

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年9月17日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【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】	新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコー ス 新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコー ス 新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルレ アルコース 新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープ ールファンド
【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】	新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコー ス 3兆円を上限とします。 新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコー ス 3兆円を上限とします。 新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルレ アルコース 3兆円を上限とします。 新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープ ールファンド 3兆円を上限とします。
【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】

2020年6月25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。)について、「新光グローバル・ハイイールド債券ファンド」を構成するファンドのうち、「新光グローバル・ハイイールド債券ファンドメキシコペソコース」および「新光グローバル・ハイイールド債券ファンドトルコリラコース」が2020年9月25日付で満期償還することおよび再信託先商号変更により、記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

<訂正前>

ファンドの正式名称	略 称	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース	米ドルコース	各通貨 コース
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース	豪ドルコース	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース	ブラジルリアルコース	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドメキシコペソコース	メキシコペソコース	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドトルコリラコース	トルコリラコース	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド	マネープールファンド	

それぞれのファンドを「ファンド」または「当ファンド」あるいは「各ファンド」という場合があります。また、ファンドについて、それぞれ上記に対応する表中の略称を使用する場合、「米ドルコース」「豪ドルコース」「ブラジルリアルコース」「メキシコペソコース」「トルコリラコース」を総称して「各通貨コース」という場合があります。

(略)

<訂正後>

ファンドの正式名称	略 称	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース	米ドルコース	各通貨 コース
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース	豪ドルコース	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース	ブラジルリアルコース	
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド	マネープールファンド	

それぞれのファンドを「ファンド」または「当ファンド」あるいは「各ファンド」という場合があります。また、ファンドについて、それぞれ上記に対応する表中の略称を使用する場合、「米ドルコース」「豪ドルコース」「ブラジルリアルコース」を総称して「各通貨コース」という場合があります。

(略)

(7) 【申込期間】

<訂正前>

<米ドルコース、豪ドルコース、ブラジルリアルコース、マネープールファンド>

2020年6月26日から2020年12月25日までです。

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

<メキシコペソコース、トルコリラコース>

2020年6月26日から2020年9月16日までです。

各ファンドの信託期間は2020年9月25日までとなっております。お申込みの際には信託期間にご留意ください。

<訂正後>

2020年6月26日から2020年12月25日までです。

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

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】

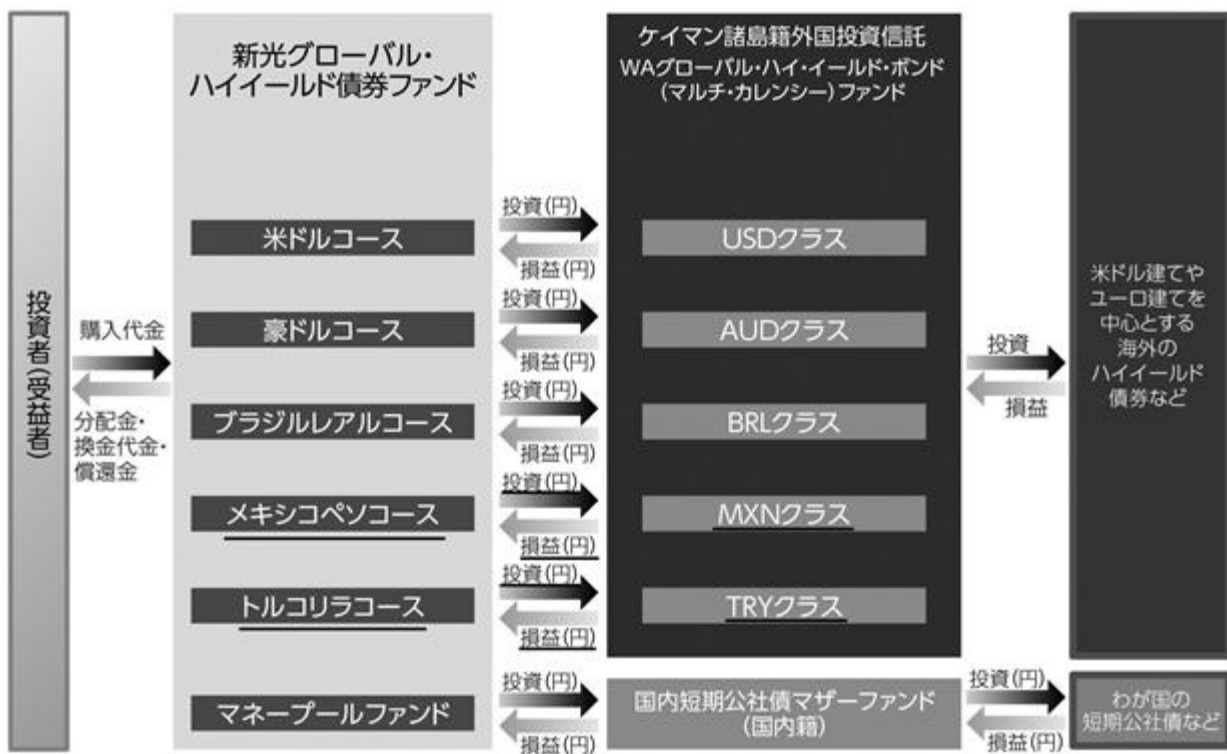
<訂正前>

a. ファンドの目的及び基本的性格

(略)

ファンドの仕組み

(略)



(略)

b. ファンドの特色

(略)

2 投資対象とする外国投資信託における為替取引の対象通貨の違いにより、6つの通貨コースとその他にマネープールファンドがあります。また、各通貨コースおよびマネープールファンド間でのスイッチングが可能です。

- 通貨コースは円コース、米ドルコース、豪ドルコース、ブラジルリアルコース、メキシコペソコース、トルコリラコースの6コースから選択できます。

※各通貨コースの信託期間は、円コース、米ドルコース、豪ドルコース、ブラジルリアルコースが2025年9月25日まで、メキシコペソコース、トルコリラコースが2020年9月25日までとなります。信託期間が異なりますのでご注意ください。

- 各通貨コースが投資対象とする外国投資信託では、原則として投資対象資産の発行通貨を売り予約し、各通貨コースの対象通貨を買い予約する為替取引を行います。

(略)

■ 分配方針

【各通貨コース】

原則として、毎月25日(休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



- ◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

●円コース/米ドルコース/豪ドルコース/ブラジルリアルコース

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に安定した分配を行うことを目標に委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

「原則として、利子・配当等収益を中心に安定分配を行う」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移することなどを示唆するものではありません。また、基準価額水準、運用の状況などによっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。

●メキシコペソコース/トルコリラコース*

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

*メキシコペソコースとトルコリラコース(2013年6月21日設定)の分配方針の記載は、2012年6月1日より実施された一般社団法人投資信託協会によるルールに則ったものであり、実質的に他の通貨コースの分配方針と異なるものではありません。

- ◆上記にかかる分配金額のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。

(略)

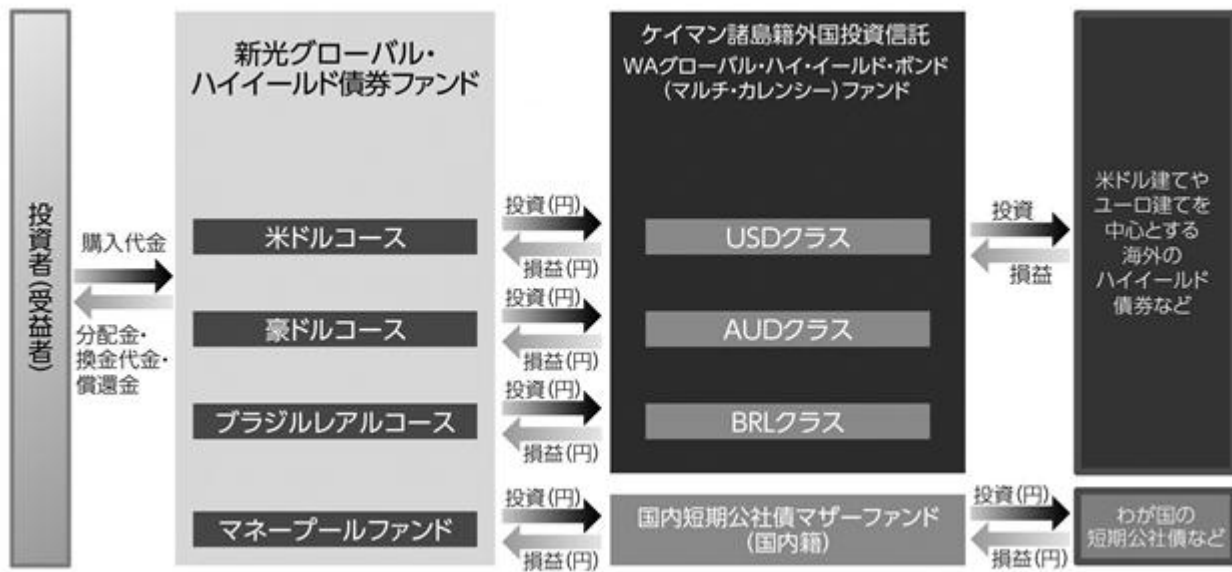
< 訂正後 >

a. ファンドの目的及び基本的性格

(略)

ファンドの仕組み

(略)



(略)

b. ファンドの特色

(略)

2 投資対象とする外国投資信託における為替取引の対象通貨の違いにより、4つの通貨コースとその他にマネープールファンドがあります。また、各通貨コースおよびマネープールファンド間でのスイッチングが可能です。

- 通貨コースは円コース、米ドルコース、豪ドルコース、ブラジルリアルコースの4コースから選択できます。
- 各通貨コースが投資対象とする外国投資信託では、原則として投資対象資産の発行通貨を売り予約し、各通貨コースの対象通貨を買い予約する為替取引を行います。

(略)

■ 分配方針

【各通貨コース】

原則として、毎月25日(休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



- ◆分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。
分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に安定した分配を行うことを目標に委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
[原則として、利子・配当等収益を中心に安定分配を行う]方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移することなどを示唆するものではありません。また、基準価額水準、運用の状況などによっては安定分配とならない場合があることにご留意ください。
- ◆上記にかかる分配金額のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。

(略)

(2) 【ファンドの沿革】

<訂正前>

<米ドルコース/豪ドルコース/ブラジルリアルコース/マネーボールファンド>

2010年10月8日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年6月25日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2015年6月23日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2019年12月26日	信託期間を2025年9月25日までに変更

<メキシコペソコース/トルコリラコース>

2013年6月21日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年6月25日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2015年6月23日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

<訂正後>

2010年10月8日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年6月25日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2015年6月23日	ファンドの名称にかかる約款変更の届出を提出
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2019年12月26日	信託期間を2025年9月25日までに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

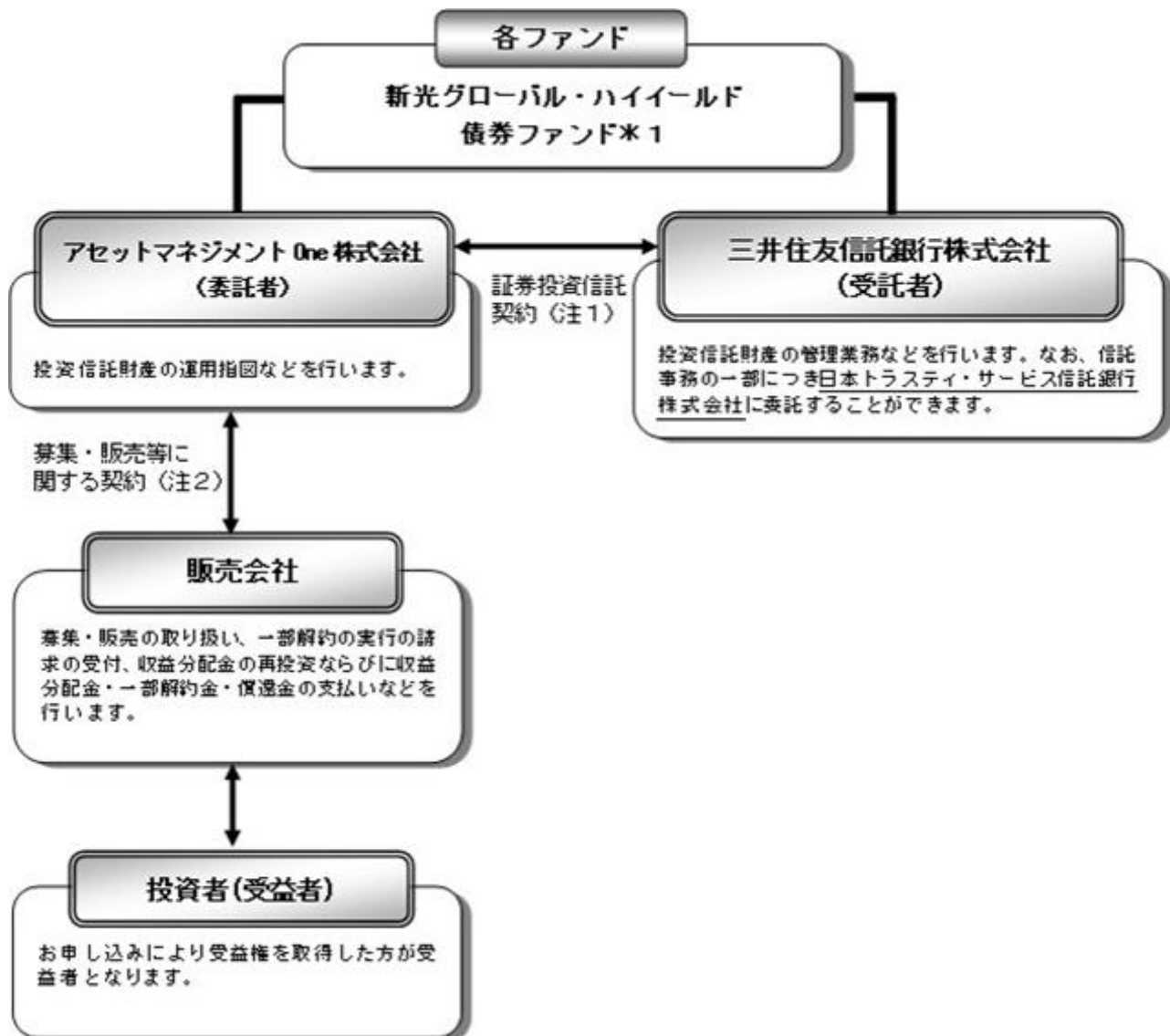
<訂正前>

a. ファンドの仕組み

<各通貨コース>

図中の* 1、* 2には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

* 1	米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	メキシコペソコース	トルコリラコース
* 2	USDクラス	AUDクラス	BRLクラス	MXNクラス	TRYクラス



