

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年12月10日提出
【発行者名】	SOMPOアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 小嶋 信弘
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋二丁目2番16号
【事務連絡者氏名】	津田 浩平
【電話番号】	03-5290-3432
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	イオン好配当グリーン・バランス・オープン
【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】	募集額 2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2020年6月10日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）につきまして、有価証券報告書の提出に伴い、訂正すべき事項がありましたので、これを訂正するものであります。

## 2【訂正の内容】

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

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

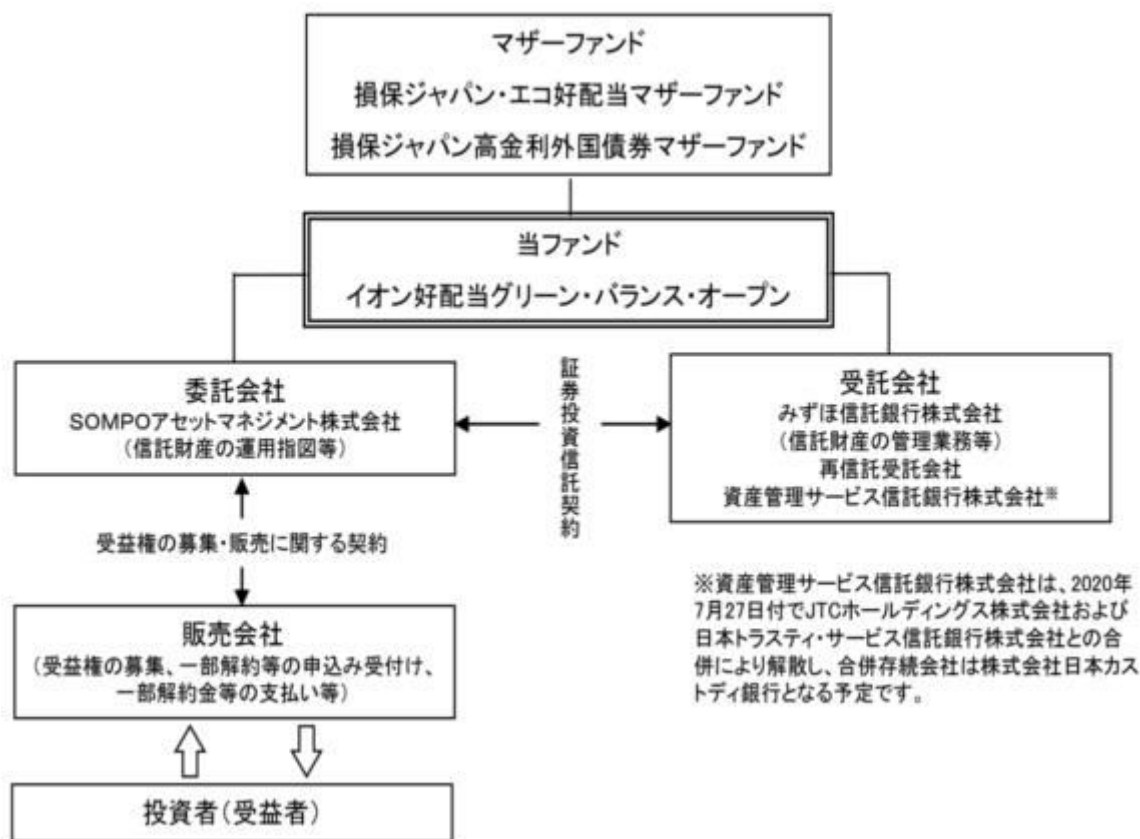
## (3)【ファンドの仕組み】

&lt; 訂正前 &gt;

ファンドの仕組み

(略)

## ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

(略)

( ) 受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社)

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

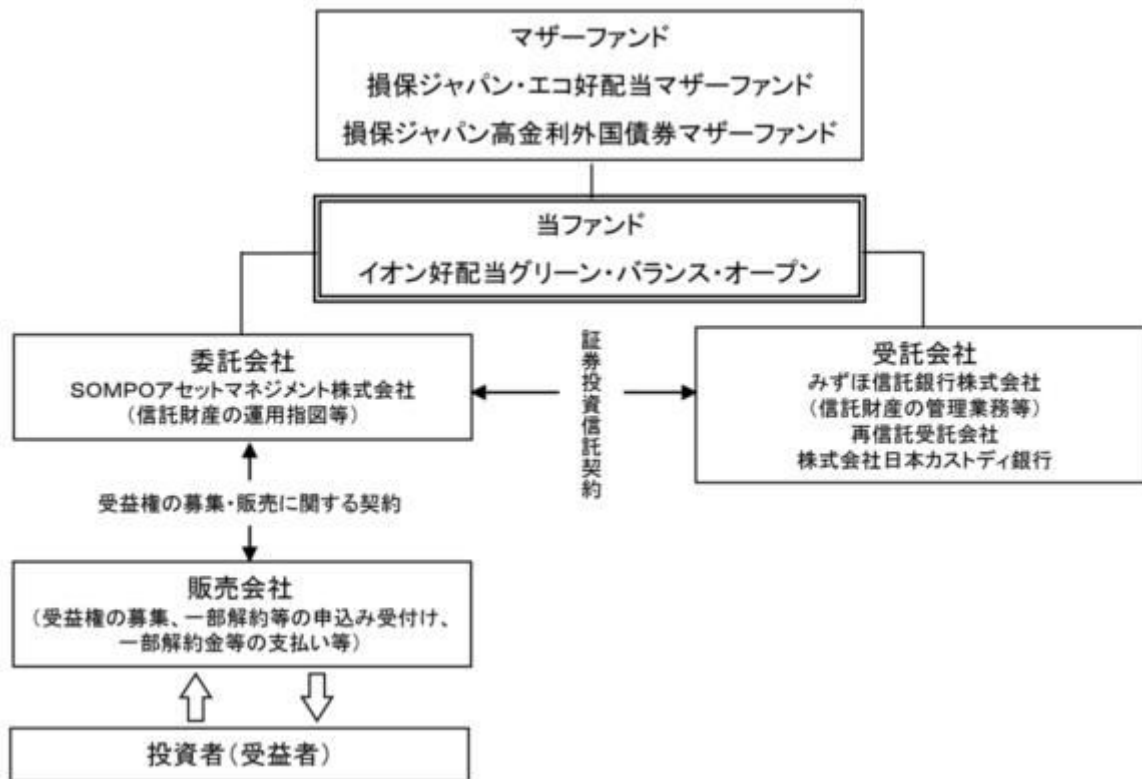
資産管理サービス信託銀行株式会社は、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社との合併により解散し、合併存続会社は株式会社日本カストディ銀行となる予定です。以下同じ。

<訂正後>

ファンドの仕組み

(略)

### ファンドの関係法人図



ファンドの関係法人

(略)

( ) 受託会社または受託者：みずほ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)

委託会社との証券投資信託契約に基づき、当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理業務などを行い、収益分配金、一部解約金及び償還金の交付、また信託財産に関する報告書を作成し委託会社への交付を行います。なお、信託事務の処理の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。

<訂正前>

委託会社等の概況

( ) 資本金の額 1,550百万円 (2020年3月末現在)

(略)

( ) 大株主の状況 (2020年3月末現在)

(略)

<訂正後>

委託会社等の概況

( ) 資本金の額 1,550百万円 (2020年9月末現在)

(略)

