

【表紙】

【提出書類】 半期報告書
【提出先】 関東財務局長殿
【提出日】 2021年12月24日提出
【計算期間】 第2期中(自 2021年3月26日 至 2021年9月25日)
【ファンド名】 One ターゲットリターン・ファンド(4%コース)
【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
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】 03-6774-5100
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

2021年9月30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	1,425,890,023	99.03
内 日本	1,425,890,023	99.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,010,666	0.97
純資産総額	1,439,900,689	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)【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2021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 (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 (2021年3月25日)	1,333	1,333	1.0593	1.0593
2020年9月末日	815	-	1.0417	-
10月末日	951	-	1.0329	-
11月末日	1,065	-	1.0639	-
12月末日	1,202	-	1.0687	-
2021年1月末日	1,332	-	1.0644	-
2月末日	1,329	-	1.0631	-
3月末日	1,339	-	1.0615	-
4月末日	1,359	-	1.0677	-
5月末日	1,377	-	1.0751	-
6月末日	1,425	-	1.0790	-
7月末日	1,452	-	1.0817	-
8月末日	1,453	-	1.0851	-
9月末日	1,439	-	1.0755	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2021年3月26日～2021年9月25日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	5.9
2021年3月26日～2021年9月25日	2.2

(注) 収益率は期間騰落率です。

2【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	1,285,112,875	25,747,123

2021年3月26日～ 2021年9月25日	110,362,858	40,481,496
---------------------------	-------------	------------

(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。

3【ファンドの経理状況】

- (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2期中間計算期間(2021年3月26日から2021年9月25日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【One ターゲットリターン・ファンド(4%コース)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2021年3月25日現在	第2期中間計算期間末 2021年9月25日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	26,747
コール・ローン	15,692,374	18,872,151
投資信託受益証券	1,322,390,891	1,425,211,898
流動資産合計	1,338,083,265	1,444,110,796
資産合計	1,338,083,265	1,444,110,796
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	123,625	155,955
未払委託者報酬	3,957,310	4,991,840
未払利息	-	4
その他未払費用	16,413	20,732
流動負債合計	4,097,348	5,168,531
負債合計	4,097,348	5,168,531
純資産の部		
元本等		
元本	1,259,365,752	1,329,247,114
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	74,620,165	109,695,151
(分配準備積立金)	18,307,675	17,752,848
元本等合計	1,333,985,917	1,438,942,265
純資産合計	1,333,985,917	1,438,942,265
負債純資産合計	1,338,083,265	1,444,110,796

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2020年3月27日 至 2020年9月26日	第2期中間計算期間 自 2021年3月26日 至 2021年9月25日
営業収益		
受取利息	-	21
有価証券売買等損益	1,416,846	35,321,007
営業収益合計	1,416,846	35,321,028
営業費用		
支払利息	888	1,722
受託者報酬	35,239	155,955
委託者報酬	1,128,910	4,991,840
その他費用	4,686	20,732
営業費用合計	1,169,723	5,170,249
営業利益又は営業損失()	247,123	30,150,779
経常利益又は経常損失()	247,123	30,150,779
中間純利益又は中間純損失()	247,123	30,150,779
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()	5,792	891,887
期首剰余金又は期首欠損金()	-	74,620,165
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,764,630	8,247,956
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	27,764,630	8,247,956
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,362	2,431,862
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,362	2,431,862
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()	27,991,599	109,695,151

(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2期中間計算期間	
	自	至
	2021年3月26日	2021年9月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間末
	2021年3月25日現在	2021年9月25日現在
1. 期首元本額	10,000,000円	1,259,365,752円
期中追加設定元本額	1,275,112,875円	110,362,858円
期中一部解約元本額	25,747,123円	40,481,496円
2. 受益権の総数	1,259,365,752口	1,329,247,114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1期	第2期中間計算期間末
	2021年3月25日現在	2021年9月25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1期 2021年3月25日現在	第2期中間計算期間末 2021年9月25日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0593円 (10,593円)	1.0825円 (10,825円)

(参考)

当ファンドは、「SMDAM・ターゲットリターン型マルチアセットファンド(4%コース向け)(適格機関投資家限定)」投資信託証券、「SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)」投資信託証券、「SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(4%コース)(FOFs用)(適格機関投資家専用)」投資信託証券、「フィデリティ・ターゲット・リターン・ファンド(適格機関投資家専用)」投資信託証券及び「東京海上キャリアターゲット(4%コース向け)(FOFs用)<適格機関投資家限定>」投資信託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「投資信託受益証券」は、すべて同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。

SMDAM・ターゲットリターン型マルチアセットファンド(4%コース向け)(適格機関投資家限定)

「SMDAM・ターゲットリターン型マルチアセットファンド(4%コース向け)(適格機関投資家限定)」は、「Oneターゲットリターン・ファンド(4%コース)」が投資対象とする国内投資信託であります。

