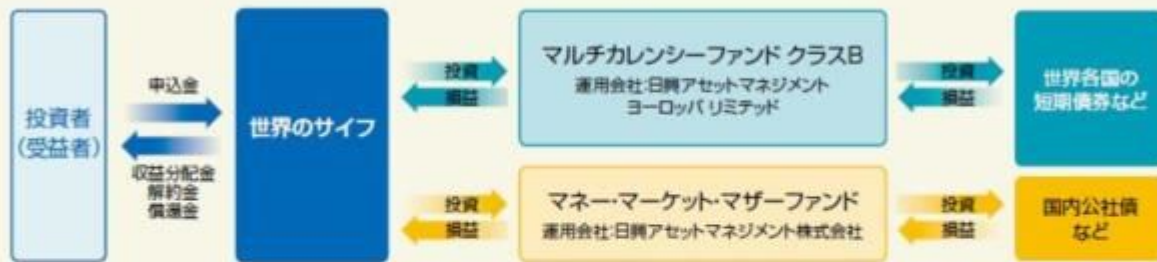


※上記はイメージ図です。

※価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる動きをする場合があります。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



(主な投資制限)

- ・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- ・外貨建資産への直接投資は行ないません。

(分配方針)

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



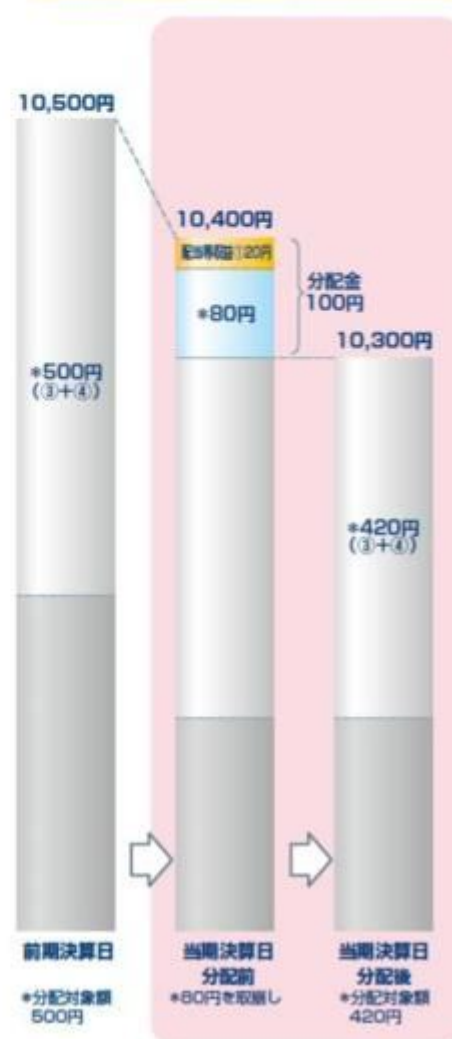
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

● 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※ 元本払戻金（特別分配金）は実質的には元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は**非課税扱い**となります。

- ・ 普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
- ・ 元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、（特別分配金）元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（３）【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

委託会社の概況（2020年4月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

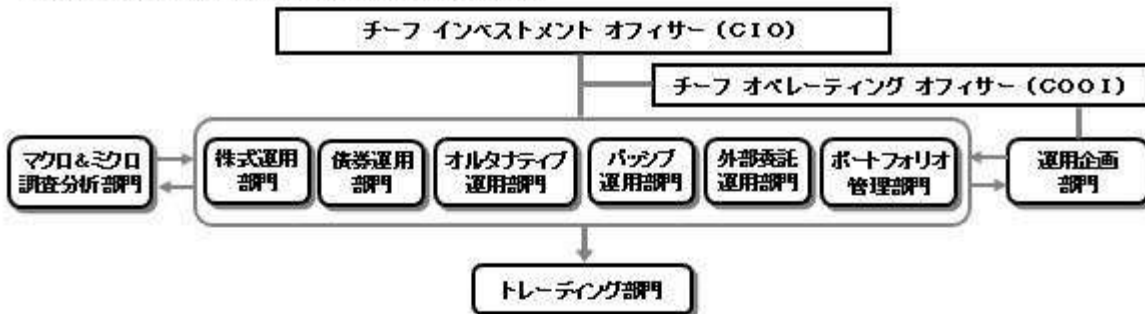
名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