( )大株主の状況（2020年9月末現在）

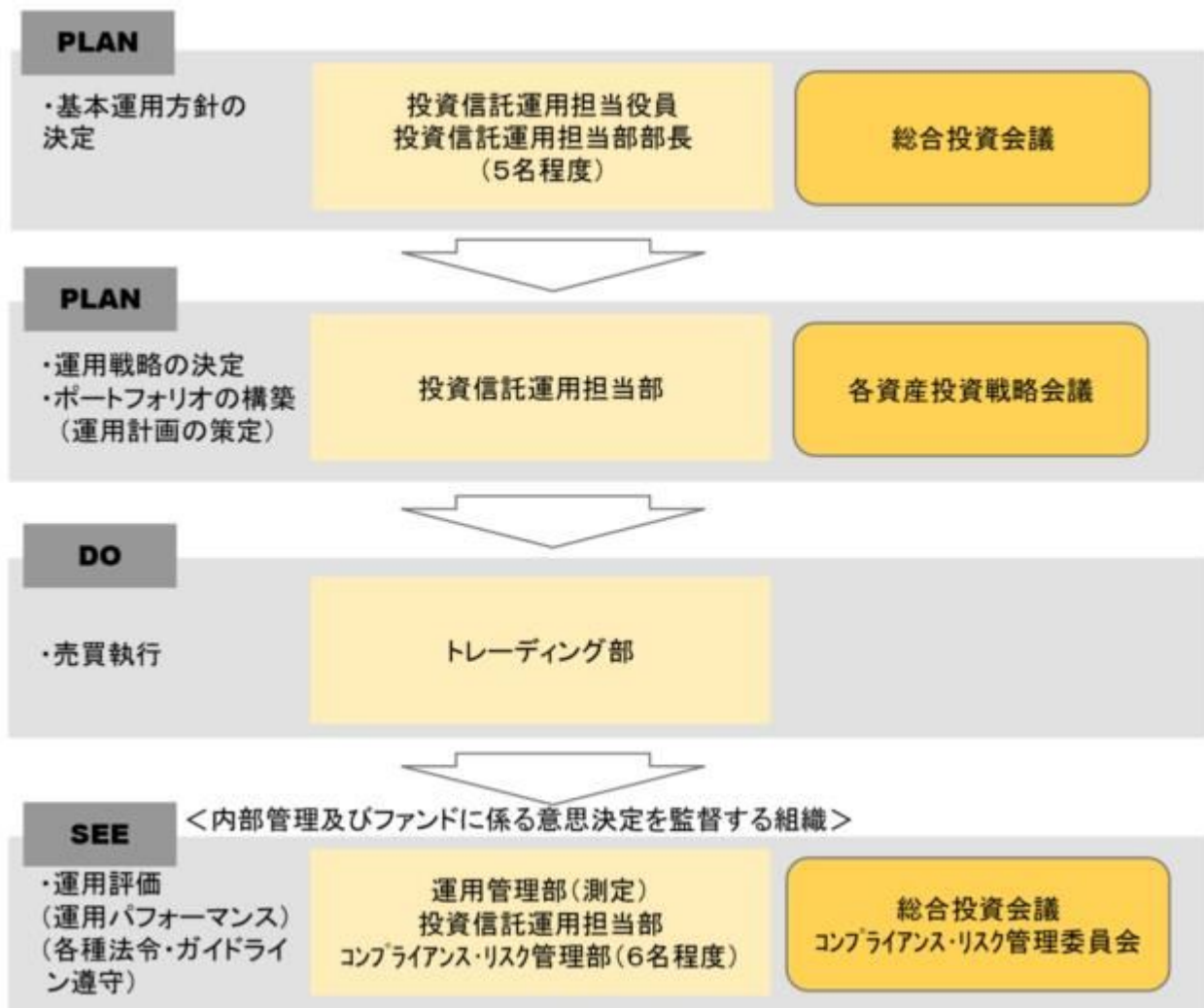
（略）

## 2【投資方針】

### (3)【運用体制】

<訂正前>

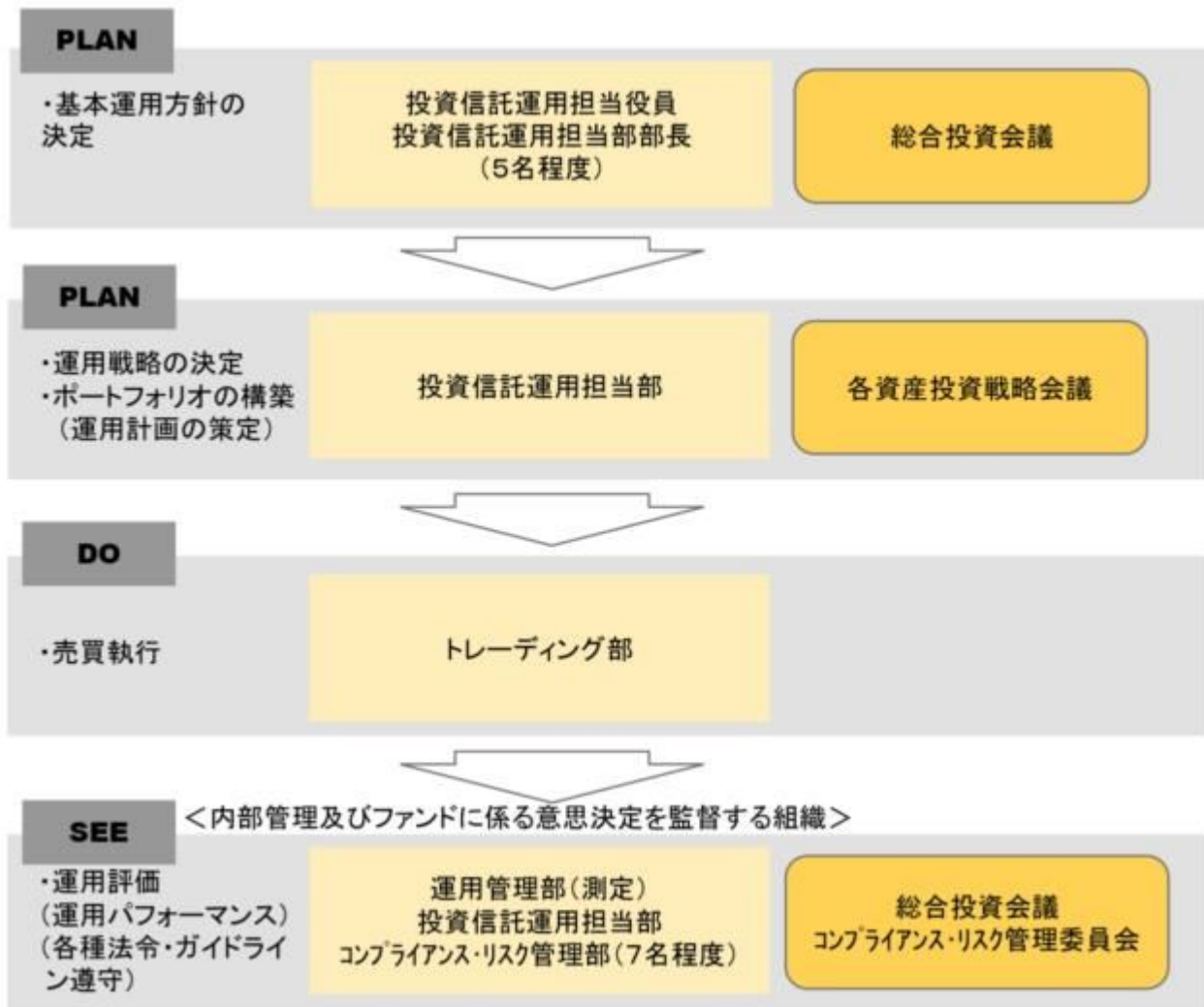
（略）



2020年3月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

<訂正後>

（略）



2020年9月末現在のものであり、今後変更されることもあります。

### 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注) 上図は、2020年3月末現在のものであり、今後変更されることもあります。



- 上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- 上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。

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

#### 代表的な資産クラスの指数

##### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東京証券取引所第一部上場全銘柄の基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。東証株価指数(TOPIX)は、東京証券取引所の知的財産であり、東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

##### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに委託会社が独自に計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

##### 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし、円ベース)

FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

##### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変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

野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

##### 新興国債:JPMオルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)

J.P. Morgan Securities LLCが算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。同指数の著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

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

<訂正後>

(略)

<リスクの管理体制>

(略)

(注)上図は、2020年9月末現在のものであり、今後変更されることもあります。





- 上記は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- 上記は、期間5年の各月末におけるグラフになります。