(注1) 証券投資信託契約

委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

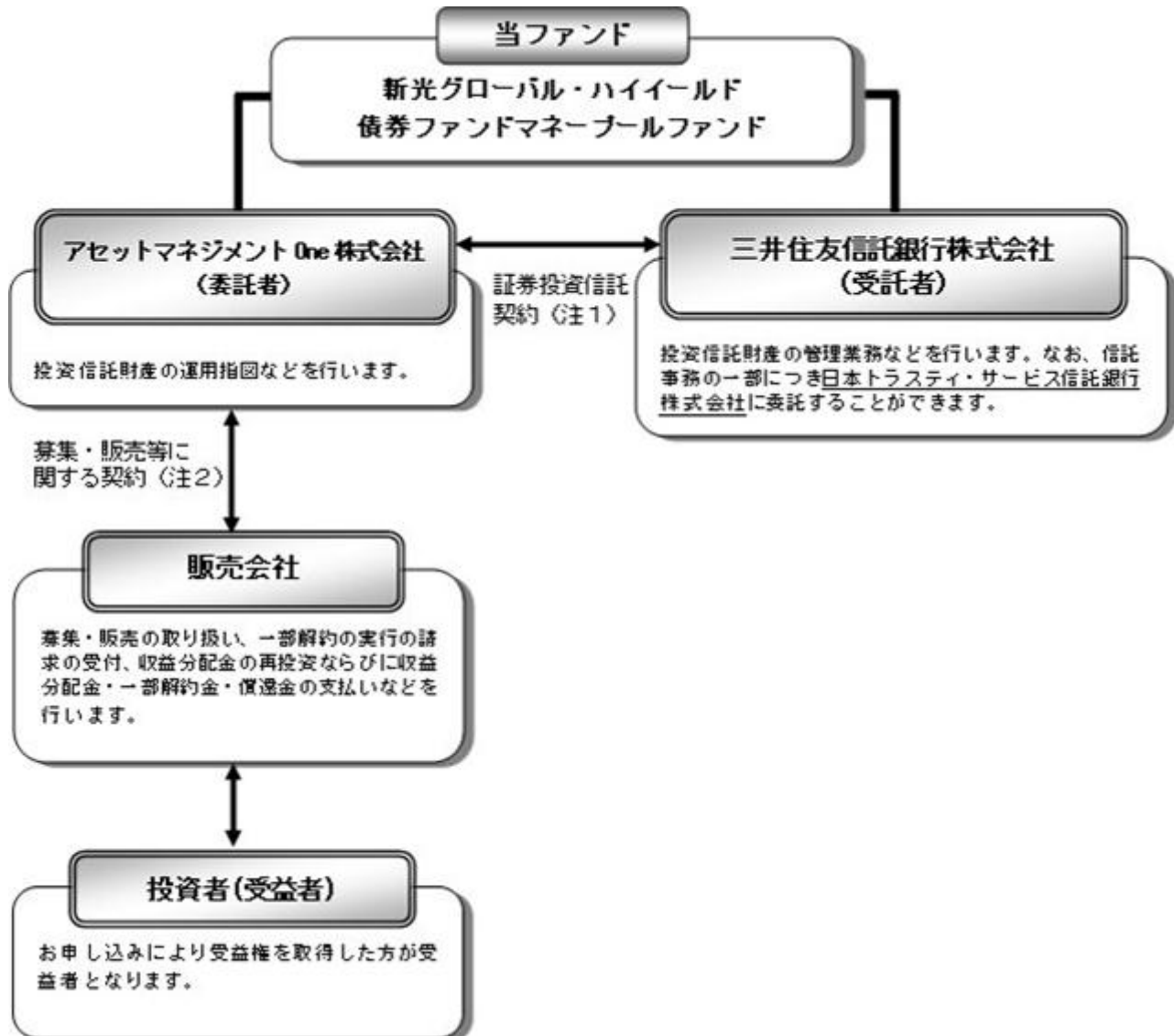
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。（以下同じ）

（注2）募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

（略）

<マネープールファンド>



（略）

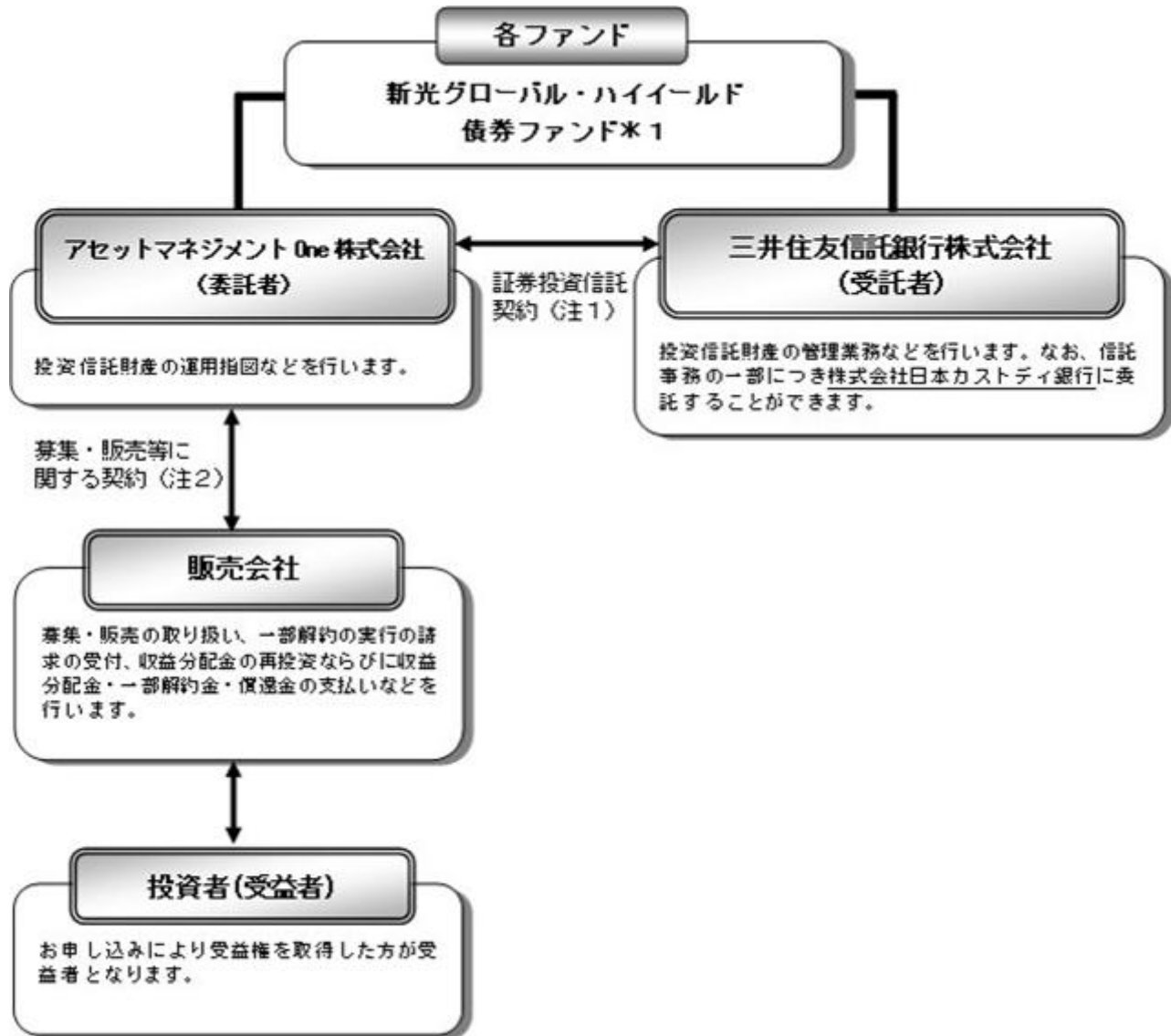
< 訂正後 >

a. ファンドの仕組み

< 各通貨コース >

図中の* 1、* 2には次の表よりそれぞれあてはめてご覧ください。

* 1	米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース
* 2	USDクラス	AUDクラス	BRLクラス



(注1) 証券投資信託契約

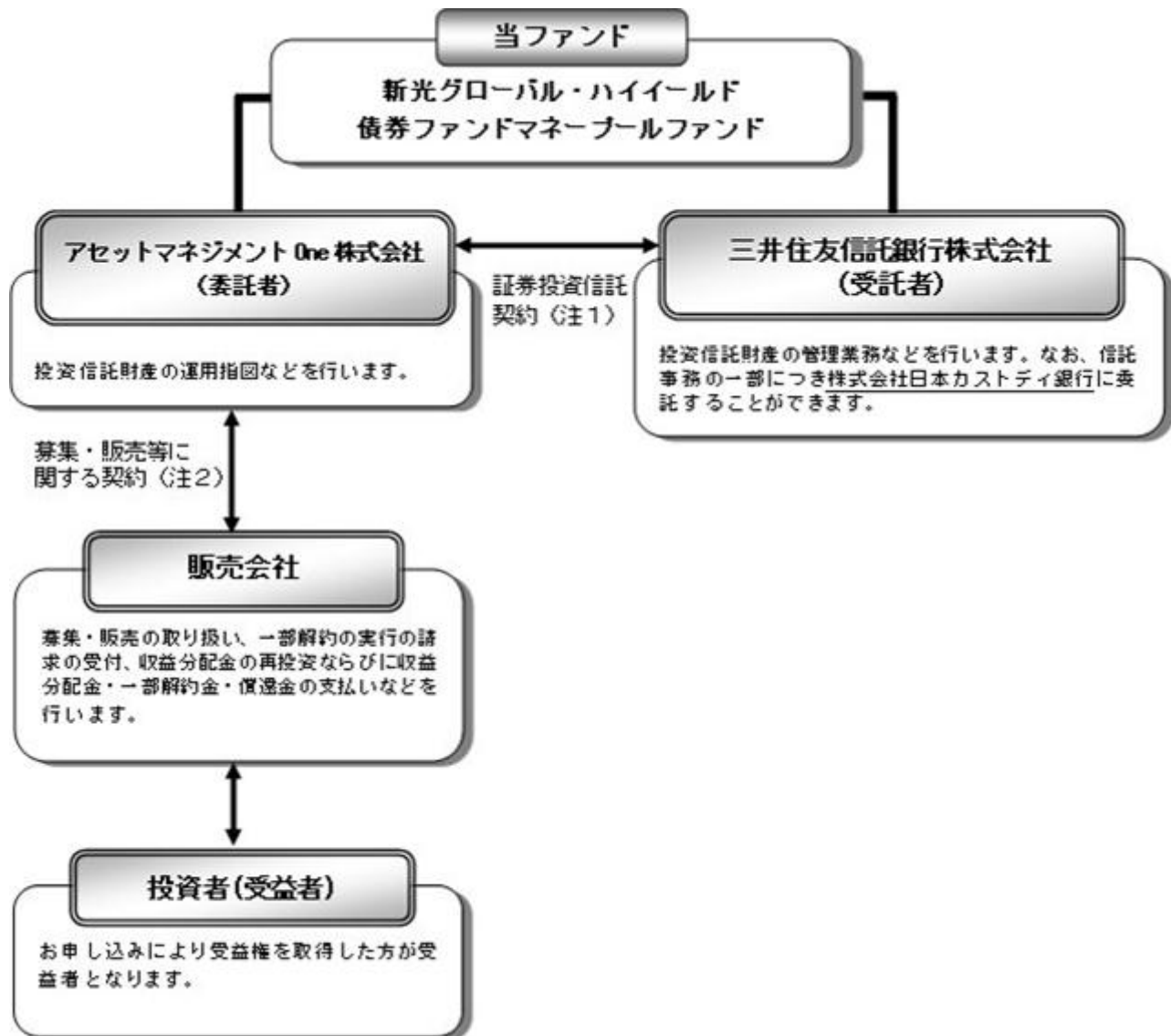
委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

(注2) 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

(略)

<マネープールファンド>



2【投資方針】

<訂正前>

各通貨コースが投資する外国投資信託の*には下記表をあてはめてご覧ください。

各通貨コース	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド-
米ドルコース	USDクラス
豪ドルコース	AUDクラス
ブラジルリアルコース	BRLクラス
メキシコペソコース	MXNクラス
トルコリラコース	TRYクラス

(注)各通貨コースが組み入れる外国投資信託の各クラスの運用方針につきましては、後述の「各ファンドが投資する投資信託証券の概要」をご参照ください。

<訂正後>

各通貨コースが投資する外国投資信託の*には下記表をあてはめてご覧ください。

各通貨コース	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド-
米ドルコース	USDクラス
豪ドルコース	AUDクラス
ブラジルリアルコース	BRLクラス

(注)各通貨コースが組み入れる外国投資信託の各クラスの運用方針につきましては、後述の「各ファンドが投資する投資信託証券の概要」をご参照ください。

(2) 【投資対象】

<訂正前>

(略)

各ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンド - USDクラス/AUDクラス/BRLクラス/MXNクラス/TRYクラス（以下、 当概要において、個別クラスを「クラス」といいます。）
(略)	
運用方針	主として世界各国の高利回り社債に分散投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と 中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。また、効率的な運用を 目的として、市場金利や企業の信用状態に関連するデリバティブ取引を行う場合があります。 米ドル以外の通貨建債券へ投資した場合、原則として債券の発行通貨売り/米ドル買い の為替取引を行います。その上で、クラスごとに以下の為替取引を行います。 USDクラス：原則として、為替取引は行いません。 AUDクラス：原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。 BRLクラス：原則として、米ドル売り、ブラジルリアル買いの為替取引を行います。 MXNクラス：原則として、米ドル売り、メキシコペソ買いの為替取引を行います。 TRYクラス：原則として、米ドル売り、トルコリラ買いの為替取引を行います。
(略)	
運用開始日	2010年10月12日（USDクラス/AUDクラス/BRLクラス） 2013年6月24日（MXNクラス/TRYクラス）

(略)

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。

また、各概要は2020年6月25日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

<訂正後>

(略)

各ファンドが投資する投資信託証券の概要

ファンド名	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド（マルチ・カレンシー）ファンド - USDクラス/AUDクラス/BRLクラス （以下、当概要において、個別クラスを「クラス」といいます。）
(略)	
運用方針	主として世界各国の高利回り社債に分散投資を行い、高水準のインカムゲインの確保と 中長期的なキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。また、効率的な運用を 目的として、市場金利や企業の信用状態に関連するデリバティブ取引を行う場合があります。 米ドル以外の通貨建債券へ投資した場合、原則として債券の発行通貨売り/米ドル買い の為替取引を行います。その上で、クラスごとに以下の為替取引を行います。 USDクラス：原則として、為替取引は行いません。 AUDクラス：原則として、米ドル売り、豪ドル買いの為替取引を行います。 BRLクラス：原則として、米ドル売り、ブラジルリアル買いの為替取引を行います。
(略)	
運用開始日	2010年10月12日

(略)

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。

また、各概要は2020年9月17日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(4) 【分配方針】

<訂正前>

a. 収益分配方針

<米ドルコース/豪ドルコース/ブラジルリアルコース>

(略)

4. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

<メキシコペソコース/トルコリラコース>

収益分配は原則として、毎月25日（該当日が休業日の場合は翌営業日。）の決算時に以下の方針に基づき収益の分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

2. 分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を中心に委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

3. 上記2.にかかわらず、上記2.にかかる分配金額のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。

4. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

<マネープールファンド>

(略)

<訂正後>

a. 収益分配方針

<各通貨コース>

(略)

4. 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

<マネープールファンド>

(略)

3【投資リスク】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク<参考情報>につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

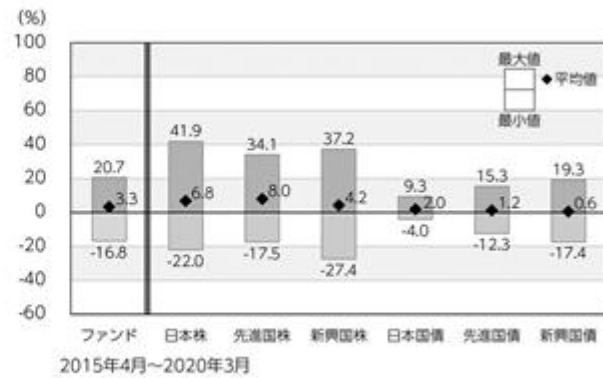
<参考情報>

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

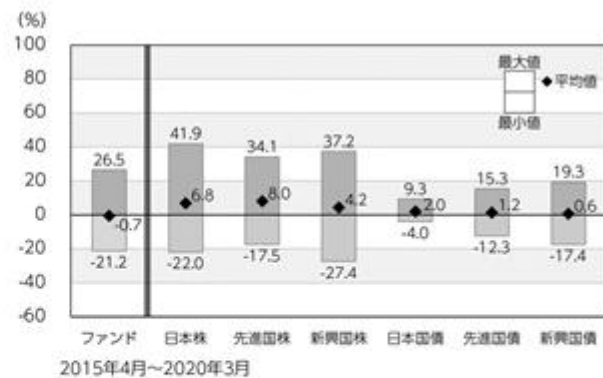
米ドルコース



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



豪ドルコース



*ファンドの分配金再投資基準価額は、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が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、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。