2 【投資方針】

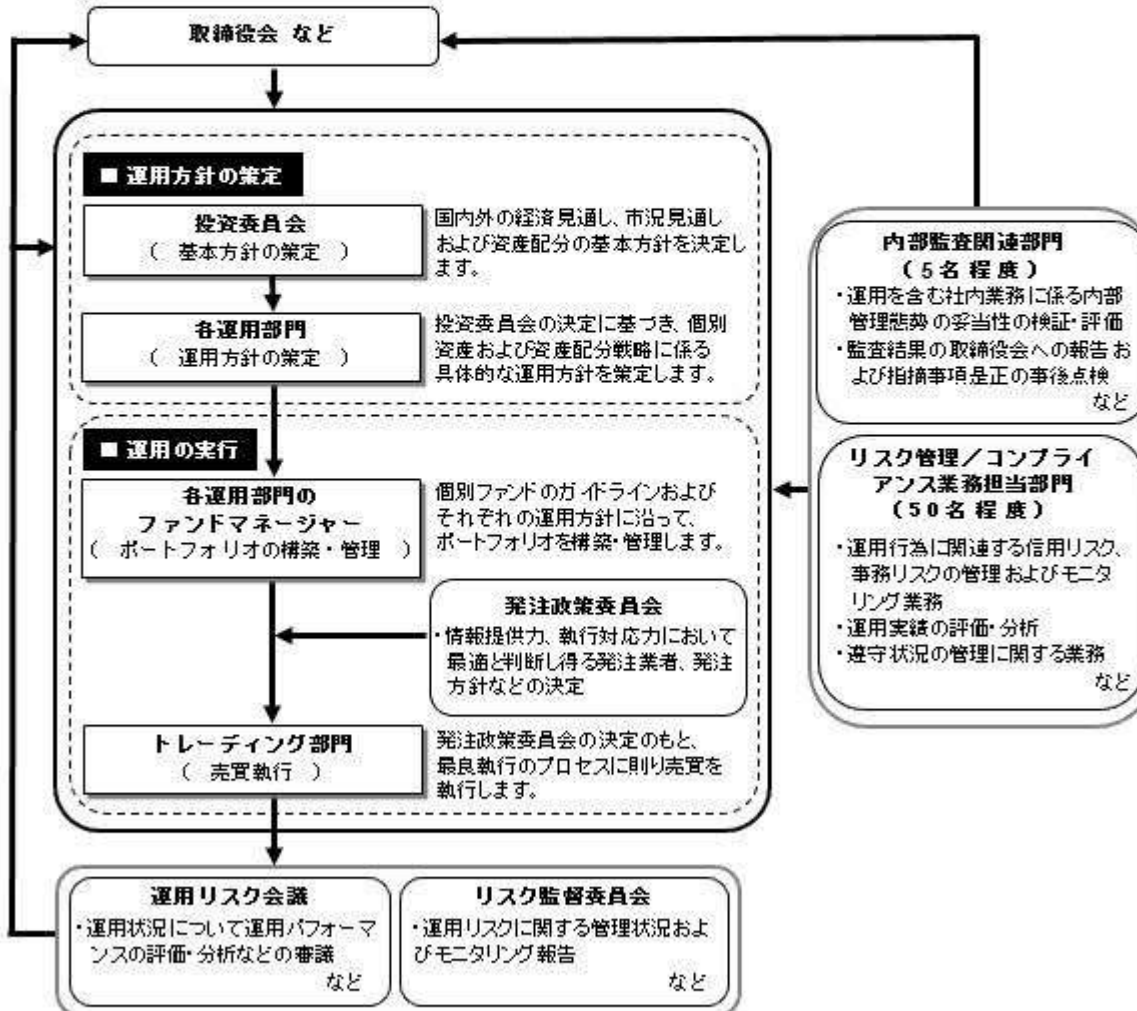
（３）【運用体制】

< 更新後 >

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



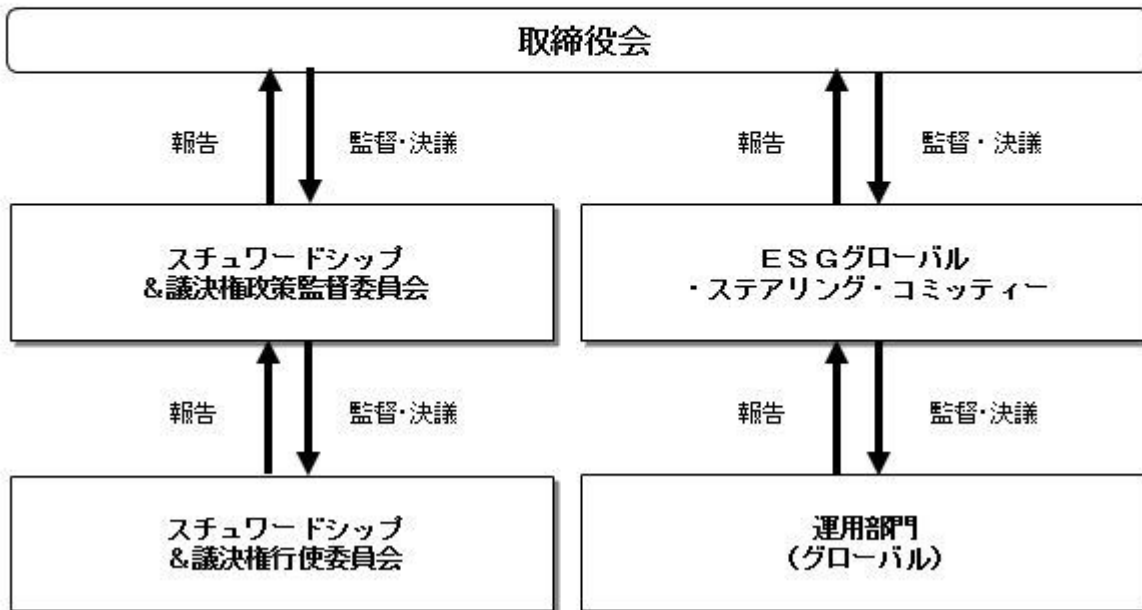
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きまで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行うこととしています。

（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）

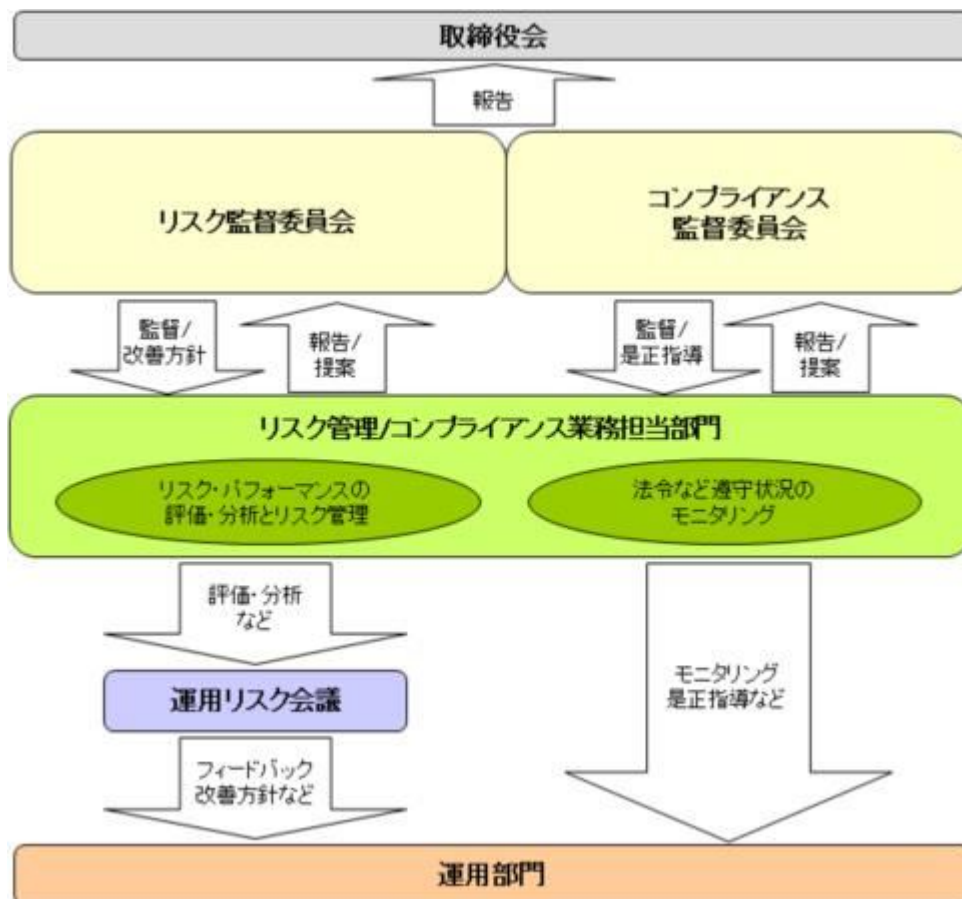


上記体制は2020年4月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<更新後>

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスクの管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

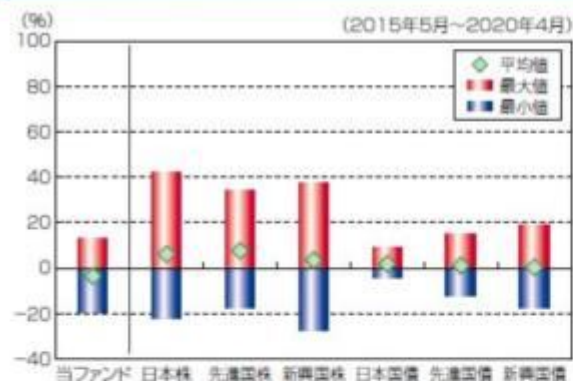
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2020年4月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 更新後 >