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

#### 代表的な資産クラスの指数

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は2020年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

(略)

上記は2020年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。



## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## イオン好配当グリーン・バランス・オープン

2020年9月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	795,971,260	99.39
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,849,099	0.61
純資産総額		800,820,359	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド

2020年9月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	824,242,530	97.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		22,364,622	2.64
純資産総額		846,607,152	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

（参考）損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド

2020年9月30日現在

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	158,840,856	37.99
	イギリス	127,922,340	30.60
	オーストラリア	84,127,641	20.12
	ポーランド	27,422,413	6.56
		398,313,250	95.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,773,764	4.73
純資産総額		418,087,014	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）投資資産の内書きの時価および投資比率は、原則として、当該資産の地域別又は発行国籍別の内訳です。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イオン好配当グリーン・バランス・オープン

2020年9月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン高金利外国債券マ ザーファンド	306,479,043	1.3195	404,405,847	1.3136	402,590,870	50.27
2	日本	親投資信託 受益証券	損保ジャパン・エコ好配当マザー ファンド	213,538,373	1.8961	404,890,109	1.8422	393,380,390	49.12

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

2020年9月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.39
合計	99.39

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## (参考) 損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド

2020年9月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	7,700	3,700.93	28,497,161	3,744.00	28,828,800	3.41
2	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	13,400	2,317.44	31,053,696	1,920.00	25,728,000	3.04
3	日本	株式	三井住友フィナンシャル グループ	銀行業	8,600	3,576.43	30,757,298	2,917.50	25,090,500	2.96
4	日本	株式	小松製作所	機械	10,100	2,425.88	24,501,388	2,310.00	23,331,000	2.76
5	日本	株式	麒麟ホールディング ス	食料品	11,800	2,084.44	24,596,507	1,973.50	23,287,300	2.75
6	日本	株式	日本テレビホールディ ングス	情報・通 信業	20,000	1,366.28	27,325,600	1,129.00	22,580,000	2.67
7	日本	株式	東邦ホールディングス	卸売業	9,100	2,404.65	21,882,315	2,262.00	20,584,200	2.43
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	7,800	2,694.81	21,019,518	2,473.50	19,293,300	2.28
9	日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	19,100	1,453.88	27,769,108	989.50	18,899,450	2.23
10	日本	株式	セブン&アイ・ホール ディングス	小売業	5,800	3,906.09	22,655,322	3,250.00	18,850,000	2.23
11	日本	株式	みずほフィナンシャル グループ	銀行業	14,280	1,594.30	22,766,604	1,310.50	18,713,940	2.21

12	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	7,700	2,584.08	19,897,416	2,406.00	18,526,200	2.19
13	日本	株式	日鉄ソリューションズ	情報・通信業	5,600	2,886.78	16,165,968	3,240.00	18,144,000	2.14
14	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	2,800	9,831.78	27,528,984	6,480.00	18,144,000	2.14
15	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	8,300	2,710.76	22,499,308	2,150.00	17,845,000	2.11
16	日本	株式	KDDI	情報・通信業	6,600	3,011.65	19,876,890	2,656.00	17,529,600	2.07
17	日本	株式	日本ハム	食料品	3,600	4,318.46	15,546,456	4,690.00	16,884,000	1.99
18	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	39,700	525.75	20,872,275	416.10	16,519,170	1.95
19	日本	株式	沢井製薬	医薬品	3,100	5,477.80	16,981,180	5,310.00	16,461,000	1.94
20	日本	株式	SUMCO	金属製品	10,900	1,527.21	16,646,635	1,475.00	16,077,500	1.90
21	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	10,800	1,616.54	17,458,632	1,477.00	15,951,600	1.88
22	日本	株式	三菱地所	不動産業	9,800	2,024.86	19,843,628	1,587.00	15,552,600	1.84
23	日本	株式	味の素	食料品	7,000	1,785.74	12,500,180	2,159.00	15,113,000	1.79
24	日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	7,300	1,982.53	14,472,469	2,050.00	14,965,000	1.77
25	日本	株式	ENEOSホールディングス	石油・石炭製品	39,700	476.67	18,923,799	375.00	14,887,500	1.76
26	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	5,000	3,663.57	18,317,850	2,792.50	13,962,500	1.65
27	日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	11,500	1,429.72	16,441,780	1,205.00	13,857,500	1.64
28	日本	株式	三井物産	卸売業	7,600	1,761.99	13,391,124	1,803.00	13,702,800	1.62
29	日本	株式	AGC	ガラス・土石製品	4,200	3,266.81	13,720,602	3,070.00	12,894,000	1.52
30	日本	株式	東レ	繊維製品	26,900	755.11	20,312,459	479.30	12,893,170	1.52

(注1) 評価額組入上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別及び業種別投資比率

2020年9月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	2.91
		食料品	10.08
		繊維製品	1.99
		化学	2.36
		医薬品	6.35
		石油・石炭製品	1.76
		ガラス・土石製品	1.52
		鉄鋼	2.73
		非鉄金属	1.07
		金属製品	1.90
		機械	5.58
		電気機器	8.48
		輸送用機器	4.12
		精密機器	1.31

	その他製品	0.25
	電気・ガス業	4.70
	陸運業	2.87
	海運業	0.69
	情報・通信業	10.57
	卸売業	5.21
	小売業	4.39
	銀行業	8.77
	保険業	3.32
	不動産業	3.15
	サービス業	1.30
合計		97.36

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類及び各業種の時価の比率です。

（参考）損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド

2020年9月30日現在

順位	地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 （円）	簿価金額 （円）	評価単価 （円）	評価金額 （円）	利率（%）	償還日	投資 比率 （%）
1	イギリス	国債証券	UK GILT 6.0 281207	540,000	20,075.99	108,410,383	20,166.36	108,898,347	6.0000000	2028/12/7	26.05
2	アメリカ	国債証券	Treasury 7.625 250215	630,000	13,732.84	86,516,892	14,001.04	88,206,571	7.6250000	2025/2/15	21.10
3	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 5.75 220715	770,000	8,534.52	65,715,819	8,301.78	63,923,754	5.7500000	2022/7/15	15.29
4	アメリカ	国債証券	Treasury 6.25 300515	290,000	15,097.97	43,784,135	16,198.08	46,974,449	6.2500000	2030/5/15	11.24
5	ポーランド	国債証券	POLAND 5.75 220923	900,000	3,053.51	27,481,597	3,046.93	27,422,413	5.7500000	2022/9/23	6.56
6	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 4.75 270421	210,000	9,574.54	20,106,550	9,620.89	20,203,887	4.7500000	2027/4/21	4.83
7	イギリス	国債証券	UK GILT 4.5 340907	90,000	21,465.88	19,319,294	21,137.77	19,023,993	4.5000000	2034/9/7	4.55
8	アメリカ	国債証券	Treasury 7.625 221115	60,000	12,419.01	7,451,410	12,266.13	7,359,681	7.6250000	2022/11/15	1.76
9	アメリカ	国債証券	Treasury 4.625 400215	40,000	17,664.88	7,065,952	17,170.17	6,868,070	4.6250000	2040/2/15	1.64
10	アメリカ	国債証券	Treasury 6.25 230815	50,000	12,338.39	6,169,197	12,437.21	6,218,606	6.2500000	2023/8/15	1.49
11	アメリカ	国債証券	Treasury 7.875 210215	20,000	11,368.21	2,273,642	10,885.76	2,177,152	7.8750000	2021/2/15	0.52
12	アメリカ	国債証券	Treasury 8.0 211115	9,000	11,869.70	1,068,273	11,514.74	1,036,327	8.0000000	2021/11/15	0.25

（注1）評価額組入上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価の比率です。

（注3）償還年月日が「9999/99/99」の銘柄は償還日の定めのない銘柄です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年9月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	95.27
合計	95.27

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する各種類の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率  
該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