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび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。

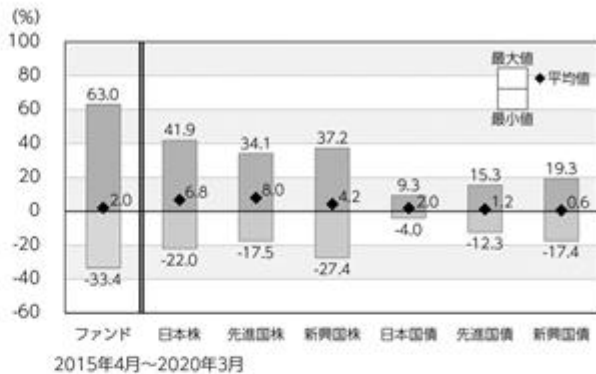
<参考情報>

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

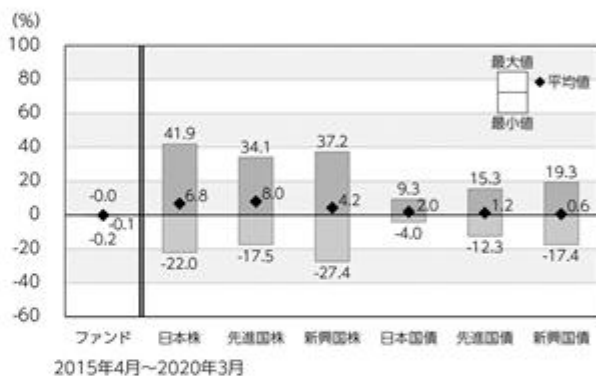
ブラジルレアルコース



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



マネーパブルファンド



*ファンドの分配金再投資基準価額は、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が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、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。

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび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。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、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更する権利および公表を停止する権利を有しています。
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、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、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更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が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ために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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。

5【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース

令和2年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	223,564,213	96.64
内 ケイマン諸島	223,564,213	96.64
親投資信託受益証券	300,477	0.13
内 日本	300,477	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,473,536	3.23
純資産総額	231,338,226	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

令和2年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	910,735,957	97.02
内 ケイマン諸島	910,735,957	97.02
親投資信託受益証券	1,201,909	0.13
内 日本	1,201,909	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	26,760,945	2.85
純資産総額	938,698,811	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース

令和2年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	4,306,058,568	97.59
内 ケイマン諸島	4,306,058,568	97.59
親投資信託受益証券	6,410,185	0.15
内 日本	6,410,185	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	99,768,135	2.26
純資産総額	4,412,236,888	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド

令和2年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	949,706	95.19
内 日本	949,706	95.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	48,017	4.81
純資産総額	997,723	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内短期公社債マザーファンド

令和2年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	14,181,300	17.69
内 日本	14,181,300	17.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	65,967,118	82.31
純資産総額	80,148,418	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース

令和2年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	WAグローバル・ハイ・ イールド・ボンド（マルチ・ カレンシー）ファンド - USDクラス ケイマン諸島	投資信託 受益証券	218,751,677	0.9922 217,067,289	1.0220 223,564,213	- -	96.64
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	298,389	1.0069 300,477	1.0070 300,477	- -	0.13

（注）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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年3月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	96.64
親投資信託受益証券	0.13
合計	96.77

（注）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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

令和2年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	WAグローバル・ハイ・ イールド・ボンド(マル チ・カレンシー)ファンド -AUDクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	2,512,375,056	0.3388	0.3625	-	97.02
				851,356,998	910,735,957	-	
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,193,555	1.0069	1.0070	-	0.13
				1,201,909	1,201,909	-	

(注) 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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年3月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	97.02
親投資信託受益証券	0.13
合計	97.15

(注) 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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース

令和2年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	WAグローバル・ハイ・ イールド・ボンド(マル チ・カレンシー)ファンド -BRLクラス ケイマン諸島	投資信 託受益 証券	49,781,023,913	0.0842	0.0865	-	97.59
				4,196,540,315	4,306,058,568	-	
2	国内短期公社債マザーファ ンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,365,626	1.0069	1.0070	-	0.15
				6,410,185	6,410,185	-	

(注) 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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年3月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	97.59
親投資信託受益証券	0.15
合計	97.74

（注）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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド

令和2年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	国内短期公社債マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	943,105	1.0069 949,706	1.0070 949,706	- -	95.19

（注）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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.19
合計	95.19

（注）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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内短期公社債マザーファンド

令和2年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	348回 大阪府公募公債 日本	地方債 証券	14,000,000	101.29 14,181,300	101.29 14,181,300	1.32 2021/3/30	17.69

（注）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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年3月31日現在

種類	投資比率（％）
地方債証券	17.69
合計	17.69

（注）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。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

【投資不動産物件】

新光グローバル・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。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース
該当事項はありません。

新光グローバル・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。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド
該当事項はありません。

（参考）

国内短期公社債マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

新光グローバル・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。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース
該当事項はありません。

新光グローバル・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。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド
該当事項はありません。

（参考）

国内短期公社債マザーファンド
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース

直近日（令和2年3月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成23年 3月25日)	742	745	1.0108	1.0158
第2特定期間末 (平成23年 9月26日)	817	821	0.8876	0.8926
第3特定期間末 (平成24年 3月26日)	494	496	1.0033	1.0083
第4特定期間末 (平成24年 9月25日)	345	346	0.9783	0.9833
第5特定期間末 (平成25年 3月25日)	384	386	1.2121	1.2171
第6特定期間末 (平成25年 9月25日)	591	593	1.2364	1.2414
第7特定期間末 (平成26年 3月25日)	606	608	1.3146	1.3196
第8特定期間末 (平成26年 9月25日)	561	567	1.3326	1.3481
第9特定期間末 (平成27年 3月25日)	659	666	1.3401	1.3556
第10特定期間末 (平成27年 9月25日)	510	516	1.1920	1.2075
第11特定期間末 (平成28年 3月25日)	360	366	1.0073	1.0228
第12特定期間末 (平成28年 9月26日)	317	320	0.9092	0.9192
第13特定期間末 (平成29年 3月27日)	339	343	0.9659	0.9759
第14特定期間末 (平成29年 9月25日)	430	434	0.9518	0.9618
第15特定期間末 (平成30年 3月26日)	363	367	0.8233	0.8333
第16特定期間末 (平成30年 9月25日)	315	319	0.8432	0.8532
第17特定期間末 (平成31年 3月25日)	294	296	0.8028	0.8078
第18特定期間末 (令和1年9月25日)	263	265	0.7980	0.8030
第19特定期間末 (令和2年3月25日)	225	227	0.6849	0.6899
平成31年3月末日	280	-	0.8084	-
4月末日	278	-	0.8233	-
令和1年5月末日	267	-	0.8046	-

6月末日	267	-	0.8039	-
7月末日	268	-	0.8112	-
8月末日	260	-	0.7891	-
9月末日	265	-	0.8021	-
10月末日	266	-	0.8069	-
11月末日	266	-	0.8086	-
12月末日	269	-	0.8195	-
令和2年1月末日	267	-	0.8114	-
2月末日	267	-	0.8110	-
3月末日	231	-	0.7045	-

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

直近日（令和2年3月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1特定期間末 （平成23年 3月25日）	7,159	7,221	1.0397	1.0487
第2特定期間末 （平成23年 9月26日）	12,305	12,432	0.8677	0.8767
第3特定期間末 （平成24年 3月26日）	14,892	15,023	1.0276	1.0366
第4特定期間末 （平成24年 9月25日）	11,378	11,482	0.9897	0.9987
第5特定期間末 （平成25年 3月25日）	9,908	9,981	1.2247	1.2337
第6特定期間末 （平成25年 9月25日）	7,114	7,171	1.1227	1.1317
第7特定期間末 （平成26年 3月25日）	5,936	5,983	1.1446	1.1536
第8特定期間末 （平成26年 9月25日）	5,432	5,530	1.1111	1.1311
第9特定期間末 （平成27年 3月25日）	4,962	5,065	0.9612	0.9812
第10特定期間末 （平成27年 9月25日）	3,763	3,868	0.7186	0.7386
第11特定期間末 （平成28年 3月25日）	2,830	2,926	0.5890	0.6090
第12特定期間末 （平成28年 9月26日）	3,096	3,164	0.5000	0.5110
第13特定期間末 （平成29年 3月27日）	3,223	3,294	0.4991	0.5101
第14特定期間末 （平成29年 9月25日）	3,416	3,472	0.4859	0.4939
第15特定期間末 （平成30年 3月26日）	2,616	2,669	0.3912	0.3992
第16特定期間末 （平成30年 9月25日）	1,942	1,962	0.3799	0.3839

第17特定期間末 (平成31年 3月25日)	1,538	1,546	0.3538	0.3558
第18特定期間末 (令和1年9月25日)	1,295	1,303	0.3362	0.3382
第19特定期間末 (令和2年3月25日)	882	889	0.2483	0.2503
平成31年3月末日	1,534	-	0.3551	-
4月末日	1,528	-	0.3588	-
令和1年5月末日	1,448	-	0.3452	-
6月末日	1,395	-	0.3496	-
7月末日	1,352	-	0.3464	-
8月末日	1,277	-	0.3298	-
9月末日	1,297	-	0.3369	-
10月末日	1,310	-	0.3434	-
11月末日	1,287	-	0.3396	-
12月末日	1,317	-	0.3539	-
令和2年1月末日	1,238	-	0.3367	-
2月末日	1,183	-	0.3300	-
3月末日	938	-	0.2654	-

新光グローバル・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（令和2年3月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成23年 3月25日)	24,548	24,918	0.9951	1.0101
第2特定期間末 (平成23年 9月26日)	60,666	61,877	0.7519	0.7669
第3特定期間末 (平成24年 3月26日)	98,052	99,849	0.8182	0.8332
第4特定期間末 (平成24年 9月25日)	77,307	79,030	0.6730	0.6880
第5特定期間末 (平成25年 3月25日)	97,143	99,017	0.7778	0.7928
第6特定期間末 (平成25年 9月25日)	79,321	81,062	0.6835	0.6985
第7特定期間末 (平成26年 3月25日)	62,790	64,268	0.6373	0.6523
第8特定期間末 (平成26年 9月25日)	54,066	55,424	0.5972	0.6122
第9特定期間末 (平成27年 3月25日)	38,263	39,570	0.4389	0.4539
第10特定期間末 (平成27年 9月25日)	27,061	28,234	0.2770	0.2890
第11特定期間末 (平成28年 3月25日)	23,335	23,806	0.2477	0.2527

第12特定期間末 (平成28年 9月26日)	19,971	20,352	0.2615	0.2665
第13特定期間末 (平成29年 3月27日)	18,840	19,167	0.2880	0.2930
第14特定期間末 (平成29年 9月25日)	17,070	17,374	0.2811	0.2861
第15特定期間末 (平成30年 3月26日)	12,538	12,819	0.2224	0.2274
第16特定期間末 (平成30年 9月25日)	9,131	9,277	0.1878	0.1908
第17特定期間末 (平成31年 3月25日)	8,076	8,164	0.1842	0.1862
第18特定期間末 (令和1年9月25日)	6,800	6,880	0.1686	0.1706
第19特定期間末 (令和2年3月25日)	4,303	4,378	0.1146	0.1166
平成31年3月末日	7,967	-	0.1827	-
4月末日	7,944	-	0.1854	-
令和1年5月末日	7,609	-	0.1803	-
6月末日	7,678	-	0.1841	-
7月末日	7,793	-	0.1888	-
8月末日	6,842	-	0.1674	-
9月末日	6,866	-	0.1701	-
10月末日	7,023	-	0.1760	-
11月末日	6,567	-	0.1659	-
12月末日	6,806	-	0.1757	-
令和2年1月末日	6,308	-	0.1644	-
2月末日	5,983	-	0.1564	-
3月末日	4,412	-	0.1175	-

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド

直近日（令和2年3月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成23年 3月25日)	1	1	1.0003	1.0003
第2計算期間末 (平成23年 9月26日)	30	30	1.0005	1.0005
第3計算期間末 (平成24年 3月26日)	12	12	1.0008	1.0008
第4計算期間末 (平成24年 9月25日)	1	1	1.0020	1.0020
第5計算期間末 (平成25年 3月25日)	2	2	1.0023	1.0023
第6計算期間末 (平成25年 9月25日)	11	11	1.0022	1.0022

第7計算期間末 (平成26年 3月25日)	11	11	1.0024	1.0024
第8計算期間末 (平成26年 9月25日)	11	11	1.0023	1.0023
第9計算期間末 (平成27年 3月25日)	11	11	1.0018	1.0018
第10計算期間末 (平成27年 9月25日)	4	4	1.0018	1.0018
第11計算期間末 (平成28年 3月25日)	1	1	1.0014	1.0014
第12計算期間末 (平成28年 9月26日)	1	1	1.0011	1.0011
第13計算期間末 (平成29年 3月27日)	1	1	1.0008	1.0008
第14計算期間末 (平成29年 9月25日)	1	1	1.0003	1.0003
第15計算期間末 (平成30年 3月26日)	0.999755	0.999755	0.9998	0.9998
第16計算期間末 (平成30年 9月25日)	0.999142	0.999142	0.9991	0.9991
第17計算期間末 (平成31年 3月25日)	0.998337	0.998337	0.9983	0.9983
第18計算期間末 (令和1年9月25日)	0.997817	0.997817	0.9978	0.9978
第19計算期間末 (令和2年3月25日)	0.997729	0.997729	0.9977	0.9977
平成31年3月末日	0.998333	-	0.9983	-
4月末日	0.998204	-	0.9982	-
令和1年5月末日	0.998060	-	0.9981	-
6月末日	0.997931	-	0.9979	-
7月末日	0.997888	-	0.9979	-
8月末日	0.997849	-	0.9978	-
9月末日	0.997812	-	0.9978	-
10月末日	0.997781	-	0.9978	-
11月末日	0.997752	-	0.9978	-
12月末日	0.997721	-	0.9977	-
令和2年1月末日	0.997689	-	0.9977	-
2月末日	0.997755	-	0.9978	-
3月末日	0.997723	-	0.9977	-

【分配の推移】

新光グローバル・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	0.0200
第2特定期間	0.0300
第3特定期間	0.0300
第4特定期間	0.0300
第5特定期間	0.0300
第6特定期間	0.0300
第7特定期間	0.0300
第8特定期間	0.0615
第9特定期間	0.0930
第10特定期間	0.0930
第11特定期間	0.0930
第12特定期間	0.0875
第13特定期間	0.0600
第14特定期間	0.0600
第15特定期間	0.0600
第16特定期間	0.0600
第17特定期間	0.0350
第18特定期間	0.0300
第19特定期間	0.0300

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0360
第2特定期間	0.0540
第3特定期間	0.0540
第4特定期間	0.0540
第5特定期間	0.0540
第6特定期間	0.0540
第7特定期間	0.0540
第8特定期間	0.0870
第9特定期間	0.1200
第10特定期間	0.1200
第11特定期間	0.1200
第12特定期間	0.0930
第13特定期間	0.0660
第14特定期間	0.0600
第15特定期間	0.0480
第16特定期間	0.0240
第17特定期間	0.0140
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120

新光グローバル・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	0.0600
第2特定期間	0.0900
第3特定期間	0.0900
第4特定期間	0.0900
第5特定期間	0.0900
第6特定期間	0.0900
第7特定期間	0.0900
第8特定期間	0.0900
第9特定期間	0.0900
第10特定期間	0.0810
第11特定期間	0.0490
第12特定期間	0.0300
第13特定期間	0.0300
第14特定期間	0.0300
第15特定期間	0.0300
第16特定期間	0.0180
第17特定期間	0.0130
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネーブルファンド