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	-3.5%	6.1%	7.5%	3.5%	1.9%	1.1%	0.4%
最大値	13.1%	41.9%	34.1%	37.2%	9.3%	15.3%	19.3%
最小値	-19.4%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-12.3%	-17.4%

※上記は当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当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2015年5月から2020年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の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。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ティバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※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。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2015年5月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の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。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、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。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

（5）【課税上の取扱い】

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）^{*}については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

^{*} 解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれませ

ん。)が個別元本になります。

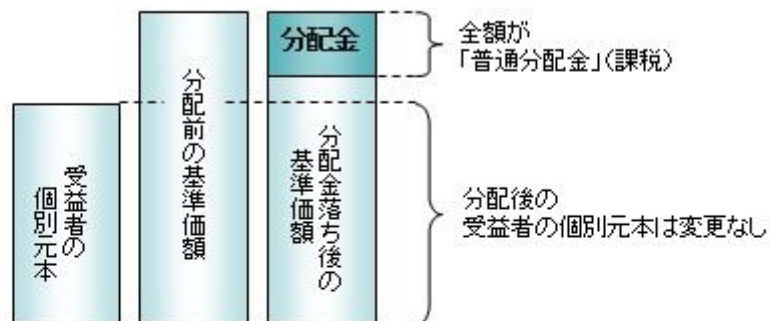
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

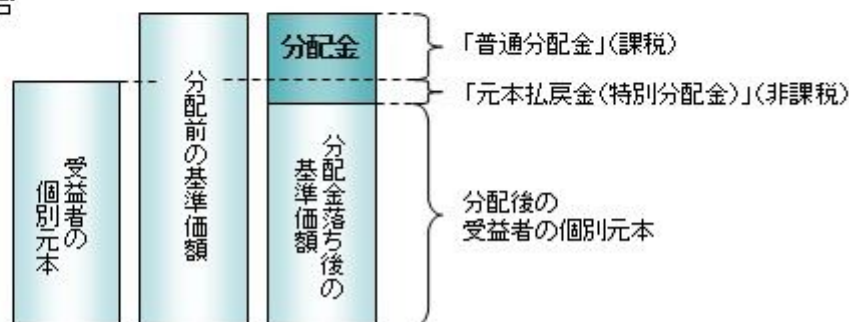
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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7月13日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【世界のサイフ】

以下の運用状況は2020年 4月30日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

投資信託受益証券	ケイマン	16,332,182,383	98.37
親投資信託受益証券	日本	16,684,644	0.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		254,766,997	1.53
合計（純資産総額）		16,603,634,024	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
ケイマン	投資信託受益証券	マルチカレンシーファンド クラスB	128,904,359,772	0.12	16,628,662,410	0.12	16,332,182,383	98.37
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	16,433,216	1.0153	16,684,644	1.0153	16,684,644	0.10

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.37
親投資信託受益証券	0.10
合計	98.47

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第8特定期間末 (2010年10月12日)	202,075	204,315	0.5413	0.5473
第9特定期間末 (2011年 4月12日)	195,620	197,756	0.5495	0.5555
第10特定期間末 (2011年10月12日)	148,732	150,813	0.4289	0.4349
第11特定期間末 (2012年 4月12日)	131,118	132,653	0.4271	0.4321
第12特定期間末 (2012年10月12日)	110,391	111,815	0.3877	0.3927
第13特定期間末 (2013年 4月12日)	119,008	120,002	0.4791	0.4831

第14特定期間末	(2013年10月15日)	100,597	101,532	0.4302	0.4342
第15特定期間末	(2014年 4月14日)	90,651	91,512	0.4213	0.4253
第16特定期間末	(2014年10月14日)	80,595	81,406	0.3974	0.4014
第17特定期間末	(2015年 4月13日)	72,127	72,887	0.3795	0.3835
第18特定期間末	(2015年10月13日)	61,550	62,268	0.3427	0.3467
第19特定期間末	(2016年 4月12日)	48,251	48,584	0.2896	0.2916
第20特定期間末	(2016年10月12日)	39,442	39,743	0.2623	0.2643
第21特定期間末	(2017年 4月12日)	36,475	36,754	0.2618	0.2638
第22特定期間末	(2017年10月12日)	34,537	34,794	0.2686	0.2706
第23特定期間末	(2018年 4月12日)	29,998	30,238	0.2501	0.2521
第24特定期間末	(2018年10月12日)	25,758	25,983	0.2294	0.2314
第25特定期間末	(2019年 4月12日)	23,490	23,703	0.2213	0.2233
第26特定期間末	(2019年10月15日)	20,474	20,678	0.2006	0.2026
第27特定期間末	(2020年 4月13日)	16,873	17,066	0.1747	0.1767
	2019年 4月末日	23,094		0.2186	
	5月末日	22,306		0.2114	
	6月末日	22,078		0.2107	
	7月末日	21,721		0.2091	
	8月末日	20,456		0.1978	
	9月末日	20,524		0.2003	
	10月末日	20,484		0.2021	
	11月末日	19,880		0.1982	
	12月末日	20,003		0.2018	
	2020年 1月末日	19,127		0.1945	
	2月末日	18,722		0.1914	
	3月末日	16,890		0.1742	
	4月末日	16,603		0.1715	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第8特定期間	2010年 4月13日～2010年10月12日	0.0360
第9特定期間	2010年10月13日～2011年 4月12日	0.0360
第10特定期間	2011年 4月13日～2011年10月12日	0.0360
第11特定期間	2011年10月13日～2012年 4月12日	0.0310
第12特定期間	2012年 4月13日～2012年10月12日	0.0300
第13特定期間	2012年10月13日～2013年 4月12日	0.0240
第14特定期間	2013年 4月13日～2013年10月15日	0.0240
第15特定期間	2013年10月16日～2014年 4月14日	0.0240
第16特定期間	2014年 4月15日～2014年10月14日	0.0240
第17特定期間	2014年10月15日～2015年 4月13日	0.0240

第18特定期間	2015年 4月14日～2015年10月13日	0.0240
第19特定期間	2015年10月14日～2016年 4月12日	0.0200
第20特定期間	2016年 4月13日～2016年10月12日	0.0120
第21特定期間	2016年10月13日～2017年 4月12日	0.0120
第22特定期間	2017年 4月13日～2017年10月12日	0.0120
第23特定期間	2017年10月13日～2018年 4月12日	0.0120
第24特定期間	2018年 4月13日～2018年10月12日	0.0120
第25特定期間	2018年10月13日～2019年 4月12日	0.0120
第26特定期間	2019年 4月13日～2019年10月15日	0.0120
第27特定期間	2019年10月16日～2020年 4月13日	0.0120