イオン好配当グリーン・バランス・オープン

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

イオン好配当グリーン・バランス・オープン

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

### （3）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

イオン好配当グリーン・バランス・オープン

直近日（2020年9月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第6特定期間末 （2011年 3月11日）	203,354,353	204,083,276	0.8369	0.8399

第7特定期間末	(2011年 9月12日)	183,830,171	184,565,575	0.7499	0.7529
第8特定期間末	(2012年 3月12日)	203,260,539	203,995,279	0.8299	0.8329
第9特定期間末	(2012年 9月11日)	185,065,293	185,809,561	0.7460	0.7490
第10特定期間末	(2013年 3月11日)	238,942,287	239,678,905	0.9731	0.9761
第11特定期間末	(2013年 9月11日)	239,285,447	239,975,238	1.0407	1.0437
第12特定期間末	(2014年 3月11日)	229,333,186	235,865,943	1.0532	1.0832
第13特定期間末	(2014年 9月11日)	237,929,476	246,824,124	1.0700	1.1100
第14特定期間末	(2015年 3月11日)	287,302,030	299,995,254	1.1317	1.1817
第15特定期間末	(2015年 9月11日)	327,816,712	343,088,483	1.0733	1.1233
第16特定期間末	(2016年 3月11日)	420,550,314	421,803,764	1.0065	1.0095
第17特定期間末	(2016年 9月12日)	432,914,256	434,272,923	0.9559	0.9589
第18特定期間末	(2017年 3月13日)	462,514,672	475,648,655	1.0565	1.0865
第19特定期間末	(2017年 9月11日)	534,088,357	549,534,555	1.0373	1.0673
第20特定期間末	(2018年 3月12日)	640,817,619	647,044,232	1.0292	1.0392
第21特定期間末	(2018年 9月11日)	703,924,879	710,817,877	1.0212	1.0312
第22特定期間末	(2019年 3月11日)	753,810,076	756,077,920	0.9972	1.0002
第23特定期間末	(2019年 9月11日)	777,449,279	779,854,167	0.9698	0.9728
第24特定期間末	(2020年 3月11日)	722,017,919	724,475,426	0.8814	0.8844
第25特定期間末	(2020年 9月11日)	808,408,720	811,011,333	0.9318	0.9348
	2019年 9月末日	781,724,979		0.9700	
	10月末日	805,516,096		1.0057	
	11月末日	800,750,159		1.0103	
	12月末日	817,561,073		1.0205	
	2020年 1月末日	806,021,128		0.9975	
	2月末日	770,022,258		0.9425	
	3月末日	737,811,186		0.8883	
	4月末日	757,928,919		0.9046	
	5月末日	789,774,748		0.9290	
	6月末日	787,931,914		0.9218	
	7月末日	765,639,640		0.8922	
	8月末日	805,964,880		0.9345	
	9月末日	800,820,359		0.9159	

## 【分配の推移】

## イオン好配当グリーン・バランス・オープン

	1口当たりの分配金（円）
第6特定期間	0.0090
第7特定期間	0.0090
第8特定期間	0.0090
第9特定期間	0.0090

第10特定期間	0.0090
第11特定期間	0.0090
第12特定期間	0.0360
第13特定期間	0.0460
第14特定期間	0.0560
第15特定期間	0.0560
第16特定期間	0.0090
第17特定期間	0.0090
第18特定期間	0.0360
第19特定期間	0.0360
第20特定期間	0.0160
第21特定期間	0.0160
第22特定期間	0.0090
第23特定期間	0.0090
第24特定期間	0.0090
第25特定期間	0.0090

## 【収益率の推移】

イオン好配当グリーン・バランス・オープン

	収益率（％）
第6特定期間	6.2
第7特定期間	9.3
第8特定期間	11.9
第9特定期間	9.0
第10特定期間	31.6
第11特定期間	7.9
第12特定期間	4.7
第13特定期間	6.0
第14特定期間	11.0
第15特定期間	0.2
第16特定期間	5.4
第17特定期間	4.1
第18特定期間	14.3
第19特定期間	1.6
第20特定期間	0.8
第21特定期間	0.8
第22特定期間	1.5
第23特定期間	1.8
第24特定期間	8.2
第25特定期間	6.7



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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### （４）【設定及び解約の実績】

##### イオン好配当グリーン・バランス・オープン

	設定口数	解約口数
第6特定期間	12,300,380	83,814,062
第7特定期間	22,820,001	20,659,536
第8特定期間	10,565,075	10,786,358
第9特定期間	14,692,661	11,516,585
第10特定期間	28,085,177	30,635,202
第11特定期間	31,711,790	47,320,732
第12特定期間	28,324,748	40,496,808
第13特定期間	32,744,654	28,137,041
第14特定期間	50,875,750	19,377,476
第15特定期間	83,183,336	31,612,378
第16特定期間	134,848,696	22,467,255
第17特定期間	55,924,310	20,852,143
第18特定期間	45,765,570	60,855,177
第19特定期間	120,977,844	43,903,984
第20特定期間	149,795,768	42,007,752
第21特定期間	137,261,016	70,622,490
第22特定期間	108,507,428	41,859,020
第23特定期間	98,699,063	53,017,689
第24特定期間	100,733,697	83,194,208
第25特定期間	79,417,575	31,048,697

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

#### 参考情報

基準日:2020年9月30日

## ● 基準価額・純資産の推移 2010/09/30～2020/09/30



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

## ● 分配の推移

2020年01月	30円
2020年03月	30円
2020年05月	30円
2020年07月	30円
2020年09月	30円
設定来累計	4,540円

● 1万口当たり、税引前

## ● 主要な資産の状況

## ● イオン好配当グリーン・バランス・オープン

資産別構成	
資産の種類	純資産比
損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド	50.27%
損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド	49.12%
コール・ローン等	0.61%
合計	100.00%

## ● 損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド

資産別構成	
資産の種類	純資産比
株式	97.36%
コール・ローン等	2.64%
合計	100.00%

## 組入上位5業種

業種	純資産比
1 情報・通信業	10.6%
2 食料品	10.1%
3 銀行業	8.8%
4 電気機器	8.5%
5 医薬品	6.3%

## 組入上位10銘柄

銘柄名	業種	純資産比
1 武田薬品工業	医薬品	3.4%
2 日本たばこ産業	食料品	3.0%
3 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3.0%
4 小松製作所	機械	2.8%
5 キリンホールディングス	食料品	2.8%
6 日本テレビホールディングス	情報・通信業	2.7%
7 東邦ホールディングス	卸売業	2.4%
8 本田技研工業	輸送用機器	2.3%
9 日本製鉄	鉄鋼	2.2%
10 セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2.2%
組入銘柄数		74銘柄

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

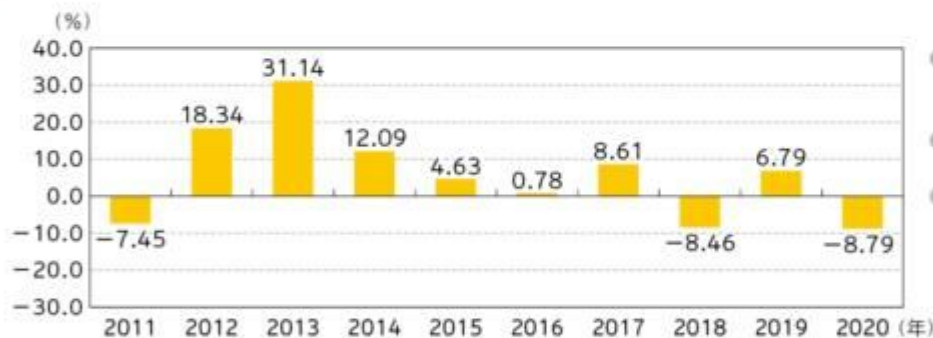
## ● 損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド

資産別構成		通貨別構成	
資産の種類	純資産比	通貨	純資産比
公社債	95.27%	アメリカ・ドル	38.0%
国債証券	95.27%	イギリス・ポンド	30.6%
コール・ローン等	4.73%	オーストラリア・ドル	20.1%
合計	100.00%	ポーランド・ズロチ	6.6%
		コール・ローン等	4.7%
		合計	100.0%