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000

【収益率の推移】

新光グローバル・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	3.1
第2特定期間	9.2
第3特定期間	16.4
第4特定期間	0.5
第5特定期間	27.0
第6特定期間	4.5
第7特定期間	8.8
第8特定期間	6.0
第9特定期間	7.5
第10特定期間	4.1
第11特定期間	7.7
第12特定期間	1.1
第13特定期間	12.8
第14特定期間	4.8
第15特定期間	7.2
第16特定期間	9.7
第17特定期間	0.6
第18特定期間	3.1
第19特定期間	10.4

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

	収益率（％）
第1特定期間	7.6
第2特定期間	11.3
第3特定期間	24.7
第4特定期間	1.6
第5特定期間	29.2
第6特定期間	3.9
第7特定期間	6.8
第8特定期間	4.7
第9特定期間	2.7
第10特定期間	12.8
第11特定期間	1.3
第12特定期間	0.7
第13特定期間	13.0
第14特定期間	9.4
第15特定期間	9.6
第16特定期間	3.2
第17特定期間	3.2
第18特定期間	1.6
第19特定期間	22.6

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

新光グローバル・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	5.5
第2特定期間	15.4
第3特定期間	20.8
第4特定期間	6.7
第5特定期間	28.9
第6特定期間	0.6
第7特定期間	6.4
第8特定期間	7.8
第9特定期間	11.4
第10特定期間	18.4
第11特定期間	7.1
第12特定期間	17.7
第13特定期間	21.6
第14特定期間	8.0
第15特定期間	10.2
第16特定期間	7.5
第17特定期間	5.0
第18特定期間	2.0
第19特定期間	24.9

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド

	収益率（％）
第1計算期間	0.03
第2計算期間	0.02
第3計算期間	0.03
第4計算期間	0.12
第5計算期間	0.03
第6計算期間	0.01
第7計算期間	0.02
第8計算期間	0.01
第9計算期間	0.05
第10計算期間	0.00
第11計算期間	0.04
第12計算期間	0.03
第13計算期間	0.03
第14計算期間	0.05
第15計算期間	0.05
第16計算期間	0.07
第17計算期間	0.08
第18計算期間	0.05
第19計算期間	0.01

（注）収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

新光グローバル・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	749,112,420	14,700,000
第2特定期間	540,192,193	353,778,605
第3特定期間	67,346,316	495,438,265
第4特定期間	84,101,069	223,998,822
第5特定期間	61,874,744	97,481,980
第6特定期間	206,332,345	45,118,882
第7特定期間	88,071,646	105,397,389
第8特定期間	26,849,841	66,832,408
第9特定期間	126,786,372	56,130,586
第10特定期間	33,191,692	96,910,315
第11特定期間	30,078,520	100,293,726
第12特定期間	12,423,628	21,275,828
第13特定期間	25,718,201	23,176,208
第14特定期間	119,865,607	19,199,648
第15特定期間	9,571,604	20,693,286
第16特定期間	4,076,927	71,228,200
第17特定期間	1,079,532	8,413,997
第18特定期間	600,698	36,583,012
第19特定期間	1,340,526	2,721,145

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

	設定口数	解約口数
第1特定期間	7,137,371,920	251,152,428
第2特定期間	9,935,161,145	2,640,245,730
第3特定期間	7,369,109,874	7,057,684,700
第4特定期間	4,483,595,566	7,479,479,440
第5特定期間	1,514,483,277	4,920,406,166
第6特定期間	162,257,622	1,916,365,658
第7特定期間	134,807,926	1,284,520,386
第8特定期間	545,058,949	842,493,169
第9特定期間	749,008,729	475,670,898
第10特定期間	805,698,158	731,590,211
第11特定期間	382,580,911	813,719,382
第12特定期間	1,968,119,354	580,479,281
第13特定期間	1,224,966,518	959,599,799
第14特定期間	1,573,150,062	1,000,412,250
第15特定期間	380,250,913	723,455,614
第16特定期間	69,127,079	1,645,404,524
第17特定期間	10,688,507	774,721,788
第18特定期間	5,930,036	499,901,929
第19特定期間	9,581,678	309,284,631

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

新光グローバル・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	25,069,615,845	398,817,176
第2特定期間	61,973,742,881	5,956,952,156
第3特定期間	62,826,371,406	23,680,170,673
第4特定期間	37,048,542,499	42,020,863,159
第5特定期間	36,201,068,263	26,169,878,750
第6特定期間	12,512,151,373	21,347,667,093
第7特定期間	6,057,257,149	23,590,545,351
第8特定期間	8,404,308,157	16,390,784,099
第9特定期間	11,666,527,738	15,019,026,646
第10特定期間	23,230,065,265	12,725,195,487
第11特定期間	11,196,439,570	14,694,269,830
第12特定期間	1,378,790,362	19,212,379,388
第13特定期間	2,080,908,865	13,026,249,405
第14特定期間	1,731,879,821	6,411,467,522
第15特定期間	1,445,965,275	5,806,386,947
第16特定期間	547,487,553	8,308,034,508
第17特定期間	482,499,720	5,242,762,239
第18特定期間	369,158,074	3,891,160,768
第19特定期間	321,883,939	3,101,044,733

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネーブルファンド

	設定口数	解約口数
第1計算期間	1,000,000	0
第2計算期間	29,827,708	0
第3計算期間	121,882,221	139,881,600
第4計算期間	93,770,229	105,598,558
第5計算期間	54,187,517	53,093,913
第6計算期間	44,923,307	35,718,068
第7計算期間	65,878,480	65,878,480
第8計算期間	66,472,139	66,472,139
第9計算期間	69,618,955	69,115,063
第10計算期間	9,813,023	17,477,221
第11計算期間	0	3,138,537
第12計算期間	0	0
第13計算期間	0	0
第14計算期間	0	0
第15計算期間	0	0
第16計算期間	0	0
第17計算期間	0	0
第18計算期間	0	0
第19計算期間	0	0

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

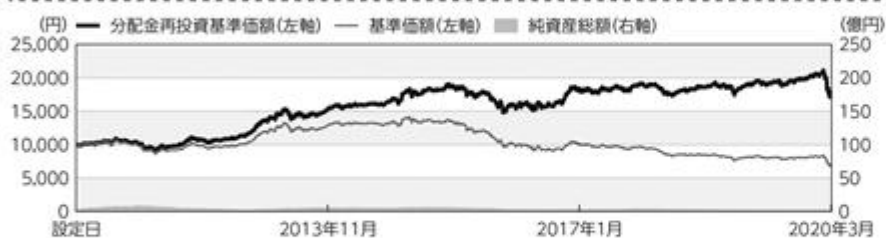
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

データの基準日:2020年3月31日

米ドルコース

基準価額・純資産の推移(2010年10月8日~2020年3月31日)



分配の推移(税引前)

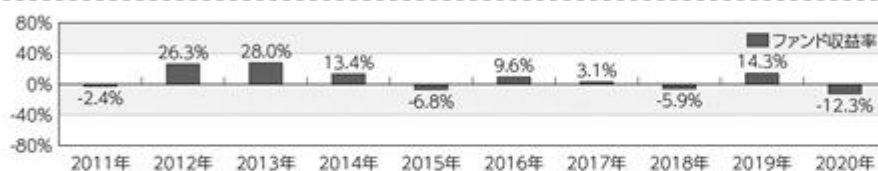
2019年11月	50円
2019年12月	50円
2020年1月	50円
2020年2月	50円
2020年3月	50円
直近1年間累計	600円
設定来累計	9,630円

主要な資産の状況

組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド-USDクラス	96.64
2	国内短期公社債マザーファンド	0.13

年間収益率の推移(暦年ベース)



*基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2010年10月8日)

*分配金は1万口当たりです。

*比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

*年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

*2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

*当ファンドにはベンチマークはありません。

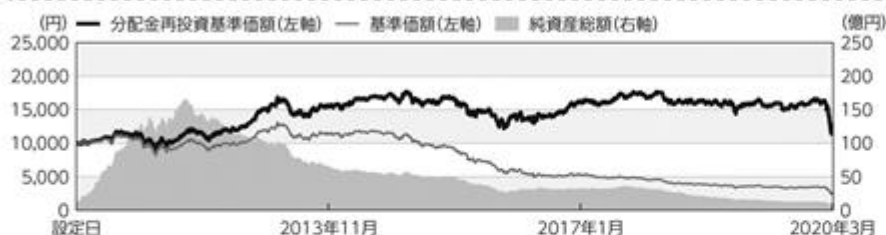
○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年3月31日

豪ドルコース

基準価額・純資産の推移(2010年10月8日~2020年3月31日)



分配の推移(税引前)

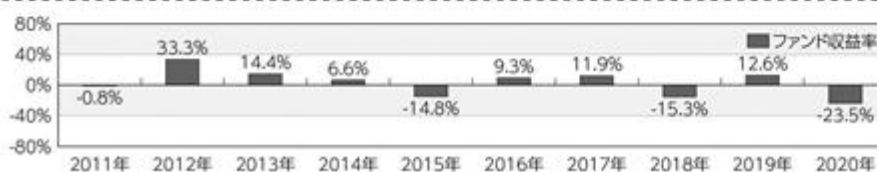
2019年11月	20円
2019年12月	20円
2020年1月	20円
2020年2月	20円
2020年3月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	11,360円

主要な資産の状況

組入銘柄

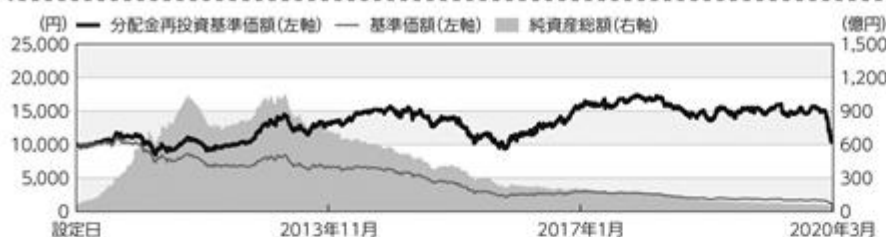
順位	銘柄名	比率(%)
1	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド-AUDクラス	97.02
2	国内短期公社債マザーファンド	0.13

年間収益率の推移(暦年ベース)



ブラジルリアルコース

基準価額・純資産の推移(2010年10月8日~2020年3月31日)



分配の推移(税引前)

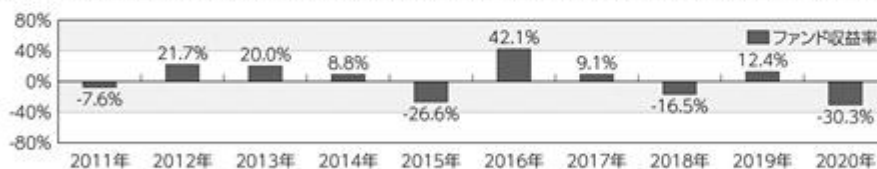
2019年11月	20円
2019年12月	20円
2020年1月	20円
2020年2月	20円
2020年3月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	10,850円

主要な資産の状況

組入銘柄

順位	銘柄名	比率(%)
1	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド-BRLクラス	97.59
2	国内短期公社債マザーファンド	0.15

年間収益率の推移(暦年ベース)



*基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2010年10月8日)

*分配金は1万口当たりです。

*比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

*年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

*2020年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

*各ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年3月31日

マネーボールファンド

基準価額・純資産の推移(2010年10月8日~2020年3月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2010年10月8日)

分配の推移(税引前)

2018年 3月	0円
2018年 9月	0円
2019年 3月	0円
2019年 9月	0円
2020年 3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内短期公社債マザーファンド	95.19

■国内短期公社債マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

資産の種類	比率(%)
地方債証券	17.69
内 日本	17.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	82.31
合計(純資産総額)	100.00

組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	348回 大阪府公債	地方債証券	日本	1.32	2021/3/30	17.69

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

■WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド(2020年3月24日現在)

※ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシーからの情報を基に作成しています。

※比率(%)は、WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンドの組入公社債を100%とした場合の割合で、小数第3位を四捨五入しています。

組入公社債上位10銘柄

順位	銘柄名	クーポン(%)	償還日	比率(%)
1	TEVA PHARMACEUTICALS NE	2.800	2023/7/21	3.33
2	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	3.413	2024/2/1	2.86
3	PETSMART INC	5.875	2025/6/1	2.48
4	US TREASURY NOTE	1.500	2023/3/31	1.65
5	CSC HOLDINGS LLC	6.500	2029/2/1	1.47
6	CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.908	2025/7/23	1.46
7	GOLDMAN SACHS GROUP	3.500	2026/11/16	1.46
8	INTESA SANPAOLO SPA	5.017	2024/6/26	1.42
9	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	6.000	2025/2/15	1.25
10	PRIME SECSRVC BRW/FINANC	5.250	2024/4/15	1.24

○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（略）

（ロ）「分配金再投資コース」での取得申込者は、販売会社との間で「新光グローバル・ハイイールド債券ファンド*自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

・上記の*には次の表の各ファンドの名称をあてはめてご覧ください。

米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	メキシコペソコース	トルコリラコース	マネープールファンド
--------	--------	------------	-----------	----------	------------

（ハ）取得およびスイッチングの申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

なお、各通貨コースについて、以下のいずれかに該当する日には、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

	申込受付休止日
米ドルコース、豪ドルコース、 メキシコペソコース、トルコ リラコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日
ブラジルリアルコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 サンパウロ証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 サンパウロの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日

また、各通貨コースにおいて、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるとき、マネープールファンドにおいては、取引所における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、取得およびスイッチングの申し込みの受付を中止することおよび既に受け付けた取得およびスイッチングの申し込みの受付を取り消すことができます。ただし、別に定める契約に基づく収益分配金の再投資にかかる追加信託金の申し込みに限ってこれを受け付けるものとします。

<訂正後>

（略）

- （ロ）「分配金再投資コース」での取得申込者は、販売会社との間で「新光グローバル・ハイイールド債券ファンド*自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

・上記の*には次の表の各ファンドの名称をあてはめてご覧ください。

米ドルコース	豪ドルコース	ブラジルリアルコース	マネープールファンド
--------	--------	------------	------------

- （ハ）取得およびスイッチングの申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

なお、各通貨コースについて、以下のいずれかに該当する日には、取得およびスイッチングの申し込みの受付は行いません。

	申込受付休止日
米ドルコース、豪ドルコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日
ブラジルリアルコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 サンパウロ証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 サンパウロの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日

また、各通貨コースにおいて、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるとき、マネープールファンドにおいては、取引所における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、取得およびスイッチングの申し込みの受付を中止することおよび既に受け付けた取得およびスイッチングの申し込みの受付を取り消すことができます。ただし、別に定める契約に基づく収益分配金の再投資にかかる追加信託金の申し込みに限ってこれを受け付けるものとします。

2【換金(解約)手続等】

<訂正前>

(略)

(へ) 委託者は、各通貨コースにおいて、以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

	申込受付休止日
米ドルコース、豪ドルコース、 メキシコペソコース、トルコリ ラコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日
ブラジルリアルコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 サンパウロ証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 サンパウロの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日

(略)

<訂正後>

(略)

(へ) 委託者は、各通貨コースにおいて、以下のいずれかに該当する日には、上記(イ)による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

	申込受付休止日
米ドルコース、豪ドルコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日
ブラジルリアルコース	ニューヨーク証券取引所の休業日 サンパウロ証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドンの銀行の休業日 サンパウロの銀行の休業日 ケイマンの銀行の休業日

(略)

3【資産管理等の概要】

(3)【信託期間】

<訂正前>

各ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2025年9月25日までです。

ただし、メキシコペソコースとトルコリラコースは2020年9月25日までです。

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

<訂正後>

各ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2025年9月25日までです。

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

h. 信託事務処理の再信託

(イ) 受託者は、各ファンドにかかる信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

(ロ) 上記(イ)における日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(略)