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第8特定期間	2010年 4月13日～2010年10月12日	7.53
第9特定期間	2010年10月13日～2011年 4月12日	8.17
第10特定期間	2011年 4月13日～2011年10月12日	15.40
第11特定期間	2011年10月13日～2012年 4月12日	6.81
第12特定期間	2012年 4月13日～2012年10月12日	2.20
第13特定期間	2012年10月13日～2013年 4月12日	29.77
第14特定期間	2013年 4月13日～2013年10月15日	5.20
第15特定期間	2013年10月16日～2014年 4月14日	3.51
第16特定期間	2014年 4月15日～2014年10月14日	0.02
第17特定期間	2014年10月15日～2015年 4月13日	1.53
第18特定期間	2015年 4月14日～2015年10月13日	3.37
第19特定期間	2015年10月14日～2016年 4月12日	9.66
第20特定期間	2016年 4月13日～2016年10月12日	5.28
第21特定期間	2016年10月13日～2017年 4月12日	4.38
第22特定期間	2017年 4月13日～2017年10月12日	7.18
第23特定期間	2017年10月13日～2018年 4月12日	2.42
第24特定期間	2018年 4月13日～2018年10月12日	3.48
第25特定期間	2018年10月13日～2019年 4月12日	1.70
第26特定期間	2019年 4月13日～2019年10月15日	3.93
第27特定期間	2019年10月16日～2020年 4月13日	6.93

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）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（分配落ち、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。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
---	----	---------	---------

第8特定期間	2010年 4月13日～2010年10月12日	44,335,169,746	39,457,545,155
第9特定期間	2010年10月13日～2011年 4月12日	26,806,443,611	44,124,483,037
第10特定期間	2011年 4月13日～2011年10月12日	28,799,484,112	38,049,845,172
第11特定期間	2011年10月13日～2012年 4月12日	10,336,486,246	50,118,171,144
第12特定期間	2012年 4月13日～2012年10月12日	8,841,609,656	31,064,310,436
第13特定期間	2012年10月13日～2013年 4月12日	11,931,755,842	48,273,967,644
第14特定期間	2013年 4月13日～2013年10月15日	13,723,151,515	28,284,116,379
第15特定期間	2013年10月16日～2014年 4月14日	8,695,046,299	27,382,599,177
第16特定期間	2014年 4月15日～2014年10月14日	10,558,918,156	22,925,898,178
第17特定期間	2014年10月15日～2015年 4月13日	11,819,471,926	24,555,334,972
第18特定期間	2015年 4月14日～2015年10月13日	7,758,838,283	18,229,979,943
第19特定期間	2015年10月14日～2016年 4月12日	5,222,460,541	18,179,189,826
第20特定期間	2016年 4月13日～2016年10月12日	2,474,279,973	18,761,895,098
第21特定期間	2016年10月13日～2017年 4月12日	2,448,066,988	13,486,834,660
第22特定期間	2017年 4月13日～2017年10月12日	2,555,489,287	13,298,485,573
第23特定期間	2017年10月13日～2018年 4月12日	3,075,843,542	11,720,923,374
第24特定期間	2018年 4月13日～2018年10月12日	2,230,866,117	9,859,277,917
第25特定期間	2018年10月13日～2019年 4月12日	2,375,000,336	8,520,624,109
第26特定期間	2019年 4月13日～2019年10月15日	2,970,928,122	7,062,550,350
第27特定期間	2019年10月16日～2020年 4月13日	3,035,136,876	8,482,915,224

（参考）

マネー・マーケット・マザーファンド

以下の運用状況は2020年 4月30日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		26,365,053	100.00
合計（純資産総額）		26,365,053	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別の投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

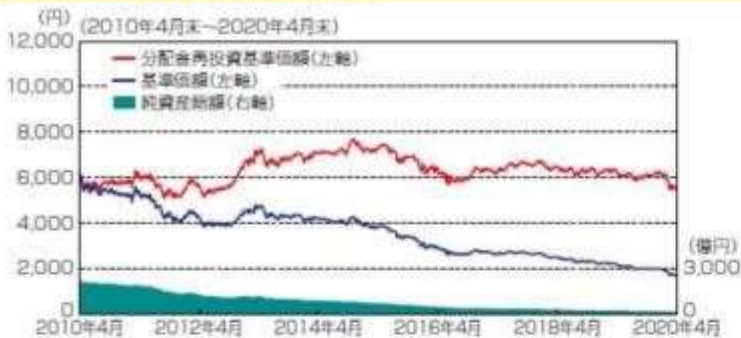
該当事項はありません。

参考情報

運用実績

2020年4月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額.....1,715円

純資産総額..... 166.03億円

※基準価額は運用管理費用（信託報酬）控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2010年4月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金（税引前）を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移（税引前、1万口当たり）

2019年12月	2020年1月	2020年2月	2020年3月	2020年4月	最近1年間累計	設定以来累計
20円	20円	20円	20円	20円	240円	6,580円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

マルチカレンシーファンド クラスB	98.4%
マネー・マーケット・マザーファンド	0.1%
現金その他	1.5%

<格付別構成比>

短期金融商品	P-1	30.4%
	P-2	0.0%
	P-3以下	0.0%
	平均格付	P-1
債券	Aaa	29.1%
	Aa	30.3%
	A	9.4%
	Baa以下	0.0%
	平均格付	Aa2

※比率は当外国投資信託の純資産総額比です。
 ※格付はMoody's、S&Pのうち、高い格付を採用しています。
 ※短期金融商品はコマーシャルペーパーや短期のソブリン債などです。
 ※平均格付とは、データ基準日時点で当外国投資信託が保有している有価証券などに係る信用格付を加重平均したものであり、当外国投資信託に係る信用格付ではありません。

<公社債別構成比>

ソブリン債	61.7%
社債・その他	37.5%
社債	13.7%
ABS	0.0%
コマーシャルペーパー	23.8%
その他	0.0%

※比率は当外国投資信託の純資産総額比です。
 ※ソブリン債は国債、政府機関債、政府保証債、国際機関債などです。

※上記は、日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッドより提供された情報です。

マルチカレンシーファンド クラスBのポートフォリオの内容

<通貨別構成比>



※比率は当外国投資信託の純資産総額比です。
 ※その他は円などです。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
 ※当ファンドには、ベンチマークはありません。
 ※2020年は、2020年4月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 ※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第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）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2019年10月16日から2020年4月13日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた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】

【世界のサイフ】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2019年10月15日現在	当期 2020年4月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	521,072,872	295,667,137
投資信託受益証券	20,170,835,068	16,628,662,410
親投資信託受益証券	20,073,431	16,684,644
未収入金	175,640	149,315,188
流動資産合計	20,712,157,011	17,090,329,379
資産合計	20,712,157,011	17,090,329,379
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	204,116,184	193,220,627
未払解約金	14,480,253	10,482,464
未払受託者報酬	803,371	682,538
未払委託者報酬	12,336,411	9,938,395
未払利息	114	113
その他未払費用	5,943,505	2,790,149
流動負債合計	237,679,838	217,114,286
負債合計	237,679,838	217,114,286
純資産の部		
元本等		
元本	102,058,092,017	96,610,313,669
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	81,583,614,844	79,737,098,576
(分配準備積立金)	9,686,794,511	8,090,493,308
元本等合計	20,474,477,173	16,873,215,093
純資産合計	20,474,477,173	16,873,215,093
負債純資産合計	20,712,157,011	17,090,329,379

