

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2020年11月20日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	D I A M外国債券インデックスファンド< D C 年金 >
<b>【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】</b>	1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。







## 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとしません。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

### (参考)

#### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。



























































































































	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,590,000.000	6,119,144.500	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	8,820,000.000	7,850,406.190	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,856,081.400	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	16,040,000.000	14,065,156.780	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	8,410,000.000	7,892,218.410	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	4,860,000.000	4,442,952.220	
	南アフリカ・ランド 小計	103,700,000.000 (769,454,000)	95,743,898.720 (710,419,729)	
国債証券 合計		112,094,062,500 (112,094,062,500)	127,972,430,109 (127,972,430,109)	
合計			127,972,430,109 (127,972,430,109)	

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 161銘柄	48.25	49.32
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	6.23	6.37
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	1.83	1.88
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	1.82	1.86
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.37	0.37
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	0.20	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.45	0.46
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.19	0.19
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	0.53	0.54
マレーシア・リンギット	国債証券 13銘柄	0.60	0.62
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.74	0.75
ユーロ	国債証券 281銘柄	36.09	36.89
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.54	0.56

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 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。

- ( 1 ) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(令和2年2月22日から令和2年8月21日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【D I A M外国債券インデックスファンド&lt;DC年金&gt;】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 令和2年2月21日現在	第18期中間計算期間末 令和2年8月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,623,277	46,350,833
親投資信託受益証券	11,422,567,885	11,983,637,019
未収入金	9,690,000	4,360,000
流動資産合計	11,466,881,162	12,034,347,852
<b>資産合計</b>	<b>11,466,881,162</b>	<b>12,034,347,852</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	27,480,612	33,474,300
未払受託者報酬	1,789,298	1,879,599
未払委託者報酬	13,121,792	13,784,078
その他未払費用	207,090	209,179
流動負債合計	42,598,792	49,347,156
<b>負債合計</b>	<b>42,598,792</b>	<b>49,347,156</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,108,640,241	6,292,694,212
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,315,642,129	5,692,306,484
(分配準備積立金)	1,700,542,836	1,506,943,162
元本等合計	11,424,282,370	11,985,000,696
<b>純資産合計</b>	<b>11,424,282,370</b>	<b>11,985,000,696</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>11,466,881,162</b>	<b>12,034,347,852</b>

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期中間計算期間 自平成31年2月22日 至令和1年8月21日	第18期中間計算期間 自令和2年2月22日 至令和2年8月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	232,460,290	232,479,134
営業収益合計	232,460,290	232,479,134
営業費用		
支払利息	7,047	9,395
受託者報酬	1,632,545	1,879,599
委託者報酬	11,972,237	13,784,078
その他費用	191,462	209,179
営業費用合計	13,803,291	15,882,251
営業利益又は営業損失( )	218,656,999	216,596,883
経常利益又は経常損失( )	218,656,999	216,596,883
中間純利益又は中間純損失( )	218,656,999	216,596,883
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	6,249,966	15,756,009
期首剰余金又は期首欠損金( )	4,197,184,002	5,315,642,129
剰余金増加額又は欠損金減少額	415,292,473	791,149,821
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	415,292,473	791,149,821
剰余金減少額又は欠損金増加額	255,595,973	646,838,358
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	255,595,973	646,838,358
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,569,287,535	5,692,306,484

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第18期中間計算期間	
	自	至
	令和2年2月22日	令和2年8月21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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期中間計算期間末
	令和2年2月21日現在	令和2年8月21日現在
1. 期首元本額	5,673,551,205円	6,108,640,241円
期中追加設定元本額	1,158,852,464円	929,125,794円
期中一部解約元本額	723,763,428円	745,071,823円
2. 受益権の総数	6,108,640,241口	6,292,694,212口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期 令和2年2月21日現在	第18期中間計算期間末 令和2年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第17期 令和2年2月21日現在	第18期中間計算期間末 令和2年8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8702円 (18,702円)	1.9046円 (19,046円)

## （参考）

当ファンドは、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

令和2年8月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	239,756,134
コール・ローン	810,667,467
国債証券	127,669,455,005
未収入金	199,086,509
未収利息	713,789,480
前払費用	46,013,044
流動資産合計	129,678,767,639
資産合計	129,678,767,639
負債の部	
流動負債	
未払解約金	646,312,200
流動負債合計	646,312,200
負債合計	646,312,200
純資産の部	
元本等	
元本	64,601,674,080
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	64,430,781,359
元本等合計	129,032,455,439
純資産合計	129,032,455,439
負債純資産合計	129,678,767,639





D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	508,977,269円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	4,308,666円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	76,769,634円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	379,661,758円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	506,737,425円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	650,740,388円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	66,602,434円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	6,230,750円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	347,346円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	159,728円
計	64,601,674,080円
2. 受益権の総数	64,601,674,080口

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年8月21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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年8月21日現在
1口当たり純資産額	1.9974円
(1万口当たり純資産額)	(19,974円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

令和2年8月31日現在

資産総額	11,965,295,198円
負債総額	26,614,114円
純資産総額( - )	11,938,681,084円
発行済数量	6,317,873,737口
1口当たり純資産額( / )	1.8897円

(参考)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8月31日現在

資産総額	129,627,584,344円
負債総額	1,105,343,853円
純資産総額( - )	128,522,240,491円
発行済数量	64,847,752,561口
1口当たり純資産額( / )	1.9819円



振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額(2020年8月31日現在)

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の機構(2020年8月31日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役(監査等委員である取締役を除く。)の補欠として選任された取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、現任取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長があたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,233,048,725,219
追加型株式投資信託	859	14,042,319,951,738
単位型公社債投資信託	36	91,165,290,214
単位型株式投資信託	193	1,256,166,938,083
合計	1,114	16,622,700,905,254

### 3【委託会社等の経理状況】

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

## (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	1,461,316	1,278,455
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	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア	885,545	3,299,065
ソフトウェア仮勘定	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	9,269,808	9,482,127
投資有価証券	1,611,931	261,361
関係会社株式	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 (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





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。          退職給付見込額の期間帰属方法          退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。          数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法          過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。          数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生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。



## 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あります。

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あります。

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あります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

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。







## 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。









## (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。



## 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種類株式）	(15,510株)	(15,510株)

（注1）A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】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

## a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

## b. 資本金の額

2020年3月末日現在 247,369百万円

## c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (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「販売会社一覧表」の通りです。

名称	資本金の額 (単位:百万円)	事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
富国生命保険相互会社	(1) 128,000	日本において保険業務を営んでおります。
岡三証券株式会社	5,000	「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。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「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2020年3月末日現在

(1)「基金」および「基金償却積立て額」の総額

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集および販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付





- ・ 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。





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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。