<訂正後>

(略)

h. 信託事務処理の再信託

(イ) 受託者は、各ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

(ロ) 上記(イ)における株式会社日本カストディ銀行に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(略)

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース

(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。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎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、当特定期間(令和1年9月26日から令和2年3月25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。

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド

(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。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎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、第19期計算期間(令和1年9月26日から令和2年3月25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】

【新光グローバル・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 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,961,695	9,996,488
投資信託受益証券	258,463,951	217,067,289
親投資信託受益証券	300,447	300,477
流動資産合計	265,726,093	227,364,254
資産合計	265,726,093	227,364,254
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,653,110	1,646,207
未払受託者報酬	7,001	6,472
未払委託者報酬	245,079	226,842
その他未払費用	652	571
流動負債合計	1,905,842	1,880,092
負債合計	1,905,842	1,880,092
純資産の部		
元本等		
元本	330,622,198	329,241,579
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	66,801,947	103,757,417
（分配準備積立金）	1,841,544	-
元本等合計	263,820,251	225,484,162
純資産合計	263,820,251	225,484,162
負債純資産合計	265,726,093	227,364,254

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	当期 自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
営業収益		
受取配当金	8,867,948	8,620,950
有価証券売買等損益	1,308,651	34,396,632
営業収益合計	10,176,599	25,775,682
営業費用		
支払利息	3,199	1,904
受託者報酬	44,129	43,394
委託者報酬	1,544,572	1,520,522
その他費用	4,121	3,944
営業費用合計	1,596,021	1,569,764
営業利益又は営業損失()	8,580,578	27,345,446
経常利益又は経常損失()	8,580,578	27,345,446
当期純利益又は当期純損失()	8,580,578	27,345,446
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()	229,675	60,966
期首剰余金又は期首欠損金()	72,276,220	66,801,947
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,255,991	512,232
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,255,991	512,232
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	117,702	296,663
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	117,702	296,663
分配金	10,014,919	9,886,559
期末剰余金又は期末欠損金()	66,801,947	103,757,417

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 令和1年9月26日	至 令和2年3月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25日現在
1. 期首元本額	366,604,512円	330,622,198円
期中追加設定元本額	600,698円	1,340,526円
期中一部解約元本額	36,583,012円	2,721,145円
2. 受益権の総数	330,622,198口	329,241,579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66,801,947円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は103,757,417円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
1. 分配金の計算過程	<p>(自平成31年3月26日 至平成31年4月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,455,059円)、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(35,033,875円)及び分配準備積立金(1,648,734円)より分配対象収益は38,137,668円(1万口当たり1,128.43円)であり、うち1,689,851円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和1年9月26日 至令和1年10月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,370,626円)、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(31,965,941円)及び分配準備積立金(1,841,445円)より分配対象収益は35,178,012円(1万口当たり1,063.79円)であり、うち1,653,419円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>

(自平成31年4月26日 至令和1年5月27日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,212,890円)、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(34,662,830円)及び分配準備積立金(1,750,799円)より分配対象収益は37,626,519円(1万口当たり1,114.38円)であり、うち1,688,221円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自令和1年5月28日 至令和1年6月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,294,868円)、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(34,191,596円)及び分配準備積立金(1,265,693円)より分配対象収益は36,752,157円(1万口当たり1,103.50円)であり、うち1,665,250円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自令和1年6月26日 至令和1年7月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,344,253円)、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(34,203,108円)及び分配準備積立金(895,311円)より分配対象収益は36,442,672円(1万口当たり1,093.85円)であり、うち1,665,796円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自令和1年10月26日 至令和1年11月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,187,391円)、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(31,841,612円)及び分配準備積立金(1,552,204円)より分配対象収益は34,581,207円(1万口当たり1,049.84円)であり、うち1,646,969円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自令和1年11月26日 至令和1年12月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,385,567円)、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(31,823,338円)及び分配準備積立金(1,091,731円)より分配対象収益は34,300,636円(1万口当たり1,041.93円)であり、うち1,646,011円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

(自令和1年12月26日 至令和2年1月27日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,247,655円)、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(31,832,457円)及び分配準備積立金(831,284円)より分配対象収益は33,911,396円(1万口当たり1,029.82円)であり、うち1,646,467円(1万口当たり50円)を分配金額としております。

<p>(自令和1年7月26日 至令和1年8月26日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,190,265円)、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(33,934,186円)及び分配準備積立金(570,609円)より分配対象収益は35,695,060円(1万口当たり1,079.90円)であり、うち1,652,691円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和2年1月28日 至令和2年2月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,329,918円)、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(31,852,438円)及び分配準備積立金(432,472円)より分配対象収益は33,614,828円(1万口当たり1,020.18円)であり、うち1,647,486円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>
<p>(自令和1年8月27日 至令和1年9月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,403,184円)、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(32,455,477円)及び分配準備積立金(1,595,537円)より分配対象収益は35,454,198円(1万口当たり1,072.34円)であり、うち1,653,110円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和2年2月26日 至令和2年3月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,187,860円)、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(31,829,085円)及び分配準備積立金(114,533円)より分配対象収益は33,131,478円(1万口当たり1,006.29円)であり、うち1,646,207円(1万口当たり50円)を分配金額としております。</p>

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、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「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25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	4,922,909	45,478,473
親投資信託受益証券	-	30
合計	4,922,909	45,478,443

（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。

（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口当たり情報に関する注記)

	前期 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7980円 (7,980円)	0.6849円 (6,849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

令和2年3月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - USDクラス	218,751,677	217,067,289	
投資信託受益証券 合計		218,751,677	217,067,289	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	298,389	300,477	
親投資信託受益証券 合計		298,389	300,477	
合計			217,367,766	

(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、証券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。

【新光グローバル・ハイールド債券ファンド豪ドルコース】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,288,679	29,340,756
投資信託受益証券	1,268,952,922	867,119,852
親投資信託受益証券	1,201,790	1,201,909
流動資産合計	1,306,443,391	897,662,517
資産合計	1,306,443,391	897,662,517
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,708,126	7,108,720
未払解約金	1,722,298	6,948,363
未払受託者報酬	34,574	27,668
未払委託者報酬	1,210,184	968,559
その他未払費用	3,275	2,486
流動負債合計	10,678,457	15,055,796
負債合計	10,678,457	15,055,796
純資産の部		
元本等		
元本	3,854,063,193	3,554,360,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,558,298,259	2,671,753,519
(分配準備積立金)	126,715,108	121,546,872
元本等合計	1,295,764,934	882,606,721
純資産合計	1,295,764,934	882,606,721
負債純資産合計	1,306,443,391	897,662,517

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	当期 自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
営業収益		
受取配当金	60,154,131	55,491,304
有価証券売買等損益	73,854,123	316,832,951
営業収益合計	13,699,992	261,341,647
営業費用		
支払利息	16,699	8,133
受託者報酬	230,720	205,170
委託者報酬	8,075,075	7,182,344
その他費用	21,852	19,006
営業費用合計	8,344,346	7,414,653
営業利益又は営業損失（ ）	22,044,338	268,756,300
経常利益又は経常損失（ ）	22,044,338	268,756,300
当期純利益又は当期純損失（ ）	22,044,338	268,756,300
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（ ）	864,341	2,276,832
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,809,796,405	2,558,298,259
剰余金増加額又は欠損金減少額	326,514,998	203,669,941
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	326,514,998	203,669,941
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	3,867,503	6,335,889
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	3,867,503	6,335,889
分配金	48,240,670	44,309,844
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,558,298,259	2,671,753,519

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 令和1年9月26日	至 令和2年3月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25日現在
1. 期首元本額	4,348,035,086円	3,854,063,193円
期中追加設定元本額	5,930,036円	9,581,678円
期中一部解約元本額	499,901,929円	309,284,631円
2. 受益権の総数	3,854,063,193口	3,554,360,240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2,558,298,259円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,671,753,519円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
1. 分配金の計算過程	<p>(自平成31年3月26日 至平成31年4月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,044,220円)、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(314,620,539円)及び分配準備積立金(133,582,477円)より分配対象収益は458,247,236円(1万口当たり1,073.10円)であり、うち8,540,558円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和1年9月26日 至令和1年10月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,041,129円)、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(281,671,358円)及び分配準備積立金(125,584,661円)より分配対象収益は416,297,148円(1万口当たり1,089.59円)であり、うち7,641,286円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

(自平成31年4月26日 至令和1年5月27日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,870,069円)、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

(311,289,335円)及び分配準備積立金(133,655,764円)より分配対象収益は453,815,168円(1万口当たり1,074.20円)であり、うち8,449,297円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年5月28日 至令和1年6月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,065,277円)、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

(294,068,616円)及び分配準備積立金(126,806,598円)より分配対象収益は429,940,491円(1万口当たり1,077.40円)であり、うち7,981,035円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年6月26日 至令和1年7月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,040,287円)、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

(287,638,964円)及び分配準備積立金(125,124,642円)より分配対象収益は421,803,893円(1万口当たり1,080.75円)であり、うち7,805,731円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年10月26日 至令和1年11月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,120,385円)、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

(279,826,266円)及び分配準備積立金(126,107,042円)より分配対象収益は414,053,693円(1万口当たり1,090.99円)であり、うち7,590,376円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年11月26日 至令和1年12月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,147,960円)、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

(274,579,186円)及び分配準備積立金(124,109,365円)より分配対象収益は407,836,511円(1万口当たり1,095.58円)であり、うち7,445,112円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年12月26日 至令和2年1月27日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,614,765円)、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

(271,266,593円)及び分配準備積立金(124,248,591円)より分配対象収益は403,129,949円(1万口当たり1,096.28円)であり、うち7,354,442円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

<p>(自令和1年7月26日 至令和1年8月26日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,216,861円)、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(285,833,298円)及び分配準備積立金(125,547,010円)より分配対象収益は419,597,169円(1万口当たり1,082.00円)であり、うち7,755,923円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和1年8月27日 至令和1年9月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,206,383円)、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(284,103,384円)及び分配準備積立金(125,216,851円)より分配対象収益は418,526,618円(1万口当たり1,085.93円)であり、うち7,708,126円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和2年1月28日 至令和2年2月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,703,346円)、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(264,489,189円)及び分配準備積立金(121,355,791円)より分配対象収益は393,548,326円(1万口当たり1,097.77円)であり、うち7,169,908円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和2年2月26日 至令和2年3月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,897,182円)、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(262,323,447円)及び分配準備積立金(120,758,410円)より分配対象収益は390,979,039円(1万口当たり1,099.99円)であり、うち7,108,720円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
---	---

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、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「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25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	23,554,921	321,297,731
親投資信託受益証券	-	119
合計	23,554,921	321,297,612

（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。

（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口当たり情報に関する注記)

	前期 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.3362円 (3,362円)	0.2483円 (2,483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

令和2年3月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - AUDクラス	2,560,141,283	867,119,852	
投資信託受益証券 合計		2,560,141,283	867,119,852	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	1,193,555	1,201,909	
親投資信託受益証券 合計		1,193,555	1,201,909	
合計			868,321,761	

(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、証券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。

【新光グローバル・ハ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 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	181,031,015	189,162,649
投資信託受益証券	6,587,066,623	4,196,540,315
親投資信託受益証券	6,409,548	6,410,185
未収入金	120,000,000	-
流動資産合計	6,894,507,186	4,392,113,149
資産合計	6,894,507,186	4,392,113,149
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	80,660,337	75,102,015
未払解約金	6,991,901	8,315,031
未払受託者報酬	185,170	136,984
未払委託者報酬	6,480,980	4,794,600
その他未払費用	17,579	12,356
流動負債合計	94,335,967	88,360,986
負債合計	94,335,967	88,360,986
純資産の部		
元本等		
元本	40,330,168,619	37,551,007,825
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	33,529,997,400	33,247,255,662
(分配準備積立金)	2,305,319,079	2,235,561,047
元本等合計	6,800,171,219	4,303,752,163
純資産合計	6,800,171,219	4,303,752,163
負債純資産合計	6,894,507,186	4,392,113,149

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	当期 自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
営業収益		
受取配当金	640,837,702	608,048,390
有価証券売買等損益	730,229,937	2,150,525,671
営業収益合計	89,392,235	1,542,477,281
営業費用		
支払利息	94,904	41,743
受託者報酬	1,244,539	1,061,791
委託者報酬	43,558,656	37,164,165
その他費用	118,162	98,769
営業費用合計	45,016,261	38,366,468
営業利益又は営業損失（ ）	134,408,496	1,580,843,749
経常利益又は経常損失（ ）	134,408,496	1,580,843,749
当期純利益又は当期純損失（ ）	134,408,496	1,580,843,749
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（ ）	3,397,123	15,610,883
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	35,775,777,648	33,529,997,400
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,185,552,082	2,580,282,748
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,185,552,082	2,580,282,748
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	303,468,783	267,568,778
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	303,468,783	267,568,778
分配金	498,497,432	464,739,366
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	33,529,997,400	33,247,255,662

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 令和1年9月26日	至 令和2年3月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25日現在
1. 期首元本額	43,852,171,313円	40,330,168,619円
期中追加設定元本額	369,158,074円	321,883,939円
期中一部解約元本額	3,891,160,768円	3,101,044,733円
2. 受益権の総数	40,330,168,619口	37,551,007,825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33,529,997,400円です。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は33,247,255,662円です。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
1. 分配金の計算過程	<p>(自平成31年3月26日 至平成31年4月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(102,666,754円)、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(6,072,226,056円)及び分配準備積立金(2,357,240,867円)より分配対象収益は8,532,133,677円(1万口当たり1,992.73円)であり、うち85,632,228円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和1年9月26日 至令和1年10月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(100,770,009円)、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(5,678,738,878円)及び分配準備積立金(2,277,509,096円)より分配対象収益は8,057,017,983円(1万口当たり2,019.43円)であり、うち79,794,596円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>

(自平成31年4月26日 至令和1年5月27日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(98,747,770円)、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

(5,997,707,158円)及び分配準備積立金(2,341,953,841円)より分配対象収益は8,438,408,769円(1万口当たり1,996.16円)であり、うち84,546,041円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年5月28日 至令和1年6月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(104,091,938円)、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

(5,920,073,192円)及び分配準備積立金(2,322,441,802円)より分配対象収益は8,346,606,932円(1万口当たり2,001.18円)であり、うち83,416,581円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年6月26日 至令和1年7月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(102,397,199円)、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

(5,864,273,329円)及び分配準備積立金(2,317,974,277円)より分配対象収益は8,284,644,805円(1万口当たり2,006.03円)であり、うち82,597,332円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年10月26日 至令和1年11月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(95,963,667円)、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

(5,635,588,901円)及び分配準備積立金(2,277,280,136円)より分配対象収益は8,008,832,704円(1万口当たり2,023.68円)であり、うち79,150,958円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年11月26日 至令和1年12月25日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(98,118,901円)、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

(5,513,837,524円)及び分配準備積立金(2,240,583,669円)より分配対象収益は7,852,540,094円(1万口当たり2,029.03円)であり、うち77,401,688円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

(自令和1年12月26日 至令和2年1月27日)

計算期間末における費用控除後の配当等収益(93,420,559円)、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

(5,475,534,821円)及び分配準備積立金(2,240,502,941円)より分配対象収益は7,809,458,321円(1万口当たり2,033.37円)であり、うち76,812,954円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

