





































































































































- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間（令和1年11月26日から令和2年5月25日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。







## (中間貸借対照表に関する注記)

| 項目                                 | 第3期<br>令和1年11月25日現在                               | 第4期中間計算期間末<br>令和2年5月25日現在                        |
|------------------------------------|---|--|
| 1. 期首元本額<br>期中追加設定元本額<br>期中一部解約元本額 | 29,351,309,122円<br>76,985,726円<br>12,186,101,826円 | 17,242,193,022円<br>33,231,412円<br>3,731,655,534円 |
| 2. 受益権の総数                          | 17,242,193,022口                                   | 13,543,768,900口                                  |
| 3. 元本の欠損                           | -   | 純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,618,635,350円であります。       |

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。















2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえ、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

### 3【委託会社等の経理状況】

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



























3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

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















2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ  
(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。



















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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。