## 組入上位10銘柄

銘柄名	発行国	種類	通貨	償還日	純資産比
1 UK GILT 6.0 281207	イギリス	国債証券	イギリス・ポンド	2028/12/07	26.0%
2 Treasury 7.625 250215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2025/02/15	21.1%
3 AUSTRALIA 5.75 220715	オーストラリア	国債証券	オーストラリア・ドル	2022/07/15	15.3%
4 Treasury 6.25 300515	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2030/05/15	11.2%
5 POLAND 5.75 220923	ポーランド	国債証券	ポーランド・ズロチ	2022/09/23	6.6%
6 AUSTRALIA 4.75 270421	オーストラリア	国債証券	オーストラリア・ドル	2027/04/21	4.8%
7 UK GILT 4.5 340907	イギリス	国債証券	イギリス・ポンド	2034/09/07	4.6%
8 Treasury 7.625 221115	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2022/11/15	1.8%
9 Treasury 4.625 400215	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2040/02/15	1.6%
10 Treasury 6.25 230815	アメリカ	国債証券	アメリカ・ドル	2023/08/15	1.5%
組入銘柄数				12銘柄	

## ● 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ファンドの年間収益率は基準価額（税引前分配金再投資）を使用して計算しています。
- 2020年は年初から基準日までの収益率です。
- 当ファンドはベンチマークを設定していません。

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

## 第2【管理及び運営】

## 3【資産管理等の概要】

## (5) 【その他】

&lt;訂正前&gt;

(略)

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について資産管理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できます。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

&lt;訂正後&gt;

(略)

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドに係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できます。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

## 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。

3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2020年3月12日から2020年9月11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】

## 【イオン好配当グリーン・バランス・オープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 2020年3月11日現在	当 期 2020年9月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	12,650,392	12,775,568
親投資信託受益証券	714,535,321	800,475,956
流動資産合計	727,185,713	813,251,524
資産合計	727,185,713	813,251,524
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,457,507	2,602,613
未払解約金	949,245	395,386
未払受託者報酬	96,045	100,613
未払委託者報酬	1,646,430	1,724,773
未払利息	37	36
その他未払費用	18,530	19,383
流動負債合計	5,167,794	4,842,804
負債合計	5,167,794	4,842,804
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	819,169,112	867,537,990
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	97,151,193	59,129,270
元本等合計	722,017,919	808,408,720
純資産合計	722,017,919	808,408,720
負債純資産合計	727,185,713	813,251,524

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	当 期 自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	60,411,112	56,090,635
営業収益合計	60,411,112	56,090,635
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,549	3,136

	前 期		当 期	
	自	2019年9月12日	自	2020年3月12日
	至	2020年3月11日	至	2020年9月11日
受託者報酬		305,965		298,982
委託者報酬		5,244,986		5,125,415
その他費用		30,319		58,654
営業費用合計		5,584,819		5,486,187
営業利益又は営業損失( )		65,995,931		50,604,448
経常利益又は経常損失( )		65,995,931		50,604,448
当期純利益又は当期純損失( )		65,995,931		50,604,448
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( )		188,379		309,838
期首剰余金又は期首欠損金( )		24,180,344		97,151,193
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,733,841		3,054,821
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,086,342		3,054,821
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		647,499		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,292,664		7,667,174
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		623,034		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		669,630		7,667,174
分配金		7,227,716		7,660,334
期末剰余金又は期末欠損金( )		97,151,193		59,129,270

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	前 期		当 期	
	2020年3月11日現在		2020年9月11日現在	
1. 受益権の総数		819,169,112口		867,537,990口
2. 元本の欠損		97,151,193円		59,129,270円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8814円 (8,814円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9318円 (9,318円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
1. 分配金の計算過程	<p>（自2019年9月12日 至2019年11月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（7,583,545円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（197,793,871円）及び分配準備積立金（30,045,106円）より分配対象収益は235,422,522円（1万口当たり2,976.09円）であり、うち2,373,121円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年11月12日 至2020年1月14日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（3,741,099円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（201,296,907円）及び分配準備積立金（34,237,112円）より分配対象収益は239,275,118円（1万口当たり2,994.56円）であり、うち2,397,088円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年1月15日 至2020年3月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（1,250,963円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（208,345,963円）及び分配準備積立金（34,593,411円）より分配対象収益は244,190,337円（1万口当たり2,980.94円）であり、うち2,457,507円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2020年3月12日 至2020年5月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（8,033,306円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（214,400,620円）及び分配準備積立金（33,043,393円）より分配対象収益は255,477,319円（1万口当たり3,048.57円）であり、うち2,514,050円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年5月12日 至2020年7月13日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（3,339,625円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（218,074,044円）及び分配準備積立金（37,925,166円）より分配対象収益は259,338,835円（1万口当たり3,058.62円）であり、うち2,543,671円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p> <p>（自2020年7月14日 至2020年9月11日） 計算期間末における経費控除後の配当等収益（2,593,642円）（本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（224,390,092円）及び分配準備積立金（38,393,490円）より分配対象収益は265,377,224円（1万口当たり3,058.95円）であり、うち2,602,613円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左



項目	前 期	当 期
	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 2020年3月11日現在	当 期 2020年9月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

前 期 2020年3月11日現在	当 期 2020年9月11日現在
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

項目	前 期	当 期
	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
期首元本額	801,629,623円	819,169,112円
期中追加設定元本額	100,733,697円	79,417,575円
期中一部解約元本額	83,194,208円	31,048,697円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	前 期	当 期
	2020年3月11日現在	2020年9月11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）
親投資信託受益証券	106,579,529	15,621,504
合計	106,579,529	15,621,504

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2020年9月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド	299,754,374	395,585,847	
	損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド	213,538,373	404,890,109	
合計		513,292,747	800,475,956	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

イオン好配当グリーン・バランス・オープンの主要投資対象の状況は以下のとおりです。

\*なお、以下は参考情報であり、監査証明の対象ではありません。

損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド

貸借対照表

科 目	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	24,949,032	18,892,245
株式	778,297,680	903,279,920
未収入金	105,348	-
未収配当金	2,736,850	414,150
流動資産合計	806,088,910	922,586,315

科 目	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産合計	806,088,910	922,586,315
負債の部		
流動負債		
未払利息	74	54
その他未払費用	70	-
流動負債合計	144	54
負債合計	144	54
純資産の部		
元本等		
元本	469,095,913	486,578,316
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	336,992,853	436,007,945
元本等合計	806,088,766	922,586,261
純資産合計	806,088,766	922,586,261
負債純資産合計	806,088,910	922,586,315

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 原則として取引所における計算期間末日の最終相場で評価しております。計算期間末日に当該取引所の最終相場がない場合には当該取引所における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該取引所における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
1. 受益権の総数	469,095,913口	486,578,316口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7184円 (17,184円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8961円 (18,961円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。 (2) 金融商品に係るリスク 当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。 市場リスク 金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。 信用リスク 各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。 流動性リスク 必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。 また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

項目	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	476,412,891円	469,095,913円
同期中追加設定元本額	20,951,017円	40,217,757円
同期中一部解約元本額	28,267,995円	22,735,354円
元本の内訳*		
イオン好配当グリーン・バランス・オープン	192,950,359円	213,538,373円
損保ジャパン・エコ・オープン（配当利回り重視型）	276,145,554円	273,039,943円
計	469,095,913円	486,578,316円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	174,748,523	64,531,834
合計	174,748,523	64,531,834

(注)「当計算期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

(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。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