<p>(自令和1年7月26日 至令和1年8月26日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(96,968,697円)、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(5,799,176,262円)及び分配準備積立金(2,308,554,453円)より分配対象収益は8,204,699,412円(1万口当たり2,009.84円)であり、うち81,644,913円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和1年8月27日 至令和1年9月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(97,824,131円)、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(5,737,248,037円)及び分配準備積立金(2,288,155,285円)より分配対象収益は8,123,227,453円(1万口当たり2,014.18円)であり、うち80,660,337円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和2年1月28日 至令和2年2月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(93,305,038円)、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(5,454,511,818円)及び分配準備積立金(2,244,330,801円)より分配対象収益は7,792,147,657円(1万口当たり2,037.77円)であり、うち76,477,155円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和2年2月26日 至令和2年3月25日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(93,619,061円)、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(5,359,909,180円)及び分配準備積立金(2,217,044,001円)より分配対象収益は7,670,572,242円(1万口当たり2,042.70円)であり、うち75,102,015円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</p>
---	---

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、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「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25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	96,486,379	1,812,029,271
親投資信託受益証券	-	637
合計	96,486,379	1,812,028,634

（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。

（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口当たり情報に関する注記)

	前期 令和1年9月25日現在	当期 令和2年3月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.1686円 (1,686円)	0.1146円 (1,146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

令和2年3月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - BRLクラス	49,781,023,913	4,196,540,315	
投資信託受益証券 合計		49,781,023,913	4,196,540,315	
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	6,365,626	6,410,185	
親投資信託受益証券 合計		6,365,626	6,410,185	
合計			4,202,950,500	

(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、証券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。

【新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第18期 令和1年9月25日現在	第19期 令和2年3月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	48,441	48,205
親投資信託受益証券	949,612	949,706
流動資産合計	998,053	997,911
資産合計	998,053	997,911
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	149	-
未払委託者報酬	87	182
流動負債合計	236	182
負債合計	236	182
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,183	2,271
(分配準備積立金)	12,404	16,983
元本等合計	997,817	997,729
純資産合計	997,817	997,729
負債純資産合計	998,053	997,911

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	第19期 自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	283	94
営業収益合計	283	94
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	149	-
委託者報酬	87	182
営業費用合計	237	182
営業利益又は営業損失（ ）	520	88
経常利益又は経常損失（ ）	520	88
当期純利益又は当期純損失（ ）	520	88
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（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,663	2,183
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
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	-	-
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	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,183	2,271

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第19期	
	自 令和1年9月26日	至 令和2年3月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第18期	第19期
	令和1年9月25日現在	令和2年3月25日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 受益権の総数	1,000,000口	1,000,000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2,183円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,271円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期	第19期
	自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,528円)、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(6,727円)及び分配準備積立金(9,876円)より分配対象収益は19,131円(1万口当たり191.31円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,579円)、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(6,727円)及び分配準備積立金(12,404円)より分配対象収益は23,710円(1万口当たり237.10円)ですが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第18期 自 平成31年3月26日 至 令和1年9月25日	第19期 自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、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「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期 令和1年9月25日現在	第19期 令和2年3月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第18期 令和1年9月25日現在	第19期 令和2年3月25日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	283	94
合計	283	94

（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。

（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口当たり情報に関する注記)

	第18期 令和1年9月25日現在	第19期 令和2年3月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9978円 (9,978円)	0.9977円 (9,977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

令和2年3月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内短期公社債マザーファンド	943,105	949,706	
親投資信託受益証券	合計	943,105	949,706	
合計			949,706	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券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)

「新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース」、「新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース」、「新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース」は、「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - USDクラス」投資信託証券、「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - AUDクラス」投資信託証券、「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - BRLクラス」投資信託証券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、すべてこれらの証券であります。

「新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース」、「新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース」、「新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース」、「新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド」は、「国内短期公社債マザーファンド」受益証券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、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内短期公社債マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

令和2年3月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	19,726,485
地方債証券	60,012,343
未収利息	409,224
流動資産合計	80,148,052
資産合計	80,148,052
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	79,591,729
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	556,323
元本等合計	80,148,052
純資産合計	80,148,052
負債純資産合計	80,148,052

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年9月26日
	至 令和2年3月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	地方債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年3月25日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	146,585,233円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	66,993,504円
元本の内訳	
ファンド名	
ハイブリッド証券ファンド円コース	27,208,015円
ハイブリッド証券ファンド米ドルコース	3,391,713円
ハイブリッド証券ファンド豪ドルコース	4,489,701円
ハイブリッド証券ファンドブラジルリアルコース	16,175,679円
ハイブリッド証券ファンドロシアルーブルコース	2,324,574円
ハイブリッド証券ファンドインドルピーコース	2,228,133円
ハイブリッド証券ファンド中国元コース	1,130,574円
ハイブリッド証券ファンド南アフリカランドコース	236,700円
ハイブリッド証券ファンドマネープールファンド	2,792,565円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド円コース	1,392,481円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース	298,389円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース	1,193,555円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース	6,365,626円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド	943,105円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドメキシコペソコース	99,207円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンドトルコリラコース	99,207円
ハイブリッド証券ファンドメキシコペソコース	8,032,854円
ハイブリッド証券ファンドトルコリラコース	1,090,474円
新光グローバル・ハイイールド債券ファンド(年1回決算型)	99,177円
計	79,591,729円
2. 受益権の総数	79,591,729口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 令和1年9月26日 至 令和2年3月25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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、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「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年3月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年3月25日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
地方債証券	-	
合計	-	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（令和1年11月1日から令和2年3月25日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(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口当たり情報に関する注記)

令和2年3月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0070円 (10,070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

令和2年3月25日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
地方債証券	336回 大阪府公募公債	20,000,000	20,003,943	
	20年度9回 奈良県債	40,000,000	40,008,400	
地方債証券 合計		60,000,000	60,012,343	
合計			60,012,343	

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)

「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - USDクラス」、「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - AUDクラス」及び「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド - BRLクラス」は、「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド」の個別クラスとなっております。

「WAグローバル・ハイ・イールド・ボンド(マルチ・カレンシー)ファンド」はケイマン諸島の法律に基づき設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの2019年3月31日現在の財務書類は、米国で一般的に認められている会計基準に準拠して作成されており、独立監査人の監査を受けております。

同ファンドの「資産・負債計算書」及び「投資明細表」は、2019年3月31日現在の財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものでありますが、あくまで参考和訳であり、正確性を保証するものではありません。

資産・負債計算書

2019年3月31日現在

(日本円表示)

資産

有価証券投資 - 評価額(取得原価11,704,754,009円)	11,391,795,928円
外貨現金および外貨現金同等物 - 評価額(取得原価395,053,557円)	395,631,986円
ブローカーに対する債権	151,933,370円
未収利息	180,587,938円
為替予約未実現利益	89,133,807円
投資売却未収入金	43,790,814円
未収配当金	34,971円
資産合計	<u>12,252,908,814円</u>

負債

為替予約未実現損失	449,266,917円
投資購入未払金	177,001,273円
未払管理会社報酬	13,360,273円
未払費用	22,366,705円
負債合計	<u>661,995,168円</u>
償還可能受益証券の保有者に帰属する純資産	<u>11,590,913,646円</u>

J P Yクラス

1,486,740,290円 / 2,264,840,462円 0.656円

U S Dクラス

352,324,374円 / 303,744,821円 1.160円

A U Dクラス

1,508,647,882円 / 3,038,019,385円 0.497円

B R Lクラス

7,845,715,460円 / 54,727,518,539円 0.143円

M X Nクラス

151,200,893円 / 266,406,013円 0.568円

T R Yクラス

246,284,747円 / 807,218,259円 0.305円

投資明細表

2019年3月31日現在

（日本円表示）

	元本金額**	利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)
USD	300,000	7.500	2027/01/24	30,381,020	29,428,888
USD	1,000,000	6.950	2027/07/21	100,442,437	98,699,502
USD	900,000	6.750	2025/05/02	94,300,456	94,233,536
				225,123,913	222,361,926
USD	932,290	11.500	2018/02/15	68,854,670	10,319
				68,854,670	10,319
USD	548,000	7.250	2025/02/01	64,979,231	65,899,502
				64,979,231	65,899,502
USD	524,000	4.750	2021/12/15	61,080,953	58,794,134
USD	200,000	6.250	2025/05/15	22,725,848	22,578,860
USD	130,000	5.875	2027/09/15	14,322,721	14,035,971
USD	370,000	5.000	2028/02/15	39,524,174	40,030,437
				137,653,696	135,439,402
				137,653,696	135,439,402
USD	350,000	5.650	2022/03/19	40,114,080	40,481,848
				40,114,080	40,481,848
USD	800,000	7.250	2022/05/15	88,931,275	89,429,994
USD	500,000	7.625	2025/01/15	58,728,390	57,069,729
				147,659,665	146,499,723
USD	270,000	6.375	2023/01/30	29,420,083	27,754,566
USD	740,000	7.000	2024/03/31	77,926,921	76,784,726
				107,347,004	104,539,292
USD	470,000	7.000	2024/03/15	54,995,649	55,167,128
USD	850,000	4.250	2024/05/15	92,244,140	93,372,994
				402,246,458	399,579,137
USD	750,000	5.375	2025/01/15	83,112,392	84,463,199

元本金額**		利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)
	運送およびリース - 0.9%				
USD	220,000Park Aerospace Holdings Ltd. 144A	5.250	2022/08/15	25,273,524	25,016,934
USD	670,000Park Aerospace Holdings Ltd. 144A	5.500	2024/02/15	76,911,384	77,170,504
				102,184,908	102,187,438
	ケイマン諸島合計				
	デンマーク - 0.2%				
	銀行 - 0.2%				
USD	200,000Danske Bank A/S 144A	5.375	2024/01/12	21,640,390	23,035,962
	デンマーク合計				
	フランス - 2.9%				
	銀行 - 1.2%				
USD	820,000BNP Paribas SA 144A ~	7.375	-	97,482,975	96,402,867
USD	340,000Credit Agricole SA 144A ~	8.125	-	40,099,068	42,371,150
				137,582,043	138,774,017
	電気通信 - 1.7%				
USD	740,000Altice France SA/France 144A	6.250	2024/05/15	82,072,851	82,825,125
USD	820,000Altice France SA/France 144A	7.375	2026/05/01	91,953,751	89,169,895
USD	200,000Altice France SA/France 144A	8.125	2027/02/01	21,939,242	22,440,509
				195,965,844	194,435,529
	フランス合計				
	ドイツ - 0.3%				
	製薬 - 0.3%				
EUR	310,000Nidda BondCo GmbH	5.000	2025/09/30	42,483,263	36,841,647
	ドイツ合計				
	アイルランド - 1.3%				
	梱包およびコンテナ - 1.3%				
USD	260,000Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA Inc. 144A	4.625	2023/05/15	28,452,679	29,028,777
USD	1,100,000Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA Inc. 144A	6.000	2025/02/15	121,265,696	122,053,127
				149,718,375	151,081,904
	アイルランド合計				
	イタリア - 2.7%				
	銀行 - 2.7%				
USD	1,700,000Intesa Sanpaolo SpA 144A MTN	5.017	2024/06/26	173,105,260	181,985,979
USD	700,000Intesa Sanpaolo SpA 144A MTN	5.710	2026/01/15	71,944,346	75,705,032
USD	540,000UniCredit SpA 144A MTN ~	7.296	2034/04/02	59,668,508	60,337,257
				304,718,114	318,028,268
	イタリア合計				
	チャンネル諸島ジャージー - 0.9%				
	自動車部品および装備品 - 0.3%				
USD	400,000Adient Global Holdings Ltd. 144A	4.875	2026/08/15	31,792,058	32,650,802
	総合金融サービス - 0.2%				
EUR	200,000LHC3 PLC PIK	4.125	2024/08/15	25,982,499	25,280,139

元本金額**		利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)
	保険 - 0.4%				
GBP	330,000Galaxy Bidco Ltd.	6.375	2020/11/15	60,946,679	47,408,048
	チャンネル諸島ジャージー合計			118,721,236	105,338,989
	ルクセンブルグ - 4.6%				
	化学 - 0.4%				
EUR	400,000Monitchem HoldCo 2 SA	6.875	2022/06/15	54,945,508	45,183,942
	総合金融サービス - 0.4%				
EUR	400,000Garfunkelux Holdco 3 SA	7.500	2022/08/01	51,946,019	45,866,816
	マスメディア - 1.8%				
USD	1,940,000Altice Luxembourg SA 144A	7.750	2022/05/15	212,412,710	215,525,733
	石油およびガス - 0.5%				
USD	500,000Ultrapar International SA 144A	5.250	2026/10/06	55,669,174	55,893,747
	梱包およびコンテナ - 1.0%				
USD	782,005ARD Securities Finance SARL PIK 144A	8.750	2023/01/31	86,585,030	82,225,208
EUR	280,000Hercule Debtco SARL PIK 144A	6.750	2024/06/30	38,466,425	32,694,507
				125,051,455	114,919,715
	電気通信 - 0.5%				
USD	520,000Intelsat Jackson Holdings SA 144A	8.000	2024/02/15	58,901,791	60,143,885
	ルクセンブルグ合計			558,926,657	537,533,838
	マーシャル諸島 - 0.5%				
	運輸 - 0.5%				
USD	600,000Navios Maritime Acquisition Corp./Navios Acquisition Finance US Inc. 144A	8.125	2021/11/15	61,497,652	52,794,687
	マーシャル諸島合計			61,497,652	52,794,687
	メキシコ - 1.4%				
	銀行 - 1.1%				
USD	200,000Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman 144A ~	6.875	-	22,517,451	22,081,018
USD	1,010,000BBVA Bancomer SA/Texas 144A ~	5.125	2033/01/18	101,676,504	103,207,803
				124,193,955	125,288,821
	建材 - 0.3%				
USD	330,000Cemex SAB de CV 144A	6.125	2025/05/05	40,249,861	37,894,300
	メキシコ合計			164,443,816	163,183,121
	オランダ - 5.6%				
	アパレル - 0.3%				
EUR	330,000CBR Fashion Finance BV	5.125	2022/10/01	45,038,560	39,029,616
	鉱業 - 0.6%				
USD	320,000Alcoa Nederland Holding BV 144A	7.000	2026/09/30	33,196,700	38,361,749
USD	270,000Alcoa Nederland Holding BV 144A	6.125	2028/05/15	29,719,208	30,855,008
				62,915,908	69,216,757
	石油およびガス - 2.4%				
USD	1,000,000Petrobras Global Finance BV	5.999	2028/01/27	110,248,352	112,285,556
USD	750,000Petrobras Global Finance BV	5.750	2029/02/01	81,084,807	82,429,441
USD	800,000Petrobras Global Finance BV	6.850	2115/06/05	80,748,446	85,972,330
				272,081,605	280,687,327

元本金額**		利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)
	製薬 - 1.5%				
USD	1,740,000Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	2.800	2023/07/21	175,141,628	171,925,648
	小売 - 0.8%				
EUR	411,000Maxeda DIY Holding BV	6.125	2022/07/15	52,438,792	50,127,084
EUR	300,000Maxeda DIY Holding BV 144A	6.125	2022/07/15	39,807,689	36,589,113
				92,246,481	86,716,197
	オランダ合計			647,424,182	647,575,545
	ペルー - 0.7%				
	パイプライン - 0.7%				
USD	750,000Transportadora de Gas del Peru SA 144A	4.250	2028/04/30	82,604,405	84,411,317
	ペルー合計			82,604,405	84,411,317
	スペイン - 0.3%				
	小売 - 0.3%				
EUR	150,000Tendam Brands SAU 144A	5.000	2024/09/15	19,900,210	18,734,974
EUR	140,000Tendam Brands SAU 144A ~	5.250	2024/09/15	18,229,167	17,341,121
				38,129,377	36,076,095
	スペイン合計			38,129,377	36,076,095
	トルコ - 0.2%				
	電気通信 - 0.2%				
USD	180,000Turk Telekomunikasyon AS 144A	6.875	2025/02/28	19,799,254	19,134,010
	トルコ合計			19,799,254	19,134,010
	英国 - 3.7%				
	銀行 - 0.8%				
USD	750,000Barclays Bank PLC	7.625	2022/11/21	91,130,965	90,322,496
	総合金融サービス - 0.3%				
USD	342,000Travelport Corporate Finance PLC 144A	6.000	2026/03/15	36,946,892	40,975,650
	娯楽 - 0.2%				
USD	200,000International Game Technology PLC 144A	6.500	2025/02/15	24,585,306	23,132,263
	持株会社 - 総合 - 0.4%				
GBP	320,000Co-operative Group Holdings 2011 Ltd. #	7.500	2026/07/08	45,187,743	51,660,176
	レジャー - 0.7%				
GBP	130,000Pinnacle Bidco PLC 144A	6.375	2025/02/15	20,132,917	19,336,867
GBP	450,000Saga PLC	3.375	2024/05/12	62,361,629	58,519,602
				82,494,546	77,856,469
	マスメディア - 0.8%				
USD	850,000Virgin Media Secured Finance PLC 144A	5.500	2026/08/15	92,685,567	95,960,155
	石油およびガスサービス - 0.5%				
USD	550,000KCA Deutag UK Finance PLC 144A	9.875	2022/04/01	64,940,169	52,656,336
	英国合計			437,971,188	432,563,545
	米国 - 63.7%				
	航空宇宙/防衛 - 0.3%				
USD	350,000BBA US Holdings Inc. 144A	5.375	2026/05/01	38,057,448	39,997,233