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2019年4月13日 至 2019年10月15日	当期 自 2019年10月16日 至 2020年4月13日
営業収益		
受取配当金	446,375,579	405,934,732
受取利息	881	-

	前期 自 2019年 4月13日 至 2019年10月15日	当期 自 2019年10月16日 至 2020年 4月13日
有価証券売買等損益	1,284,586,496	1,693,889,014
営業収益合計	838,210,036	1,287,954,282
営業費用		
支払利息	77,147	37,052
受託者報酬	4,690,000	4,230,662
委託者報酬	73,043,512	63,819,281
その他費用	3,298,384	3,144,235
営業費用合計	81,109,043	71,231,230
営業利益又は営業損失（ ）	919,319,079	1,359,185,512
経常利益又は経常損失（ ）	919,319,079	1,359,185,512
当期純利益又は当期純損失（ ）	919,319,079	1,359,185,512
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（ ）	1,755,105	6,752,145
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	82,658,878,806	81,583,614,844
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,592,739,927	6,827,657,125
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,592,739,927	6,827,657,125
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,353,020,321	2,445,615,896
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,353,020,321	2,445,615,896
分配金	1,246,891,670	1,183,091,594
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	81,583,614,844	79,737,098,576

(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当該投資信託受益証券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当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月13日から翌月12日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当特定期間は2019年10月16日から2020年 4月13日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	前期 2019年10月15日現在	当期 2020年 4月13日現在
1. 期首元本額	106,149,714,245円	102,058,092,017円
期中追加設定元本額	2,970,928,122円	3,035,136,876円
期中一部解約元本額	7,062,550,350円	8,482,915,224円
2. 受益権の総数	102,058,092,017口	96,610,313,669口
3. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	81,583,614,844円	79,737,098,576円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 2019年 4月13日 至 2019年10月15日		当期 自 2019年10月16日 至 2020年 4月13日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2019年 4月13日 至 2019年 5月13日		自 2019年10月16日 至 2019年11月12日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 62,199,030円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 65,690,040円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金 12,185,443,149円	C	信託約款に定める収益調整金 11,922,935,366円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 11,147,506,038円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 9,529,527,869円
E	分配対象収益（A+B+C+D） 23,395,148,217円	E	分配対象収益（A+B+C+D） 21,518,153,275円
F	分配対象収益(1万口当たり) 2,216円	F	分配対象収益(1万口当たり) 2,134円
G	分配金額 211,101,722円	G	分配金額 201,583,636円
H	分配金額(1万口当たり) 20円	H	分配金額(1万口当たり) 20円
自 2019年 5月14日 至 2019年 6月12日		自 2019年11月13日 至 2019年12月12日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 62,594,452円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 56,824,403円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金 12,215,973,970円	C	信託約款に定める収益調整金 11,844,846,441円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 10,885,600,637円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 9,239,062,955円
E	分配対象収益（A+B+C+D） 23,164,169,059円	E	分配対象収益（A+B+C+D） 21,140,733,799円
F	分配対象収益(1万口当たり) 2,202円	F	分配対象収益(1万口当たり) 2,120円
G	分配金額 210,350,543円	G	分配金額 199,383,051円
H	分配金額(1万口当たり) 20円	H	分配金額(1万口当たり) 20円
自 2019年 6月13日 至 2019年 7月12日		自 2019年12月13日 至 2020年 1月14日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 70,512,017円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 66,030,491円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金 12,153,510,955円	C	信託約款に定める収益調整金 11,778,208,057円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 10,602,659,439円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 8,963,564,644円
E	分配対象収益（A+B+C+D） 22,826,682,411円	E	分配対象収益（A+B+C+D） 20,807,803,192円
F	分配対象収益(1万口当たり) 2,189円	F	分配対象収益(1万口当たり) 2,107円
G	分配金額 208,539,049円	G	分配金額 197,482,345円
H	分配金額(1万口当たり) 20円	H	分配金額(1万口当たり) 20円
自 2019年 7月13日 至 2019年 8月13日		自 2020年 1月15日 至 2020年 2月12日	

A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	60,017,168円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	55,522,486円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	12,118,292,847円	C	信託約款に定める収益調整金	11,752,276,770円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	10,354,909,235円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	8,731,190,985円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	22,533,219,250円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	20,538,990,241円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,174円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,092円
G	分配金額	207,202,615円	G	分配金額	196,266,715円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 2019年 8月14日 至 2019年 9月12日			自 2020年 2月13日 至 2020年 3月12日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	70,751,227円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	55,055,377円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	12,076,050,483円	C	信託約款に定める収益調整金	11,731,935,762円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	10,075,365,112円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	8,495,597,244円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	22,222,166,822円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	20,282,588,383円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,161円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,078円
G	分配金額	205,581,557円	G	分配金額	195,155,220円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円
	自 2019年 9月13日 至 2019年10月15日			自 2020年 3月13日 至 2020年 4月13日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	66,383,643円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	53,848,131円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	12,035,184,597円	C	信託約款に定める収益調整金	11,658,451,332円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	9,824,527,052円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	8,229,865,804円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	21,926,095,292円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	19,942,165,267円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,148円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,064円
G	分配金額	204,116,184円	G	分配金額	193,220,627円
H	分配金額(1万口当たり)	20円	H	分配金額(1万口当たり)	20円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2019年 4月13日 至 2019年10月15日	当期 自 2019年10月16日 至 2020年 4月13日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 2019年10月15日現在	当期 2020年 4月13日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」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 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期(2019年10月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
----	---------------------

投資信託受益証券	113,798,787
親投資信託受益証券	1
合計	113,798,786

当期(2020年4月13日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	180,466,104
親投資信託受益証券	1
合計	180,466,105

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 2019年10月15日現在	当期 2020年4月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.2006円 (2,006円)
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
	0.1747円 (1,747円)

(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

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	マルチカレンシーファンド クラスB	128,904,359,772	16,628,662,410	
投資信託受益証券 合計		128,904,359,772	16,628,662,410	

親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	16,433,216	16,684,644	
親投資信託受益証券 合計		16,433,216	16,684,644	
合計		128,920,792,988	16,645,347,054	

(注)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。

当ファンドは、「マルチカレンシーファンド クラスB」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同投資信託の財務書類は2020年1月15日提出の有価証券報告書に記載されております。

また、当ファンドは、「マネー・マーケット・マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2019年10月15日現在	2020年 4月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	31,365,739	26,138,095
流動資産合計	31,365,739	26,138,095
資産合計	31,365,739	26,138,095
負債の部		
流動負債		
未払解約金	197,470	144,145
未払利息	6	10
流動負債合計	197,476	144,155
負債合計	197,476	144,155
純資産の部		
元本等		
元本	30,695,167	25,602,385
剰余金		
剰余金又は欠損金()	473,096	391,555
元本等合計	31,168,263	25,993,940
純資産合計	31,168,263	25,993,940
負債純資産合計	31,365,739	26,138,095