2020年9月11日現在

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
鹿島建設	4,100	1,313.00	5,383,300	
西松建設	2,100	2,048.00	4,300,800	
大和ハウス工業	1,700	2,949.50	5,014,150	
日揮ホールディングス	11,200	1,126.00	12,611,200	
日本ハム	4,300	4,745.00	20,403,500	
麒麟ホールディングス	9,200	2,026.00	18,639,200	
味の素	7,400	2,012.50	14,892,500	
キューピー	2,000	2,084.00	4,168,000	
日本たばこ産業	16,500	1,992.00	32,868,000	
東レ	28,200	505.30	14,249,460	
ワコールホールディングス	2,000	1,885.00	3,770,000	
クラレ	5,000	1,123.00	5,615,000	
花王	1,000	8,141.00	8,141,000	
武田薬品工業	8,400	3,913.00	32,869,200	
沢井製薬	3,400	5,560.00	18,904,000	
E N E O Sホールディングス	42,200	410.10	17,306,220	
A G C	4,400	3,245.00	14,278,000	
日本製鉄	20,000	1,159.50	23,190,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	5,900	875.00	5,162,500	
住友電気工業	8,100	1,279.00	10,359,900	
S U M C O	8,800	1,437.00	12,645,600	
アマダ	4,900	1,038.00	5,086,200	
オーエスジー	2,600	1,685.00	4,381,000	
小松製作所	10,500	2,393.00	25,126,500	



荏原製作所	1,900	2,835.00	5,386,500
日本精工	10,200	901.00	9,190,200
スター精密	1,900	1,415.00	2,688,500
日立製作所	1,500	3,702.00	5,553,000
三菱電機	8,800	1,484.50	13,063,600
セイコーエプソン	12,300	1,306.00	16,063,800
E I Z O	3,100	3,945.00	12,229,500
ソニー	600	8,211.00	4,926,600
シスメックス	600	9,381.00	5,628,600
京セラ	700	6,242.00	4,369,400
村田製作所	1,200	6,603.00	7,923,600
S C R E E Nホールディングス	1,700	5,360.00	9,112,000
デンソー	2,100	4,505.00	9,460,500
アイシン精機	1,900	3,560.00	6,764,000
本田技研工業	8,200	2,654.00	21,762,800
シチズン時計	40,100	325.00	13,032,500
トッパン・フォームズ	2,300	974.00	2,240,200
中部電力	3,600	1,337.50	4,815,000
東京瓦斯	8,300	2,370.50	19,675,150
大阪瓦斯	7,900	2,071.00	16,360,900
東日本旅客鉄道	3,000	7,152.00	21,456,000
日本通運	1,000	6,360.00	6,360,000
ヤマトホールディングス	2,800	2,634.00	7,375,200
日本郵船	3,200	1,925.00	6,160,000
日鉄ソリューションズ	6,000	3,025.00	18,150,000
大塚商会	1,700	5,180.00	8,806,000
日本テレビホールディングス	26,100	1,224.00	31,946,400
日本電信電話	8,300	2,370.00	19,671,000
K D D I	6,900	2,921.00	20,154,900
S C S K	900	5,510.00	4,959,000
三井物産	8,000	1,927.50	15,420,000
東邦ホールディングス	9,600	2,299.00	22,070,400
トラスコ中山	3,300	2,494.00	8,230,200
J . フロント リテイリング	6,100	753.00	4,593,300
セブン&アイ・ホールディングス	6,300	3,404.00	21,445,200
ユナイテッドアローズ	4,100	1,645.00	6,744,500
イズミ	1,500	3,880.00	5,820,000
ヤマダ電機	15,400	550.00	8,470,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	41,700	438.80	18,297,960
三井住友トラスト・ホールディングス	5,300	3,084.00	16,345,200
三井住友フィナンシャルグループ	9,100	3,087.00	28,091,700
みずほフィナンシャルグループ	149,300	141.60	21,140,880
M S & A Dインシュアランスグループホール	1,900	3,001.00	5,701,900

第一生命ホールディングス	11,300	1,576.50	17,814,450
東京海上ホールディングス	600	4,962.00	2,977,200
三井不動産	4,100	1,984.50	8,136,450
三菱地所	10,300	1,659.00	17,087,700
ダイビル	3,600	1,148.00	4,132,800
H.U.グループホールディングス	6,000	2,685.00	16,110,000
合計	690,200		903,279,920

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

科 目	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,951,720	1,451,231
コール・ローン	7,598,326	4,957,150
国債証券	366,276,732	401,133,532
派生商品評価勘定	137,700	-
未収入金	22,456,896	-
未収利息	3,798,329	4,380,949
流動資産合計	403,219,703	411,922,862
資産合計	403,219,703	411,922,862
負債の部		
流動負債		
未払利息	22	14
その他未払費用	33	-
流動負債合計	55	14
負債合計	55	14
純資産の部		
元本等		
元本	319,062,095	312,122,121
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	84,157,553	99,800,727
元本等合計	403,219,648	411,922,848
純資産合計	403,219,648	411,922,848
負債純資産合計	403,219,703	411,922,862

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、以下のとおり、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、原則として日本証券業協会発表の店頭基準気配値段、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>ただし、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2．デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法による時価法によっております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4．費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</p> <p>但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

期別	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
1．受益権の総数	319,062,095口	312,122,121口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2638円 (1万円当たり純資産額) (12,638円)	1口当たり純資産額 1.3197円 (1万円当たり純資産額) (13,197円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に基づき金融商品を投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>当ファンドが保有している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は(有価証券に関する注記)に記載しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。</p> <p>為替予約取引は外貨の送金または実質外貨建資産に係る将来の為替変動リスクを低減する目的で行っております。</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが実質的に保有している金融商品は、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクに晒されております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用に係る各種リスクについて運用部門が自ら確認するとともに、運用部門とは独立したコンプライアンス・リスク管理部が、全社リスク管理基本規程に従い各種リスクを監視し、その状況をコンプライアンス・リスク管理委員会等に定期的に報告しております。</p> <p>市場リスク</p> <p>金融市場における各金融商品の時価の推移を把握すること等により、ファンドの運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>信用リスク</p> <p>各金融商品の発行体の格付等信用情報をモニタリングすること等により、ファンドの投資制限等、運用方針への遵守状況を管理しております。</p> <p>流動性リスク</p> <p>必要に応じて時価の推移をモニタリングすること等により、ファンドで保有する金融商品の流動性の状況を管理しております。</p> <p>また、内部監査部が運用リスク管理の適切性・有効性について内部監査を実施し、その結果を取締役に報告するとともに、必要に応じて是正勧告及びそのフォローアップを実施しております。</p>	同左

項目	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでデリバティブ取引における名目的な契約額または想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	当該ファンドの保有する金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額を時価としております。

## (関連当事者との取引に関する注記)

2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
該当事項はありません。	同左

## (その他の注記)

項目	自 2019年9月12日 至 2020年3月11日	自 2020年3月12日 至 2020年9月11日
	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	575,531,938円
同期中追加設定元本額	28,860,061円	23,913,834円
同期中一部解約元本額	285,329,904円	30,853,808円
元本の内訳*		
損保ジャパン高金利外国債券オープン（毎月分配型）	16,032,007円	12,367,747円
イオン好配当グリーン・バランス・オープン	303,030,088円	299,754,374円
計	319,062,095円	312,122,121円

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年3月11日現在	2020年9月11日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
国債証券	7,384,818	2,642,290
合計	7,384,818	2,642,290

（注）「当計算期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2020年3月11日 現在				2020年9月11日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	23,155,700	-	23,018,000	137,700	-	-	-	-
ボンド	23,155,700	-	23,018,000	137,700	-	-	-	-
合計	23,155,700	-	23,018,000	137,700	-	-	-	-

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において予約為替の受渡日（以下、「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

（イ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。

（ロ）計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
  3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