元本金額**	利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)	
農業 - 0.2%					
USD 190,000	Altria Group Inc.	5.950	2049/02/14	20,940,823	22,601,219
航空会社 - 0.0%					
USD 310,000	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust	8.388	2020/11/01	25,679	37,561
アパレル - 1.4%					
USD 200,000	Hanesbrands Inc. 144A	4.625	2024/05/15	21,242,698	22,306,586
USD 640,000	Hanesbrands Inc. 144A	4.875	2026/05/15	70,124,176	70,240,620
USD 590,000	Levi Strauss & Co.	5.000	2025/05/01	71,180,222	67,587,161
			162,547,096	160,134,367	
自動車製造会社 - 0.4%					
USD 400,000	JB Poindexter & Co. Inc. 144A	7.125	2026/04/15	43,832,872	44,618,926
自動車部品および装備品 - 0.6%					
USD 130,000	American Axle & Manufacturing Inc.	6.625	2022/10/15	15,037,624	14,766,187
USD 460,000	American Axle & Manufacturing Inc.	6.500	2027/04/01	49,395,786	49,464,638
			64,433,410	64,230,825	
銀行 - 1.8%					
USD 330,000	CIT Group Inc.	6.125	2028/03/09	34,987,277	40,724,958
USD 500,000	Citigroup Inc.	4.125	2028/07/25	55,172,147	55,626,816
USD 1,000,000	Goldman Sachs Group Inc./The	3.500	2026/11/16	108,239,689	109,307,934
			198,399,113	205,659,708	
飲料 - 0.3%					
USD 300,000	Cott Holdings Inc. 144A	5.500	2025/04/01	35,287,524	33,619,258
建材 - 0.8%					
USD 640,000	Standard Industries Inc./NJ 144A	4.750	2028/01/15	66,519,857	67,825,125
USD 200,000	US Concrete Inc.	6.375	2024/06/01	22,823,737	22,523,520
			89,343,594	90,348,645	
化学 - 1.1%					
USD 420,000	Olin Corp.	5.125	2027/09/15	46,472,372	47,241,284
USD 500,000	Valvoline Inc.	5.500	2024/07/15	54,835,322	56,447,150
USD 270,000	Valvoline Inc.	4.375	2025/08/15	30,309,866	28,688,434
			131,617,560	132,376,868	
商業サービス - 4.4%					
USD 250,000	Brink 's Co./The 144A	4.625	2027/10/15	27,093,688	26,770,891
USD 240,000	Carriage Services Inc. 144A	6.625	2026/06/01	26,728,903	27,293,857
USD 650,000	Hertz Corp./The	5.875	2020/10/15	71,903,797	72,014,388
USD 190,000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc. 144A	9.250	2023/05/15	22,708,439	22,133,370
USD 100,000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc. 144A	5.250	2024/04/15	11,085,246	11,095,739
USD 570,000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc. 144A	5.750	2026/04/15	62,924,504	63,258,960
USD 745,000	Service Corp. International/US	4.625	2027/12/15	84,488,674	82,250,968
USD 230,000	ServiceMaster Co. LLC/The	7.450	2027/08/15	27,147,055	26,920,310
USD 320,000	ServiceMaster Co. LLC/The 144A	5.125	2024/11/15	34,442,905	35,639,181
USD 190,000	United Rentals North America Inc.	5.750	2024/11/15	21,581,126	21,686,497
USD 180,000	United Rentals North America Inc.	6.500	2026/12/15	20,290,447	21,018,262

元本金額**	利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)	
USD 500,000	United Rentals North America Inc.	4.875	2028/01/15	55,107,721	53,967,903
USD 440,000	Weight Watchers International Inc. 144A	8.625	2025/12/01	49,388,010	43,951,300
	コンピューター - 1.0%			514,890,515	508,001,626
USD 230,000	Dell International LLC/EMC Corp. 144A	5.875	2021/06/15	24,965,995	25,943,686
USD 360,000	Dell International LLC/EMC Corp. 144A	7.125	2024/06/15	40,351,754	42,250,848
USD 480,000	Western Digital Corp.	4.750	2026/02/15	50,112,723	50,868,843
	総合金融サービス - 1.8%			115,430,472	119,063,377
USD 500,000	Ally Financial Inc.	8.000	2031/11/01	66,232,618	68,967,903
USD 610,000	ASP AMC Merger Sub Inc. 144A	8.000	2025/05/15	67,004,946	30,719,424
USD 420,000	Lions Gate Capital Holdings LLC	5.875	2024/11/01	46,610,174	48,054,787
USD 340,000	Navient Corp.	6.625	2021/07/26	35,579,740	39,418,926
USD 200,000	Navient Corp.	6.750	2025/06/25	22,217,899	22,004,427
	エンジニアリングおよび建設 - 0.7%			237,645,377	209,165,467
USD 240,000	frontdoor Inc. 144A	6.750	2026/08/15	26,868,987	27,227,449
USD 530,000	TopBuild Corp. 144A	5.625	2026/05/01	57,050,269	58,074,156
	娯楽 - 0.6%			83,919,256	85,301,605
USD 200,000	Boyne USA Inc. 144A	7.250	2025/05/01	21,389,778	23,796,348
USD 390,000	Speedway Motorsports Inc.	5.125	2023/02/01	47,059,427	43,543,165
	環境管理 - 0.3%			68,449,205	67,339,513
USD 350,000	Waste Pro USA Inc. 144A	5.500	2026/02/15	38,781,619	37,479,247
	食品 - 0.9%				
USD 510,000	Lamb Weston Holdings Inc. 144A	4.875	2026/11/01	56,523,291	57,505,534
USD 460,000	Pilgrim's Pride Corp. 144A	5.875	2027/09/30	48,716,317	51,422,247
	林産品および紙 - 0.3%			105,239,608	108,927,781
USD 310,000	Mercer International Inc.	5.500	2026/01/15	35,181,772	33,796,348
	ゲーム - 0.2%				
USD 230,000	Scientific Games International Inc. 144A	5.000	2025/10/15	24,904,900	25,011,068
	ガス - 0.3%				
USD 320,000	NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.500	2023/11/01	36,995,349	36,820,365
	ヘルスケア - サービス - 4.0%				
USD 210,000	Air Medical Group Holdings Inc. 144A	6.375	2023/05/15	23,793,409	19,640,288
USD 740,000	Centene Corp.	6.125	2024/02/15	85,783,943	85,921,085
USD 300,000	CHS/Community Health Systems Inc. 144A	8.000	2026/03/15	32,992,620	31,959,048
USD 1,090,000	HCA Inc.	5.625	2028/09/01	120,308,728	127,880,465
USD 680,000	Magellan Health Inc.	4.900	2024/09/22	71,648,164	71,800,775
USD 320,000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc. 144A	8.250	2023/05/01	37,901,725	37,697,842
USD 750,000	Tenet Healthcare Corp. 144A	6.250	2027/02/01	84,995,238	86,272,828
				457,423,827	461,172,331

元本金額**	利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)	
住宅建築 - 0.9%					
USD 360,000	Lennar Corp.	4.500	2024/04/30	39,376,862	40,542,335
USD 540,000	Lennar Corp.	4.750	2027/11/29	61,266,167	60,019,640
				100,643,029	100,561,975
家庭用品 / 雑貨 - 0.8%					
USD 330,000	Central Garden & Pet Co.	6.125	2023/11/15	41,771,194	38,305,202
USD 500,000	Spectrum Brands Inc.	5.750	2025/07/15	63,743,807	56,032,097
				105,515,001	94,337,299
保険 - 0.2%					
USD 230,000	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc. 144A	5.500	2025/05/01	24,535,607	25,679,303
インターネット - 1.7%					
USD 600,000	Cogent Communications Group Inc. 144A	5.375	2022/03/01	68,597,990	68,234,643
USD 340,000	Match Group Inc.	6.375	2024/06/01	39,037,763	39,701,162
USD 240,000	Match Group Inc. 144A	5.000	2027/12/15	26,814,822	26,895,407
USD 210,000	Netflix Inc.	5.875	2025/02/15	25,185,380	25,175,595
USD 310,000	Netflix Inc. 144A	6.375	2029/05/15	34,783,035	37,184,560
				194,418,990	197,191,367
宿泊 - 0.7%					
USD 250,000	Hilton Worldwide Finance LLC/Hilton Worldwide Finance Corp.	4.625	2025/04/01	28,807,211	28,016,049
USD 500,000	Hilton Worldwide Finance LLC/Hilton Worldwide Finance Corp.	4.875	2027/04/01	56,443,731	56,170,448
				85,250,942	84,186,497
建設機械および鉱業 - 0.3%					
USD 280,000	BWX Technologies Inc. 144A	5.375	2026/07/15	31,247,189	31,610,404
マスメディア - 7.1%					
USD 440,000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp. 144A	5.875	2027/05/01	53,380,990	50,662,092
USD 370,000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp. 144A	5.125	2027/05/01	41,333,512	41,310,183
USD 940,000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	4.908	2025/07/23	109,541,621	109,875,426
USD 1,300,000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	4.200	2028/03/15	139,817,464	142,909,202
USD 1,000,000	CSC Holdings LLC 144A	6.500	2029/02/01	110,704,527	118,082,457
USD 2,000,000	DISH DBS Corp.	5.875	2024/11/15	184,639,699	186,773,658
USD 1,350,000	DISH DBS Corp.	7.750	2026/07/01	154,162,173	130,368,013
USD 350,000	EW Scripps Co./The 144A	5.125	2025/05/15	39,251,792	36,995,019
				832,831,778	816,976,050
鉱業 - 2.3%					
USD 350,000	Freeport-McMoRan Inc.	6.875	2023/02/15	40,714,459	41,207,803
USD 160,000	Freeport-McMoRan Inc.	3.875	2023/03/15	14,405,073	17,498,351
USD 100,000	Freeport-McMoRan Inc.	4.550	2024/11/14	10,684,000	10,929,718
USD 750,000	Freeport-McMoRan Inc.	5.400	2034/11/14	74,024,568	75,954,621
USD 1,250,000	Freeport-McMoRan Inc.	5.450	2043/03/15	121,848,552	121,750,138
				261,676,652	267,340,631

元本金額**	利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)	
石油およびガス - 3.7%					
USD 1,290,000	Berry Petroleum Co. LLC ±	6.375	2022/09/15	-	1
USD 430,000	Berry Petroleum Co. LLC 144A	7.000	2026/02/15	48,336,685	47,354,732
USD 1,060,000	Chesapeake Energy Corp.	8.000	2027/06/15	114,994,495	116,148,312
USD 370,000	Diamondback Energy Inc.	4.750	2024/11/01	39,910,866	42,018,650
USD 120,000	Diamondback Energy Inc. 144A	4.750	2024/11/01	13,679,233	13,627,670
USD 420,000	Murphy Oil USA Inc.	5.625	2027/05/01	46,498,730	48,345,324
USD 200,000	Oasis Petroleum Inc. 144A	6.250	2026/05/01	22,233,904	21,140,011
USD 400,000	Range Resources Corp.	5.875	2022/07/01	42,295,577	44,936,359
USD 320,000	Range Resources Corp.	4.875	2025/05/15	32,031,877	33,027,117
USD 300,000	Whiting Petroleum Corp.	6.250	2023/04/01	33,695,540	33,536,248
USD 180,000	WPX Energy Inc.	8.250	2023/08/01	21,824,728	22,512,452
				415,501,635	422,646,876
梱包およびコンテナ - 1.9%					
USD 610,000	Berry Global Inc. 144A	4.500	2026/02/15	66,597,923	64,321,749
USD 370,000	Greif Inc. 144A	6.500	2027/03/01	40,729,470	41,975,650
USD 770,000	Pactiv LLC	8.375	2027/04/15	83,581,015	87,354,732
USD 250,000	Reynolds Group Issuer Inc./Reynolds Group Issuer LLC 144A ~	6.287	2021/07/15	26,655,621	27,843,110
				217,564,029	221,495,241
製薬 - 2.8%					
USD 240,000	Bausch Health Americas Inc. 144A	9.250	2026/04/01	28,618,645	29,134,698
USD 1,010,000	Bausch Health Americas Inc. 144A	8.500	2027/01/31	116,192,177	118,774,211
USD 700,000	BioScrip Inc.	8.875	2021/02/15	85,573,284	78,638,628
USD 280,000	Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco Inc. 144A	6.000	2025/02/01	24,910,774	22,569,828
USD 280,000	HLF Financing SARL LLC/Herbalife International Inc. 144A	7.250	2026/08/15	31,268,316	31,959,048
USD 380,000	NVA Holdings Inc./United States 144A	6.875	2026/04/01	41,036,056	41,795,794
				327,599,252	322,872,207
パイプライン - 3.1%					
USD 210,000	Andeavor Logistics LP/Tesoro Logistics Finance Corp.	5.250	2025/01/15	24,076,530	24,148,525
USD 800,000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp. 144A	6.625	2026/07/15	89,241,937	90,758,163
USD 70,000	Energy Transfer Operating LP	4.500	2024/04/15	7,577,789	8,082,531
USD 70,000	Energy Transfer Operating LP	5.250	2029/04/15	7,587,929	8,315,436
USD 490,000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.625	2024/06/15	54,295,782	52,335,362
USD 120,000	Rockies Express Pipeline LLC 144A	7.500	2038/07/15	15,741,029	14,971,112
USD 350,000	Rockies Express Pipeline LLC 144A	6.875	2040/04/15	35,289,485	41,770,282
USD 900,000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	5.375	2027/02/01	98,259,929	102,351,965
USD 40,000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp. 144A	6.500	2027/07/15	4,339,628	4,786,940
USD 60,000	Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp. 144A	6.875	2029/01/15	6,500,583	7,230,216
				342,910,621	354,750,532