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）

		2019年10月15日現在	2020年 4月13日現在
1.	期首	2019年 4月13日	2019年10月16日
	期首元本額	34,871,001円	30,695,167円
	期首からの追加設定元本額	2,253円	234,054円
	期首からの一部解約元本額	4,178,087円	5,326,836円
	元本の内訳		
	ピムコ・ハイイールド・ファンド Aコース（為替ヘッジなし）	6,087,790円	5,063,022円
	ピムコ・ハイイールド・ファンド Bコース（為替ヘッジあり）	1,563,098円	1,339,110円
	世界のサイフ	19,768,989円	16,433,216円
	グローバル・カレンシー・ファンド（毎月決算型）	3,124,919円	2,639,701円
	世界のサイフ（資産成長型）	150,371円	127,336円
	計	30,695,167円	25,602,385円
2.	受益権の総数	30,695,167口	25,602,385口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2019年 4月13日 至 2019年10月15日	自 2019年10月16日 至 2020年 4月13日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左
----------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

	2019年10月15日現在	2020年 4月13日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 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 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2019年10月15日現在		2020年 4月13日現在	
1口当たり純資産額	1.0154円	1口当たり純資産額	1.0153円
(1万口当たり純資産額)	(10,154円)	(1万口当たり純資産額)	(10,153円)

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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 4月30日現在です。

【世界のサイフ】

【純資産額計算書】

資産総額	16,617,994,535円
負債総額	14,360,511円
純資産総額（ - ）	16,603,634,024円
発行済口数	96,796,061,791口
1口当たり純資産額（ / ）	0.1715円

（参考）

マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	26,365,088円
負債総額	35円
純資産総額（ - ）	26,365,053円
発行済口数	25,968,321口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0153円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2020年4月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減 : 該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関(2020年4月末現在)

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス(2020年4月末現在)

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

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なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2020年4月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	836	191,191
株式投資信託	785	162,594
単位型	271	10,814
追加型	514	151,780
公社債投資信託	51	28,596
単位型	38	1,119
追加型	13	27,476

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 当社の財務諸表は、「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。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第61期事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3	20,680
有価証券		1
前払費用		495
未収入金		38
未収委託者報酬		16,867
未収収益	3	618
関係会社短期貸付金		2,408
立替金		791
その他	2	869
流動資産合計	42,769	48,679
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	136
器具備品	1	137
有形固定資産合計	274	318
無形固定資産		

ソフトウェア	107	120
無形固定資産合計	107	120
投資その他の資産		
投資有価証券	16,755	17,826
関係会社株式	25,769	25,769
長期差入保証金	447	484
繰延税金資産	1,913	2,022
投資その他の資産合計	44,886	46,102
固定資産合計	45,268	46,540
資産合計	88,038	95,220

(単位：百万円)

	第60期 (2019年3月31日)		第61期 (2020年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金	354		554
未払金	6,112		5,881
未払収益分配金	7		8
未払償還金	71		71
未払手数料	3	5,299	5,202
その他未払金		734	599
未払費用	3	3,897	3
未払法人税等		2,382	1,439
未払消費税等	4	621	4
賞与引当金		2,680	2,718
役員賞与引当金		210	55
その他	3	172	42
流動負債合計		16,431	15,726
固定負債			
退職給付引当金		1,405	1,395
その他		629	695
固定負債合計		2,035	2,091
負債合計		18,466	17,818
純資産の部			
株主資本			
資本金		17,363	17,363
資本剰余金			
資本準備金		5,220	5,220
資本剰余金合計		5,220	5,220
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		47,142	55,395
利益剰余金合計		47,142	55,395
自己株式		833	905
株主資本合計		68,891	77,073

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	493	60
繰延ヘッジ損益	185	389
評価・換算差額等合計	679	329
純資産合計	69,571	77,402
負債純資産合計	88,038	95,220

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	77,264	74,265
その他営業収益	3,063	2,994
営業収益合計	80,328	77,259
営業費用		
支払手数料	32,834	31,322
広告宣伝費	960	953
公告費	2	2
調査費	18,251	17,275
調査費	890	920
委託調査費	17,333	16,333
図書費	27	21
委託計算費	541	534
営業雑経費	794	1,058
通信費	128	116
印刷費	334	337
協会費	69	52
諸会費	19	10
その他	243	541
営業費用計	53,385	51,148
一般管理費		
給料	9,783	9,857
役員報酬	241	360
役員賞与引当金繰入額	210	55
給料・手当	6,589	6,675
賞与	61	64
賞与引当金繰入額	2,680	2,702
交際費	92	92
寄付金	13	29
旅費交通費	476	420
租税公課	428	440
不動産賃借料	888	901
退職給付費用	378	387
退職金	52	82
固定資産減価償却費	108	118
福利費	1,071	1,014
諸経費	3,106	3,229
一般管理費計	16,401	16,573
営業利益	10,540	9,538

(単位：百万円)

	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業外収益			
受取利息		37		99
受取配当金	1	1,865	1	4,881
有価証券償還益		1		-
デリバティブ収益	1	142		223
時効成立分配金・償還金		21		1
為替差益		58		5
その他		48		145
営業外収益合計		2,176		5,357
営業外費用				
支払利息	1	286		185
有価証券償還損		-		0
時効成立後支払分配金・償還金		78		1
その他		24		12
営業外費用合計		388		199
経常利益		12,328		14,695
特別利益				
投資有価証券売却益		218		164
特別利益合計		218		164
特別損失				
投資有価証券売却損		176		19
投資有価証券評価損		-		21
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		180		-
特別損失合計		357		41
税引前当期純利益		12,189		14,818
法人税、住民税及び事業税		3,741		3,307
法人税等調整額		375		45
法人税等合計		3,366		3,353
当期純利益		8,823		11,465

(3) 【株主資本等変動計算書】

第60期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		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		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756
当期変動額							

剰余金の配当				1,640	1,640		1,640
当期純利益				8,823	8,823		8,823
自己株式の取得						47	47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	7,182	7,182	47	7,135
当期末残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	408	346	754	62,511
当期変動額				
剰余金の配当				1,640
当期純利益				8,823
自己株式の取得				47
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	85	160	75	75
当期変動額合計	85	160	75	7,060
当期末残高	493	185	679	69,571

第61期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	47,142	47,142	833	68,891
当期変動額							
剰余金の配当				3,212	3,212		3,212
当期純利益				11,465	11,465		11,465
自己株式の取得						71	71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	8,252	8,252	71	8,181
当期末残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	905	77,073

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	493	185	679	69,571
当期変動額				
剰余金の配当				3,212
当期純利益				11,465

自己株式の取得				71
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	553	204	349	349
当期変動額合計	553	204	349	7,831
当期末残高	60	389	329	77,402

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算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、総平均法により算定) 時価のないもの 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(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退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>				