2020年9月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ドル	Treasury 4.625 400215	40,000	64,462.40	
		Treasury 6.25 230815	50,000	58,914.00	
		Treasury 6.25 300515	290,000	443,584.00	
		Treasury 7.625 221115	60,000	69,773.40	
		Treasury 7.625 250215	630,000	835,039.80	
		Treasury 7.875 210215	20,000	20,660.80	
		Treasury 8.0 211115	9,000	9,825.39	
	ドル 合計		1,099,000	1,502,259.79	(159,479,899)
	ポンド	UK GILT 4.5 340907	90,000	138,989.70	
		UK GILT 6.0 281207	540,000	798,255.00	
	ポンド 合計		630,000	937,244.70	(127,409,044)
	ポーランドズロチ	POLAND 5.75 220923	900,000	1,002,834.00	
	ポーランドズロチ 合計		900,000	1,002,834.00	(28,299,975)
	オーストラリアドル	AUSTRALIA 4.75 270421	210,000	265,813.80	
AUSTRALIA 5.75 220715		770,000	847,746.90		
オーストラリアドル 合計		980,000	1,113,560.70	(85,944,614)	
				401,133,532	

合計		(401,133,532)	
----	--	---------------	--

- (注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額です。
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
ドル	国債証券 7銘柄	38.72%	39.75%
ポンド	国債証券 2銘柄	30.93%	31.76%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	6.87%	7.06%
オーストラリアドル	国債証券 2銘柄	20.86%	21.43%

(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。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

イオン好配当グリーン・バランス・オープン

2020年9月30日現在

資産総額	802,576,177円
負債総額	1,755,818円
純資産総額( - )	800,820,359円
発行済数量	874,353,970口
1単位当りの純資産額( / )	0.9159円

(参考) 損保ジャパン・エコ好配当マザーファンド



2020年9月30日現在

資産総額	850,317,161円
負債総額	3,710,009円
純資産総額( - )	846,607,152円
発行済数量	459,558,914口
1単位当りの純資産額( / )	1.8422円

(参考) 損保ジャパン高金利外国債券マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	418,087,049円
負債総額	35円
純資産総額( - )	418,087,014円
発行済数量	318,287,438口
1単位当りの純資産額( / )	1.3136円

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

- (1) 資本金の額（2020年3月末現在）  
 (略)  
 (2) 会社の機構（2020年3月末現在）  
 (略)

<訂正後>

- (1) 資本金の額（2020年9月末現在）  
 (略)  
 (2) 会社の機構（2020年9月末現在）  
 (略)

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびに証券投資信託の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資一任契約に基づく運用（投資運用業）および投資助言業務を行っています。

委託会社の運用する投資信託（親投資信託を除きます。）は2020年9月末現在、計230本（追加型株式投資信託138本、単位型株式投資信託32本、単位型公社債投資信託60本）であり、その純資産総額の合計は1,268,502百万円です。

##### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

- 委託会社であるSOMPOアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、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)【貸借対照表】

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)

区分	注記 番号	金額(千円)		金額(千円)	
(資産の部)					
流動資産					
1 現金・預金			5,031,436		5,030,360
2 前払費用			77,905		88,889
3 未収委託者報酬			892,311		1,062,114
4 未収運用受託報酬			1,133,534		958,520
5 未収収益			52		44
6 その他			5,489		1,347
流動資産合計			7,140,730		7,141,276
固定資産					
1 有形固定資産					
(1) 建物	1		23,660		19,412
(2) 器具備品	1		24,492		102,336
有形固定資産合計			48,153		121,748
2 無形固定資産					
(1) 電話加入権			4,535		4,535
無形固定資産合計			4,535		4,535
3 投資その他の資産					
(1) 投資有価証券			189,407		378,390
(2) 長期差入保証金			161,598		161,598
(3) 繰延税金資産			369,181		402,032
(4) その他			31		32
投資その他の資産合計			720,218		942,053
固定資産合計			772,907		1,068,337
資産合計			7,913,637		8,209,613

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
(負債の部)					
流動負債					
1 預り金			12,372		6,729
2 未払金					
(1) 未払配当金	2	240,000		3,000,000	
(2) 未払手数料		320,577		351,384	
(3) その他未払金		193,367	753,944	180,135	3,531,520
3 未払費用			985,047		973,410
4 未払消費税等			15,760		47,391
5 未払法人税等			225,326		152,972
6 賞与引当金			125,066		115,230
7 役員賞与引当金			7,200		5,400
流動負債合計			2,124,718		4,832,655
固定負債					
1 退職給付引当金			134,243		150,881
2 資産除去債務			8,327		8,475
固定負債合計			142,570		159,356
負債合計			2,267,288		4,992,011

(純資産の部)				
株主資本				
1 資本金			1,550,000	1,550,000
2 資本剰余金				
(1) 資本準備金			413,280	413,280
資本剰余金合計			413,280	413,280
3 利益剰余金				
(1) その他利益剰余金				
繰越利益剰余金			3,675,113	1,257,468
利益剰余金合計			3,675,113	1,257,468
株主資本合計			5,638,393	3,220,749
評価・換算差額等				
1 その他有価証券評価差額金			7,956	3,147
評価・換算差額等合計			7,956	3,147
純資産合計			5,646,349	3,217,602
負債・純資産合計			7,913,637	8,209,613

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
		金額(千円)		金額(千円)	
営業収益					
1 委託者報酬		4,693,325		4,761,002	
2 運用受託報酬		3,479,650	8,172,976	3,408,951	8,169,953
営業費用					
1 支払手数料		2,096,873		2,057,148	
2 広告宣伝費		30,230		16,106	
3 公告費		200		200	
4 調査費		2,532,683		2,381,706	
(1) 調査費		1,070,321		1,067,053	
(2) 委託調査費		1,457,726		1,311,310	
(3) 図書費		4,635		3,342	
5 営業雑経費		165,973		184,920	
(1) 通信費		6,109		6,023	
(2) 印刷費		145,335		163,235	
(3) 諸会費		14,528	4,825,961	15,660	4,640,082
一般管理費					
1 給料		1,523,789		1,567,354	
(1) 役員報酬		75,540		83,506	
(2) 給料・手当		1,260,953		1,286,043	
(3) 賞与		187,295		197,805	
2 福利厚生費		183,912		188,710	
3 交際費		10,052		13,169	
4 寄付金		300		300	
5 旅費交通費		39,791		45,892	
6 法人事業税		41,849		50,010	

7	租税公課		15,555		26,124	
8	不動産賃借料		208,923		211,714	
9	退職給付費用		58,381		67,288	
10	賞与引当金繰入		125,066		115,230	
11	役員賞与引当金繰入		7,200		5,400	
12	固定資産減価償却費		11,976		13,153	
13	諸経費		353,873	2,580,671	349,338	2,653,688
営業利益				766,343		876,182
営業外収益						
1	受取配当金		98		191	
2	受取利息		281		272	
3	有価証券売却益		12,029		-	
4	有価証券償還益		-		1,358	
5	保険配当金		366		448	
6	雑益		2,459	15,236	1,033	3,305
営業外費用						
1	有価証券売却損		-		2	
2	為替差損		3,184		2,620	
3	事務過誤費		4,341		-	
4	雑損		198	7,724	266	2,889
経常利益				773,855		876,598
特別損失						
1	固定資産除却損	1	7		409	
2	商号変更費用		-	7	13,256	13,666
税引前当期純利益				773,847		862,932
法人税・住民税及び事業税				342,518		309,915
法人税等調整額				97,828		29,339
当期純利益				529,156		582,355

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等		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	2,378	2,378	5,351,614
当期変動額			
剰余金の配当			240,000
当期純利益			529,156
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	5,578	5,578	5,578
当期変動額合 計	5,578	5,578	294,735
当期末残高	7,956	7,956	5,646,349

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,550,000	413,280	413,280	3,675,113	3,675,113	5,638,393
当期変動額						
剰余金の配当				3,000,000	3,000,000	3,000,000
当期純利益				582,355	582,355	582,355
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）						
当期変動額合 計	-	-	-	2,417,644	2,417,644	2,417,644
当期末残高	1,550,000	413,280	413,280	1,257,468	1,257,468	3,220,749

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価差 額金	評価・換 算差額等 合計	
当期首残高	7,956	7,956	5,646,349
当期変動額			
剰余金の配当			3,000,000
当期純利益			582,355
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）	11,103	11,103	11,103
当期変動額合 計	11,103	11,103	2,428,747
当期末残高	3,147	3,147	3,217,602