元本金額**	利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)
不動産 - 0.9%				
USD 600,000				
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp. 144A				
	7.875	2025/11/15	68,849,547	63,752,075
USD 430,000				
WeWork Cos Inc. 144A				
	7.875	2025/05/01	46,999,672	44,023,243
			115,849,219	107,775,318
不動産投資信託 - 2.3%				
USD 260,000				
CoreCivic Inc.				
	5.000	2022/10/15	25,276,998	28,453,237
USD 510,000				
CoreCivic Inc.				
	4.750	2027/10/15	57,258,337	48,227,316
USD 330,000				
CTR Partnership LP/CareTrust Capital Corp.				
	5.250	2025/06/01	38,533,142	36,754,366
USD 560,000				
ESH Hospitality Inc. 144A				
	5.250	2025/05/01	68,515,947	61,722,723
USD 520,000				
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/MGP Finance Co.-Issuer Inc.				
	4.500	2026/09/01	52,985,531	56,258,993
USD 310,000				
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.				
	5.250	2026/08/01	32,767,637	35,469,009
			275,337,592	266,885,644
小売 - 5.6%				
USD 520,000				
Beacon Roofing Supply Inc. 144A				
	4.875	2025/11/01	59,154,501	54,604,317
USD 360,000				
Brinker International Inc. 144A				
	5.000	2024/10/01	36,699,043	39,248,168
USD 570,000				
Carrols Restaurant Group Inc.				
	8.000	2022/05/01	66,829,619	64,617,875
USD 660,000				
FirstCash Inc. 144A				
	5.375	2024/06/01	74,891,516	75,058,838
USD 300,000				
Golden Nugget Inc. 144A				
	8.750	2025/10/01	33,651,197	34,947,427
USD 630,000				
Party City Holdings Inc. 144A				
	6.625	2026/08/01	70,211,329	69,554,510
USD 1,930,000				
PetSmart Inc. 144A				
	5.875	2025/06/01	189,045,163	179,969,563
USD 680,000				
Sally Holdings LLC/Sally Capital Inc.				
	5.625	2025/12/01	73,295,056	75,074,709
USD 580,000				
Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp.				
	5.875	2027/03/01	64,011,701	61,145,545
			667,789,125	654,220,952
半導体 - 0.3%				
USD 290,000				
Amkor Technology Inc. 144A				
	6.625	2027/09/15	32,120,697	32,639,043
ソフトウェア - 1.2%				
USD 420,000				
CDK Global Inc.				
	5.875	2026/06/15	46,583,895	48,940,343
USD 540,000				
First Data Corp. 144A				
	5.000	2024/01/15	66,575,624	61,351,411
USD 270,000				
j2 Cloud Services LLC/j2 Global Co.-Obligor Inc. 144A				
	6.000	2025/07/15	30,935,375	31,153,846
			144,094,894	141,445,600
ソブリンおよびエージェンシー - 2.3%				
USD 1,400,000				
United States Treasury Note/Bond				
	1.750	2022/03/31	151,414,724	152,761,830
USD 335,000				
United States Treasury Note/Bond				
	2.000	2023/02/15	36,416,359	36,752,148
USD 740,000				
United States Treasury Note/Bond				
	2.125	2024/02/29	80,989,698	81,420,603
			268,820,781	270,934,581
電気通信 - 2.9%				
USD 350,000				
CommScope Technologies LLC 144A				
	5.000	2027/03/15	40,444,125	34,445,268
USD 500,000				
Sprint Capital Corp.				
	6.875	2028/11/15	54,196,772	53,334,256
USD 220,000				
Sprint Capital Corp.				
	8.750	2032/03/15	27,570,486	25,752,297
USD 900,000				
Sprint Corp.				
	7.875	2023/09/15	94,383,365	104,593,248
USD 520,000				
T-Mobile USA Inc.				
	6.000	2024/04/15	60,997,170	59,928,058
USD 500,000				
T-Mobile USA Inc.				
	6.375	2025/03/01	57,673,068	57,764,250
			335,264,986	335,817,377

元本金額**	利率 (%)	償還日	取得原価 (円)	評価額 (円)
運輸 - 0.6%				
USD 620,000				
Neovia Logistics Services LLC/SPL Logistics Finance Corp. 144A				
	8.875	2020/08/01	65,750,637	65,534,034
運送およびリース - 0.7%				
USD 426,000				
DAE Funding LLC 144A				
	4.500	2022/08/01	48,246,965	47,621,472
USD 340,000				
DAE Funding LLC 144A				
	5.750	2023/11/15	37,520,126	38,760,376
			85,767,091	86,381,848
米国合計			7,433,836,766	7,386,986,117
債券合計			11,539,731,910	11,378,217,362

株式数	取得原価 (円)	評価額 (円)
普通株式 - 0.1%		
米国 - 0.1%		
石油およびガス - 0.1%		
1,606		
MMO Holdings LLC *		
	165,022,099	13,578,566
米国合計		
	165,022,099	13,578,566
普通株式合計		
	165,022,099	13,578,566
投資合計 - 98.3%		
	11,704,754,009	11,391,795,928
その他の資産(負債控除後) - 1.7%		
		199,117,718
純資産 - 100.0%		
		11,590,913,646

144A 有価証券は、1933年証券法規則144Aに基づき登録が免除されています。これらの有価証券は、登録免除取引において、通常、適格機関購入者への転売が可能です。

MTN ミディアム・ターム・ノート

PIK ペイメント・イン・カインド(payment in kind)

REIT 不動産投資信託

有価証券は、永久債であり償還日が確定していません。

~ 変動利付有価証券。開示されている率は、2019年3月31日現在適用されていたものです。

ステップ・アップ債を意味します。示されている率は、2019年3月31日時点の表面利率です。

± 示されている償還日は、当該有価証券の当初の償還日です。有価証券は、現在破産状態にあり、最終的な回収金額が破産手続を通じて確定するまで、引き続き報告される予定です。

* 無利息証券です。

** 示されている現地通貨で表示されています。

為替予約

決済日	相手方	約定引渡額	交換額***	未実現利益(損失) (円)
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	AUD 18,825,791 JPY	1,483,007,971	2,876,572
2019/04/02	UBS AG	AUD 367,528 JPY	29,027,816	131,830
2019/04/02	Citibank, N.A.	BRL 242,942,279 JPY	6,934,951,848	25,330,716
2019/04/02	Citibank, N.A.	BRL 252,336,599 JPY	7,165,926,700	(10,882,146)
2019/04/02	Goldman Sachs International	BRL 35,240,310 JPY	1,005,627,856	3,343,726
2019/04/02	Goldman Sachs International	BRL 35,240,310 JPY	1,000,955,088	(1,329,042)
2019/05/03	Goldman Sachs International	BRL 2,979,000 JPY	82,670,153	(1,667,795)
2019/05/14	Citibank, N.A.	CAD 290,188 JPY	24,027,279	44,833
2019/05/14	Citibank, N.A.	EUR 1,707,465 JPY	213,988,024	1,775,117
2019/05/14	Goldman Sachs International	EUR 883,539 JPY	110,806,881	995,887
2019/05/14	Morgan Stanley & Co. International plc	EUR 210,921 JPY	26,474,333	259,923
2019/05/14	UBS AG	EUR 222,889 JPY	27,885,692	183,870
2019/05/14	Citibank, N.A.	GBP 519,728 JPY	73,725,245	(1,129,002)
2019/05/14	Citibank, N.A.	GBP 290,000 JPY	42,638,393	870,909
2019/05/14	UBS AG	GBP 542,373 JPY	76,952,947	(1,162,828)
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	MXN 26,556,543 JPY	153,827,155	2,291,962
2019/04/02	Goldman Sachs International	TRY 886,477 JPY	17,751,370	383,772
2019/04/02	Goldman Sachs International	TRY 684,900 JPY	13,205,110	(213,251)
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	TRY 276,172 JPY	5,560,156	149,475
2019/04/02	UBS AG	TRY 11,958,615 JPY	230,919,923	(3,369,779)
2019/04/02	Citibank, N.A.	USD 66,242,093 JPY	7,322,514,563	(9,205,704)
2019/04/02	Citibank, N.A.	USD 63,551,066 JPY	7,043,214,989	9,339,391
2019/05/03	Citibank, N.A.	USD 59,357,678 JPY	6,526,061,054	(25,825,172)
2019/05/14	Citibank, N.A.	USD 580,615 JPY	64,558,309	519,260
2019/04/02	Goldman Sachs International	USD 9,043,629 JPY	1,002,284,130	1,329,042
2019/04/02	Goldman Sachs International	USD 25,947,801 JPY	2,862,573,532	(9,346,950)
2019/04/26	Goldman Sachs International	USD 13,454,447 JPY	1,480,992,897	(4,998,366)
2019/04/30	Goldman Sachs International	USD 70,000 JPY	7,458,906	(269,585)
2019/05/03	Goldman Sachs International	USD 9,087,238 JPY	999,235,240	(3,811,933)
2019/04/02	HSBC Bank plc	USD 1,979,412 JPY	218,087,990	(994,711)
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	USD 10,141,890 JPY	1,117,636,432	(4,874,855)
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	USD 26,000 JPY	2,903,131	25,433
2019/04/30	JPMorgan Chase Bank, N.A.	USD 13,433,520 JPY	1,482,393,042	(761,705)
2019/05/03	JPMorgan Chase Bank, N.A.	USD 1,386,242 JPY	152,222,033	(791,023)
2019/04/02	Morgan Stanley & Co. International plc	USD 2,157,715 JPY	237,702,422	(1,114,900)
2019/04/02	UBS AG	USD 488,415 JPY	53,882,272	(175,882)
2019/04/02	UBS AG	USD 50,000 JPY	5,535,021	987
2019/04/30	UBS AG	USD 2,047,361 JPY	233,045,569	7,002,607
				<u>(25,069,317)</u>

決済日	相手方	約定受取額	交換額***	未実現利益(損失) (円)
2019/04/02	Goldman Sachs International	AUD 1,010,058	JPY 79,827,538	(414,257)
2019/04/02	HSBC Bank plc	AUD 2,759,466	JPY 218,087,990	(1,131,747)
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	AUD 12,030,650	JPY 950,814,376	(4,934,158)
2019/04/30	JPMorgan Chase Bank, N.A.	AUD 18,825,791	JPY 1,482,393,042	(5,187,947)
2019/04/02	Morgan Stanley & Co. International plc	AUD 3,007,648	JPY 237,702,422	(1,233,534)
2019/04/02	UBS AG	AUD 385,497	JPY 30,466,859	(158,104)
2019/04/02	Citibank, N.A.	BRL 495,278,878	JPY 14,365,729,552	(279,299,574)
2019/05/03	Citibank, N.A.	BRL 230,156,429	JPY 6,526,061,054	(10,142,670)
2019/04/02	Goldman Sachs International	BRL 70,480,620	JPY 2,044,313,963	(39,745,703)
2019/05/03	Goldman Sachs International	BRL 35,240,310	JPY 999,235,240	(1,552,991)
2019/05/14	Citibank, N.A.	CAD 290,188	JPY 24,265,407	(282,961)
2019/05/14	Citibank, N.A.	EUR 295,000	JPY 37,330,115	(665,929)
2019/05/14	Citibank, N.A.	GBP 20,000	JPY 2,962,787	(82,271)
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	MXN 26,556,542	JPY 151,993,560	(458,367)
2019/05/03	JPMorgan Chase Bank, N.A.	MXN 26,556,543	JPY 152,222,033	(1,855,751)
2019/04/02	Goldman Sachs International	TRY 11,523,490	JPY 235,638,049	(9,873,180)
2019/04/30	Goldman Sachs International	TRY 396,130	JPY 7,458,906	39,496
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	TRY 867,136	JPY 17,731,627	(742,951)
2019/04/02	UBS AG	TRY 1,415,537	JPY 28,950,434	(1,217,635)
2019/04/30	UBS AG	TRY 11,958,615	JPY 233,045,569	(6,679,217)
2019/04/02	Citibank, N.A.	USD 3,300,000	JPY 366,121,999	(875,734)
2019/04/02	Citibank, N.A.	USD 124,223,011	JPY 13,734,756,549	14,331,609
2019/05/14	Citibank, N.A.	USD 2,599,538	JPY 283,271,019	3,445,240
2019/05/14	Citibank, N.A.	USD 640,280	JPY 71,107,922	(488,187)
2019/04/02	Goldman Sachs International	USD 31,916,328	JPY 3,524,866,166	7,654,894
2019/04/02	Goldman Sachs International	USD 160,000	JPY 17,751,370	(42,460)
2019/05/03	Goldman Sachs International	USD 750,000	JPY 82,670,153	114,667
2019/05/14	Goldman Sachs International	USD 1,016,059	JPY 110,806,881	1,259,347
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	USD 14,819,347	JPY 1,636,835,126	3,380,377
2019/04/02	JPMorgan Chase Bank, N.A.	USD 50,000	JPY 5,560,156	(26,122)
2019/05/14	Morgan Stanley & Co. International plc	USD 242,760	JPY 26,474,333	300,887
2019/04/02	UBS AG	USD 260,000	JPY 29,027,816	(250,838)
2019/04/02	UBS AG	USD 2,090,670	JPY 230,919,923	476,894
2019/05/14	UBS AG	USD 962,090	JPY 104,838,639	1,275,084
				(335,063,793)
為替予約に係る未実現純(損失)合計				(360,133,110)

通貨凡例

AUD - オーストラリア・ドル
BRL - ブラジル・リアル
CAD - カナダ・ドル
EUR - ユーロ
GBP - 英ポンド

JPY - 日本円
MXN - メキシコ・ペソ
TRY - トルコ・リラ
USD - 米ドル

*** 特定の契約は日本円に換算されています。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコース

令和2年3月31日現在

資産総額	232,162,477円
負債総額	824,251円
純資産総額(-)	231,338,226円
発行済数量	328,393,110口
1口当たり純資産額(/)	0.7045円

新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコース

令和2年3月31日現在

資産総額	943,520,526円
負債総額	4,821,715円
純資産総額(-)	938,698,811円
発行済数量	3,537,259,414口
1口当たり純資産額(/)	0.2654円

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコース

令和2年3月31日現在

資産総額	4,422,696,473円
負債総額	10,459,585円
純資産総額(-)	4,412,236,888円
発行済数量	37,550,518,077口
1口当たり純資産額(/)	0.1175円

新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネープールファンド

令和2年3月31日現在

資産総額	997,729円
負債総額	6円
純資産総額(-)	997,723円
発行済数量	1,000,000口
1口当たり純資産額(/)	0.9977円

(参考)

国内短期公社債マザーファンド

令和2年3月31日現在

資産総額	94,329,718円
負債総額	14,181,300円
純資産総額(-)	80,148,418円
発行済数量	79,591,729口
1口当たり純資産額(/)	1.0070円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

重要な会計方針

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第34期(2019年3月31日現在)

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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

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

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
子 会 社	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
子 会 社	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

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

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

第2【その他の関係法人の概況】

<訂正前>

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(略)

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社SBI証券(1)	48,323	「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おります。
みずほ証券株式会社(2)	125,167	「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おります。
大山日ノ丸証券株式会社	215	「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おります。
楽天証券株式会社(1)	7,495	「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おります。
東海東京証券株式会社(3)	6,000	「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おります。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

(1) 「マネープールファンド」の取扱いはありません。

(2) 「メキシコペソコース」、「トルコリラコース」の新規の取得のお申込みのお取扱いを行っていません。

(3) 「米ドルコース」、「豪ドルコース」、「メキシコペソコース」、「マネープールファンド」の取扱いはありません。

(略)

<訂正後>

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(略)

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社SBI証券(1)	48,323	「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おります。
みずほ証券株式会社	125,167	「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おります。
大山日ノ丸証券株式会社	215	「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おります。
楽天証券株式会社(1)	7,495	「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おります。
東海東京証券株式会社(2)	6,000	「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おります。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

(1) 「マネープールファンド」の取扱いはありません。

(2) 「米ドルコース」、「豪ドルコース」、「マネープールファンド」の取扱いはありません。

(略)

独立監査人の監査報告書

令和2年5月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコースの令和1年9月26日から令和2年3月25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、新光グローバル・ハイイールド債券ファンド米ドルコースの令和2年3月25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

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

令和2年5月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコースの令和1年9月26日から令和2年3月25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、新光グローバル・ハイイールド債券ファンド豪ドルコースの令和2年3月25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

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

令和2年5月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコースの令和1年9月26日から令和2年3月25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、新光グローバル・ハイイールド債券ファンドブラジルリアルコースの令和2年3月25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

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

令和2年5月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネーブルファンドの令和1年9月26日から令和2年3月25日までの計算期間の財務諸表、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、新光グローバル・ハイイールド債券ファンドマネーブルファンドの令和2年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年5月27日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。