4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(未適用の会計基準等)

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・ 「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
 ステップ2：契約における履行義務を識別する。
 ステップ3：取引価格を算定する。
 ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
 ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

(貸借対照表関係)

第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,281百万円</p> <p>器具備品 655百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,311百万円</p> <p>器具備品 707百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 1,347百万円</p> <p>未収収益 127百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 350百万円</p> <p>未払費用 767百万円</p> <p>その他 162百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務468百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 151百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 623百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務365百万円に対して保証を行っております。</p>
---	---

(損益計算書関係)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 1,831百万円</p> <p>デリバティブ収益 54百万円</p> <p>支払利息 75百万円</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 4,849百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,301,700	64,000	-	1,365,700

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年 度期首	当事業年 度増加	当事業年 度減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,494,900	-	323,400	1,171,500	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	108,900	-	33,000	75,900	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,686,200	-	630,300	2,055,900	-

2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	-	3,618,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,877,000	-	66,000	3,811,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,422,000	66,000	4,356,000	-
合計		11,785,000	4,422,000	1,118,700	15,088,300	-

- (注) 1 2017年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。
2 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
3 2009年度ストックオプション(1)1,171,500株、2009年度ストックオプション(2)75,900株、2011年度ストックオプション(1)2,055,900株及び2016年度ストックオプション(1)1,206,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)2,412,000株、2016年度ストックオプション(2)及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 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 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年5月31日 取締役会	普通株式	1,640	8.38	2018年3月31日	2018年6月23日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	1,365,700	88,800	-	1,454,500

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
2009年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,171,500	-	1,171,500	-	-
2009年度 ストックオプション(2)	普通株式	75,900	-	75,900	-	-
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,055,900	-	871,200	1,184,700	-
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	3,618,000	-	2,272,000	1,346,000	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	3,811,000	-	1,417,000	2,394,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,356,000	-	1,417,000	2,939,000	-
合計		15,088,300	-	7,224,600	7,863,700	-

- (注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
- 2 2011年度ストックオプション(1)1,184,700株、2016年度ストックオプション(1)881,000株及び2016年度ストックオプション(2)804,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、2016年度ストックオプション(1)465,000株、2016年度ストックオプション(2)1,590,000株及び2017年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 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 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年5月28日 取締役会	普通株式	3,212	16.42	2019年3月31日	2019年6月24日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月12日 取締役会	普通株式	利益剰余金	2,862	14.64	2020年3月31日	2020年7月1日

(リース取引関係)

第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	853百万円	1年内	912百万円
1年超	6,704百万円	1年超	6,148百万円
合計	7,558百万円	合計	7,060百万円

(金融商品関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ - ドマネ - の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ

会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金(未払手数料)、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日でありませぬ。未払金(未払手数料)については、債権(未収委託者報酬)を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりませぬ。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金及び借入金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性(最低限必要な運転資金)を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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、次表には含めておりませぬ。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	20,680	20,680	-
(2) 未収委託者報酬	16,867	16,867	-
(3) 未収収益	618	618	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,408	2,408	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,740	16,740	-
(6) 未払金	(6,112)	(6,112)	-
(7) 未払費用	(3,897)	(3,897)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(31)	(31)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(127)	(127)	-
デリバティブ取引計	(158)	(158)	-

- (1)負債に計上されているものについては、()で示しております。
(2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

- (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

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

- (5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

- (6) 未払金及び(7) 未払費用

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

- (8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち3百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、35百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち0百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、127百万円は流動負債のその他に含まれております。

- 2 非上場株式等（貸借対照表計上額16百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

- 3 子会社株式（貸借対照表計上額22,876百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

- 4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	20,680	-	-	-
未収委託者報酬	16,867	-	-	-
未収収益	618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	163	6,929	1,363
合計	38,167	163	6,929	1,363

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債

権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシ・ドマネ・の投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「4 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金(未払手数料)、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金(未払手数料)については、債権(未収委託者報酬)を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュ・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性(最低限必要な運転資金)を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

2020年3月31日(当事業年度の決算日)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	24,591	24,591	-
(2) 未収委託者報酬	16,912	16,912	-
(3) 未収収益	1,412	1,412	-
(4) 関係会社短期貸付金	2,371	2,371	-
(5) 有価証券及び投資有価証券			

その他有価証券	17,828	17,828	-
(6) 未払金	(5,881)	(5,881)	-
(7) 未払費用	(4,289)	(4,289)	-
(8) デリバティブ取引(2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	167	167	-
デリバティブ取引計	142	142	-

(1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、ヘッジ会計が適用されていないもののうち15百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、41百万円は流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されているもののうち167百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額16百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額22,876百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	24,591	-	-	-
未収委託者報酬	16,912	-	-	-
未収収益	1,412	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	149	8,709	29
合計	42,936	149	8,709	29

(有価証券関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	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	投資信託	9,340	8,440	900
	小計	9,340	8,440	900
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,400	7,589	188
	小計	7,400	7,589	188
合計		16,740	16,029	711

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	4,189	218	176
合計	4,189	218	176

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	22,876
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	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	投資信託	5,381	4,912	469
	小計	5,381	4,912	469
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	12,447	13,003	556
	小計	12,447	13,003	556
合計		17,828	17,915	86

- (注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度において、有価証券について21百万円(その他有価証券の投資信託)減損処理を行っております。
- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	2,230	164	19
合計	2,230	164	19

(デリバティブ取引関係)

第60期(2019年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,407	-	3	3
	買建	-	-	-	-
合計		2,407	-	3	3

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	1,792	-	35	35
合計		1,792	-	35	35

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル		2,251	-	42
	豪ドル		63	-	0
	シンガポール ドル	投資有価証券	975	-	18

	香港ドル		518	-	8
	人民元		2,149	-	58
	ユーロ		81	-	0
合計			6,040	-	127

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第61期(2020年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	1,913	-	41	41
	買建	-	-	-	-
合計		1,913	-	41	41

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	1,808	-	15	15
合計		1,808	-	15	15

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		3,427	-	20
	豪ドル		48	-	9
	シンガポール ドル		944	-	58
	香港ドル		529	-	2
	人民元		2,017	-	76
	ユーロ		70	-	1
合計			7,038	-	167

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（持分法損益等）

第60期 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	第61期 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円）	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 （単位：百万円）
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,002
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,668	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 10,485
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,704	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,631

（退職給付関係）

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,313
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,411

(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

退職給付債務	1,411
未積立退職給付債務	1,411
未認識数理計算上の差異	6
貸借対照表に計上された負債の額	1,405
退職給付引当金	1,405
貸借対照表に計上された負債の額	1,405

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	148

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.1%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、230百万円でありました。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,411
勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の発生額	31
退職給付の支払額	164
退職給付債務の期末残高	1,363

(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

退職給付債務	1,363
未積立退職給付債務	1,363
未認識数理計算上の差異	31
貸借対照表に計上された負債の額	1,395
退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	147
利息費用	1
数理計算上の差異の費用処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用	154

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.2%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、233百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日