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## 有形固定資産

定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	15年
器具備品	2～20年

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 役員賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

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

## 5. 消費税等の会計処理方法

税抜方式を採用しております。

## (表示方法の変更)

## (損益計算書)

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

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた2,826千円は、「保険配当金」366千円及び「その他」2,459千円として組み替えております。

## 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は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	86,787	91,036
器具備品	52,226	59,912

## 2 関係会社項目

関係会社に対する負債は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
未払金		
未払配当金	240,000	3,000,000

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
器具備品	7	409

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。



## 4. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額	1株当たり配当額	基準日	効力発生日
2020年3月11日 取締役会	普通株式	3,000,000千円	124,558円	-	2020年3月31日

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの  
該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、そのほとんどが信託財産から支払われるため、回収リスクは僅少であります。

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

価格変動リスクについては、四半期ごとに時価の状況等を把握し、当該状況については資産運用管理規程に従い、経理担当部が取締役会等へ報告し、適切に管理を行っております。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含めておりません（注2.参照）。

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	5,030,360	5,030,360	-
(2) 未収委託者報酬	1,062,114	1,062,114	-
(3) 未収運用受託報酬	958,520	958,520	-
(4) 投資有価証券 其他有価証券	377,640	377,640	-

資産計	7,428,635	7,428,635	-
(1) 未払金	3,531,520	3,531,520	-
(2) 未払費用	973,410	973,410	-
負債計	4,504,931	4,504,931	-

## 注1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券取引に関する事項

資 産

## (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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

## (4) 投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用

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

## 注2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非上場株式	750	750

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

## 注3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2019年3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
(1) 預金	5,030,197	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,062,114	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	958,520	-	-	-
(4) 投資有価証券				

その他有価証券のうち 満期があるもの				
株式	-	-	-	-
債券	-	-	-	-
その他	-	157,275	19,415	200,950
合計	7,050,832	157,275	19,415	200,950

注4. 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

該当事項はありません。

4. その他有価証券で時価のあるもの

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	種類	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	233,779	229,700	4,079
	小計	233,779	229,700	4,079
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	143,861	151,087	7,226
	小計	143,861	151,087	7,226
合計		377,640	380,787	3,147

5. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	24,900	9,900	-

(2) 債券	-	-	-
(3) その他	13,229	2,130	0
合計	38,129	12,030	0

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
(1) 株式	-	-	-
(2) 債券	-	-	-
(3) その他	97	-	2
合計	97	-	2

（退職給付関係）

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

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

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

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

2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	112,624	134,243
退職給付費用	23,211	27,786
退職給付の支払額	1,592	11,148
退職給付引当金の期末残高	134,243	150,881

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	134,243	150,881
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	134,243	150,881
退職給付引当金	134,243	150,881
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	134,243	150,881

（3）退職給付費用

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
簡便法で計算した退職給付費用	23,211	27,786

3. 確定拠出制度

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
--	--	--

当社の確定拠出制度への要 拠出額	25,915	30,681
---------------------	--------	--------

## （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

（単位：千円）

	前事業年度 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
繰延税金資産		
ソフトウェア損金算入限度超過額	259,327	301,391
退職給付引当金	41,105	46,199
賞与引当金	38,295	35,283
未払事業税	14,487	11,335
未払金否認	14,684	4,762
繰延資産損金算入限度超過額	5,949	4,021
その他	4,944	6,059
繰延税金資産 小計	378,793	409,054
将来減算一時差異等の合計に係る 評価性引当額	2,645	3,648
評価性引当額 小計	2,645	3,648
繰延税金資産 合計	376,148	405,406
繰延税金負債		
株式譲渡損益	3,031	3,031
固定資産除去価額	424	343
その他有価証券評価差額金	3,512	-
繰延税金負債 合計	6,967	3,374
繰延税金資産の純額	369,181	402,032

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
法定実効税率 （調整）	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。	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目		1.3
住民税均等割		0.3
評価性引当額の増減		0.1
その他		0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率		32.5

## （資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

本社事務所の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
期首残高	8,181	8,327
時の経過による調整額	145	147
期末残高	8,327	8,475

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

当社は、投資運用事業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 関連情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

(単位：千円)

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

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

(単位：千円)

日本	欧州	米国	中東	アジア	合計
7,171,851	490,694	259,796	192,226	55,384	8,169,953

(注) 営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等  
記載すべき重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
該当事項はありません。

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

## 前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパンDC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払(注1)	488,979	未払手数料	107,223
同一の親会社を持つ会社	SOMPOひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り(注2)	165,115	未収運用受託報酬	88,523

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

注2.取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

注3. 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社は、2020年4月1日に商号を損保ジャパンDC証券株式会社に変更しております。

注4. 損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社は、2019年10月1日に商号をSOMPOひまわり生命保険株式会社に変更しております。

## 当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金 (千円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	損保ジャパンDC証券株式会社	東京都新宿区	3,000,000	確定拠出年金業	-	投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託代行手数料の支払(注1)	498,922	未払手数料	115,372
同一の親会社を持つ会社	SOMPOひまわり生命保険株式会社	東京都新宿区	17,250,000	生命保険業	-	投資顧問契約に基づく資産運用	運用受託報酬の受取り(注2)	169,211	未収運用受託報酬	94,179

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

注2.取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 代行手数料の支払いについては、一般的取引条件によっております。

(注2) 運用受託報酬の受取りについては、一般的取引条件によっております。

注3. 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社は、2020年4月1日に商号を損保ジャパンDC証券株式会社に変更しております。

注4. 損保ジャパン日本興亜ひまわり生命保険株式会社は、2019年10月1日に商号をSOMPOひまわり生命保険株式会社に変更しております。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

- (1) 親会社情報  
S O M P Oホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）
- (2) 重要な関連会社の要約財務情報  
関連会社はありません。

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額(円)	234,434.27	133,593.60
1株当たり当期純利益金額(円)	21,970.39	24,179.19

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

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

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(千円)	529,156	582,355
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	529,156	582,355
期中平均株式数(株)	24,085	24,085

## 5【その他】

### <訂正前>

#### (1) 定款の変更

2019年6月27日付で取締役の数の上限を変更する定款の変更を行いました。

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

(略)

### <訂正後>

#### (1) 定款の変更

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

2020年6月26日付で監査役の補欠選任に関する条文を削除する定款変更を行いました。

(略)

## 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】

#### <訂正前>



## (1) 受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社）

資本金の額

247,369百万円（2019年3月末現在）

事業の内容

(略)

&lt;再信託受託会社の概要&gt;

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社資本金の額：50,000百万円（2019年3月末現在）

(略)

再信託の目的：原信託契約に係る信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## (2) 販売会社

(略)

資本金の額は、2019年3月末現在

&lt;訂正後&gt;

## (1) 受託会社

名称

みずほ信託銀行株式会社（再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行）

資本金の額

247,369百万円（2020年3月末現在）

事業の内容

(略)

&lt;再信託受託会社の概要&gt;

名称：株式会社日本カストディ銀行資本金の額：51,000百万円（2020年3月末現在）

(略)

再信託の目的：原信託契約に係る信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## (2) 販売会社

(略)

資本金の額は、2020年3月末現在

# 独立監査人の監査報告書

2020年11月11日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 蒲 谷 剛  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているイオン好配当グリーン・バランス・オープンの2020年3月12日から2020年9月11日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、イオン好配当グリーン・バランス・オープンの2020年9月11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、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、SOMPOアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月11日

SOMPOアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

## 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S O M P Oアセットマネジメント株式会社（旧損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社）の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、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、S O M P Oアセットマネジメント株式会社（旧損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社）の2020年3月31日現在の財政状態並びに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並びに監査役及び監査役会の責任

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、継続企業的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。

監査役及び監査役会の責任は、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、継続企業的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。継続企業的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、監査役及び監査役会に対して、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。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。