以下は、当該ファンドの運用会社より提供を受けた直近の監査済み財務諸表であります。

(1)中間貸借対照表

区分	前計算期間末 2021年1月12日現在 金額(円)	当中間計算期間末 2021年7月12日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	135,087	137,193
親投資信託受益証券	878,061,446	924,344,263
未収入金	1,200,439	1,648,676
流動資産合計	879,396,972	926,130,132
資産合計	879,396,972	926,130,132
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	68,569	96,985
未払委託者報酬	1,063,486	1,503,982
その他未払費用	66,278	45,993
流動負債合計	1,198,333	1,646,960
負債合計	1,198,333	1,646,960
純資産の部		
元本等		
元本	839,974,057	872,733,738
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	38,224,582	51,749,434
(分配準備積立金)	28,383,635	28,289,850
元本等合計	878,198,639	924,483,172
純資産合計	878,198,639	924,483,172
負債純資産合計	879,396,972	926,130,132

(2) 中間損益及び剰余金計算書

区分	前中間計算期間	当中間計算期間
	自 2020年 2月26日 至 2020年 8月25日 金額(円)	自 2021年 1月13日 至 2021年 7月12日 金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益	38,705,975	13,931,491
営業収益合計	38,705,975	13,931,491
営業費用		
受託者報酬	71,178	96,985
委託者報酬	1,104,126	1,503,982
その他費用	33,755	45,993
営業費用合計	1,209,059	1,646,960
営業利益又は営業損失()	37,496,916	12,284,531
経常利益又は経常損失()	37,496,916	12,284,531
中間純利益又は中間純損失()	37,496,916	12,284,531
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()	-	15,620
期首剰余金又は期首欠損金()	-	38,224,582
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,794,556	1,385,239
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,794,556	1,385,239
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	129,298
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	129,298
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	41,291,472	51,749,434

(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	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12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、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの中間計算期間は、前計算期末が休日のため、2021年1月13日から2021年7月12日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	前計算期末 2021年1月12日現在	当中間計算期末 2021年7月12日現在
1. 元本状況		
期首元本額	600,000,000円	839,974,057円
期中追加設定元本額	239,974,057円	35,614,761円
期中一部解約元本額	-	2,855,080円
2. 受益権の総数	839,974,057口	872,733,738口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間(自 2020年2月26日 至 2020年8月25日)

該当事項はありません。

当中間計算期間(自 2021年1月13日 至 2021年7月12日)

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	当中間計算期末 2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	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記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前計算期間末(2021年1月12日現在)

該当事項はありません。

当中間計算期間末(2021年7月12日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 1.0455円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,455円)」	1口当たり純資産額 1.0593円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,593円)」

<参考>

当ファンドは、「マルチアセット・キャリアマザーファンド(安定成長型)」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」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

マルチアセット・キャリアマザーファンド(安定成長型)

(1)中間貸借対照表

区分	前計算期間末 2021年1月12日現在 金額(円)	当中間計算期間末 2021年7月12日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	14,163,736	40,331,708
コール・ローン	180,284,709	50,077,691
国債証券	505,228,633	599,699,966
投資信託受益証券	73,989,826	85,195,416
投資証券	58,523,218	87,933,289
派生商品評価勘定	339,680	8,879,789
未収入金	-	4,240,651
未収配当金	127,020	738,468
未収利息	1,637,889	2,690,568
前払費用	464,114	364,482
差入委託証拠金	54,518,550	48,113,454
流動資産合計	889,277,375	928,265,482
資産合計	889,277,375	928,265,482
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,991,009	32,102
未払金	-	2,255,540
未払解約金	1,200,439	1,648,676
流動負債合計	11,191,448	3,936,318
負債合計	11,191,448	3,936,318
純資産の部		
元本等		
元本	837,205,803	868,254,991
剰余金		

中間剰余金又は中間欠損金()	40,880,124	56,074,173
元本等合計	878,085,927	924,329,164
純資産合計	878,085,927	924,329,164
負債純資産合計	889,277,375	928,265,482

(2) 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	当中間計算期間 自 2021年1月13日 至 2021年7月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券及び投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>国債証券 個別法に基づき、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が発表する売買参考統計値(平均値)、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く)又は価格情報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>また、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会社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. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 外国投資証券についての受取配当金は、原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 投資信託受益証券についての受取配当金は、原則として、投資信託受益証券の分配落ち日において、確定分配金額を計上しております。</p> <p>(2)有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1)外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p> <p>(2)当ファンドの中間計算期間は、前計算期末が休日のため、2021年1月13日から2021年7月12日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 元本状況		
期首元本額	600,000,000円	837,205,803円
期中追加設定元本額	239,583,575円	35,441,332円
期中一部解約元本額	2,377,772円	4,392,144円
元本の内訳		

SMDAM・ターゲットリターン型マルチアセット ファンド(4%コース向け)(適格機関投資家限定) 合計	837,205,803円	868,254,991円
	837,205,803円	868,254,991円
2. 受益権の総数	837,205,803口	868,254,991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	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1. 金融商品の時価及び 中間貸借対照表計 上額との差額	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関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額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。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(債券関連)