権利確定条件	2012年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、「当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、「当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、「当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日

権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,494,900	108,900
付与	0	0
失効	323,400	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,171,500	75,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,686,200	3,618,000
付与	0	0
失効	630,300	0
権利確定	0	0
権利未確定残	2,055,900	3,618,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-

権利未行使残	-	-
--------	---	---

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,877,000	-
付与	0	4,422,000
失効	66,000	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	3,811,000	4,356,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額）の見積りに
よっております。
- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 2,128百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割
又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開
日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定条件	2012年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	2012年1月22日から 2020年1月21日まで	同左

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日

権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利確定前(株)		
期首	1,171,500	75,900
付与	0	0
失効	1,171,500	75,900
権利確定	0	0
権利未確定残	-	-
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,055,900	3,618,000
付与	0	0
失効	871,200	2,272,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,184,700	1,346,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-

権利未行使残	-	-
--------	---	---

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	3,811,000	4,356,000
付与	0	0
失効	1,417,000	1,417,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,394,000	2,939,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2009年度ストックオプション(1)	2009年度ストックオプション(2)
付与日	2010年2月8日	2010年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,633百万円
 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
----------------------	----------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)	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：百万円)
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	820	賞与引当金	822
投資有価証券評価損	96	投資有価証券評価損	102
関係会社株式評価損	1,430	関係会社株式評価損	1,430
退職給付引当金	430	退職給付引当金	427
固定資産減価償却費	103	固定資産減価償却費	96
その他	761	その他	744
繰延税金資産小計	3,643	繰延税金資産小計	3,624
評価性引当金	1,430	評価性引当金	1,430
繰延税金資産合計	2,212	繰延税金資産合計	2,194
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	217	繰延ヘッジ利益	172
繰延ヘッジ利益	81	繰延税金負債合計	172
繰延税金負債合計	299	繰延税金資産の純額	2,022
繰延税金資産の純額	1,913		
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		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	30.6%	法定実効税率	30.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.8%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%
受取配当金等永久に益金に参入されない項目	4.4%	受取配当金等永久に益金に参入されない項目	9.6%
その他	0.6%	その他	1.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.6%

(関連当事者情報)

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
							資金の貸付の返済(シンガポールドル貨建)(注1)	554(SGD千)(注2) 6,800	-	-

子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	貸付金利息 (シンガポールドル 貸建) (注1)	8 (SGD 104 千)	-	-
							資金の貸付 (米国ドル 貸建) (注3)	1,807 (USD 16,500 千) (注4)	関係会社 短期 貸付金	1,830 (USD 16,500 千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注3)	17 (USD 209 千)	未収収益	17 (USD 209 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注3)	-	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注3)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 5)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	1,021 (USD 9,000 千)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	米国	181,542 (USD 千) (注 5)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入 (米国ドル 貸建) (注6)	5,364 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							資金の借入 の返済 (米国ドル 貸建) (注6)	5,526 (USD 50,000 千) (注7)	-	-
							借入金利息 (米国ドル 貸建) (注6)	65 (USD 593 千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 取引金額554百万円 (SGD6,800千) の内訳は、貸付の返済554百万円 (SGD6,800千) であります。
- 融資枠5,000百万円 (若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 取引金額1,807百万円 (USD16,500千) の内訳は、貸付1,807百万円 (USD16,500千) であります。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.及びNikko Asset Management Americas, Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 借入枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 取引金額5,364百万円 (USD50,000千) 及び5,526百万円 (USD50,000千) の内訳は、借入5,364百万円 (USD50,000千) 及び借入の返済5,526百万円 (USD50,000千) であります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

- 三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)
三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	26,768百万円
負債合計	5,586百万円
純資産合計	21,181百万円
営業収益	14,075百万円
税引前当期純利益	3,894百万円
当期純利益	2,730百万円

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	342,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(米国ドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	1,793 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	86 (USD 798千)	未収収益	13 (USD 122千)
							資金の貸付(円貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千)(注2)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	1,526 (USD 14,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	1,550 (百万円)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	2,700	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 資枠5,000百万円(若しくは5,000百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2019年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	28,121百万円
負債合計	5,242百万円
純資産合計	22,879百万円

営業収益	14,853百万円
税引前当期純利益	4,354百万円
当期純利益	3,194百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第60期(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

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載してありません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第60期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

第61期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	355円59銭	395円50銭
1株当たり当期純利益金額	45円08銭	58円61銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載してありません。

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。

項目	第60期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第61期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	8,823	11,465
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	8,823	11,465
普通株式の期中平均株式数(千株)	195,677	195,599

希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2009年度ストックオプション(1) 1,171,500株、2009年度ストックオプション(2) 75,900株、2011年度ストックオプション(1) 2,055,900株、2016年度ストックオプション(1) 3,618,000株、2016年度ストックオプション(2) 3,811,000株、2017年度ストックオプション(1) 4,356,000株	2011年度ストックオプション(1) 1,184,700株、2016年度ストックオプション(1) 1,346,000株、2016年度ストックオプション(2) 2,394,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,939,000株
--	--	---

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第60期 (2019年3月31日)	第61期 (2020年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	69,571	77,402
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	69,571	77,402
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	195,647	195,558

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額 : 10,000百万円(2019年9月末現在)

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(日本マスタートラスト信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2019年9月末現在)	事業の内容
藍澤証券株式会社	8,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067百万円 (2019年3月末現在)	
池田泉州T T証券株式会社	1,250百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
九州F G証券株式会社	3,000百万円	
ぐんぎん証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
日産証券株式会社	15億円 (2019年6月27日現在)	
野村証券株式会社	10,000百万円	
浜銀T T証券株式会社	3,307百万円 (2019年6月25日現在)	
フィデリティ証券株式会社	9,257百万円 (2019年3月末現在)	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
みずほ証券株式会社 1	125,167百万円	
めぶき証券株式会社	3,000百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社あおぞら銀行 1	100,000百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社鹿児島銀行	18,130百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社京都銀行	42,103百万円	
株式会社きらやか銀行	22,700百万円	
株式会社熊本銀行	33,847百万円	
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	

株式会社ジャパンネット銀行	37,250百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社十八銀行	24,404百万円	
株式会社新生銀行	512,204百万円	
株式会社親和銀行	36,878百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社南都銀行	37,924百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社豊和銀行	12,495百万円	
株式会社北越銀行	24,538百万円	
株式会社北海道銀行	93,524百万円	
株式会社北國銀行	26,673百万円	
株式会社みなと銀行	27,484百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社横浜銀行	215,628百万円	
株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社 1	342,037百万円	
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
近畿産業信用組合	27,528百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
全国信用協同組合連合会	107,275百万円 (出資の総額)	
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

3【資本関係】

< 更新後 >

(2) 販売会社

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2020年5月20日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PWCあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴司
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界のサイフの2019年10月16日から2020年4月13日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界のサイフの2020年4月13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。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表

に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

日興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. X B R 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6月8日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞 廣 篤 典指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興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61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記は、当社が、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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。