区分	種類	前計算期間末 2021年1月12日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建				
	EURO-OAT FUTURE MAR21	63,864,316	-	63,575,372	288,944
	US 10YR NOTE (CBT) MAR21	747,255,826	-	739,401,133	7,854,693
	US LONG BOND(CBT) MAR21	36,382,784	-	35,092,938	1,289,846
	合計	-	-	838,069,443	9,433,483

区分	種類	当中間計算期間末 2021年7月12日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建				
	EURO-OAT FUTURE SEP21	103,360,882	-	104,649,459	1,288,577
	US 10YR NOTE (CBT) SEP21	712,790,419	-	720,255,337	7,464,918
	US LONG BOND(CBT) SEP21	71,596,729	-	71,665,585	68,856
	合計	-	-	896,570,381	8,822,351

(注) 時価の算定方法

1) 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

外国先物においては、契約額等には、手数料相当額を含んでおりません。

2) 期末の評価においては、取引所の発表する計算日に知りうる直近の日の清算値段等又は最終相場で評価しております。

3) 契約額等及び時価の邦貨換算は中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

(通貨関連)

区分	種類	前計算期間末 2021年1月12日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	3,645,130	-	3,678,966	33,836
	カナダ・ドル	49,928,956	-	50,234,800	305,844
	売建				
	オーストラリア・ドル	21,095,940	-	21,568,605	472,665
	イギリス・ポンド	3,692,779	-	3,720,552	27,773
	ユーロ	108,360,427	-	108,417,515	57,088
合計	-	-	187,620,438	217,846	

区分	種類	当中間計算期間末 2021年7月12日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
	為替予約取引 買建				
	カナダ・ドル	59,193,763	-	59,236,375	42,612
	オーストラリア・ドル	14,001,846	-	14,000,775	1,071

市場取引 以外の取引	売建				
	アメリカ・ドル	154,043,166	-	154,028,340	14,826
	イギリス・ポンド	176,784,358	-	176,802,493	18,135
	ユーロ	156,236,929	-	156,249,825	12,896
	合計	-	-	560,317,808	25,336

(注) 時価の算定方法

A. 中間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きましては、以下のように評価しております。

中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

中間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には、以下の方法によっております。

- ・ 中間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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 中間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おります。

B. 中間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きましては、中間計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(1口当たり情報)

前計算期間末 2021年1月12日現在	当中間計算期間末 2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 1.0488円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,488円)」	1口当たり純資産額 1.0646円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,646円)」

SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)

「SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)」は、「One ターゲットリターン・ファンド(4%コース)」が投資対象とする国内投資信託であります。以下は、当該ファンドの運用会社より提供を受けた直近の監査済み財務諸表であります。

(1) 貸借対照表

期別	第1期 (2021年 2月22日現在)
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,248,635
親投資信託受益証券	263,283,043
未収入金	101,792,178
流動資産合計	368,323,856
資産合計	368,323,856
負債の部	
流動負債	
未払解約金	101,610,000
未払受託者報酬	43,670
未払委託者報酬	451,217
未払利息	2
その他未払費用	7,233
流動負債合計	102,112,122
負債合計	102,112,122
純資産の部	
元本等	
元本	262,114,877
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	4,096,857
(分配準備積立金)	1,672,062
元本等合計	266,211,734
純資産合計	266,211,734
負債純資産合計	368,323,856

(2) 損益及び剰余金計算書

項目	期別	第1期 自 2020年 3月25日 至 2021年 2月22日
	金額(円)	
営業収益		
受取利息		10
有価証券売買等損益		3,120,013
営業収益合計		3,120,023
営業費用		
支払利息		718
受託者報酬		70,676
委託者報酬		730,223
その他費用		11,672
営業費用合計		813,289
営業利益又は営業損失()		2,306,734
経常利益又は経常損失()		2,306,734
当期純利益又は当期純損失()		2,306,734
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()		671,016
期首剰余金又は期首欠損金()		-
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,400,123
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,400,123
剰余金減少額又は欠損金増加額		938,984
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		938,984
分配金		-
期末剰余金又は期末欠損金()		4,096,857

(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、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年2月21日から翌年2月20日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2020年3月25日から2021年2月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2021年2月22日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		262,114,877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)	1.0156円 (10,156円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年 3月25日 至 2021年 2月22日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,672,062円
収益調整金額	C	2,428,818円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,100,880円
当ファンドの期末残存口数	F	262,114,877口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	156円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 2020年 3月25日 至 2021年 2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める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そのリスク	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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (2021年 2月22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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
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。

(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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)
 元本の移動

区分	第1期 自 2020年 3月25日 至 2021年 2月22日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	100,000,000円
期中追加設定元本額	262,114,877円
期中一部解約元本額	100,000,000円

(有価証券に関する注記)
 売買目的有価証券

種類	第1期 (2021年 2月22日現在)
	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	2,247,191
合計	2,247,191

(デリバティブ取引に関する注記)

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

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	258,297,894	263,283,043	
合計		258,297,894	263,283,043	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(4%コース)(FoFs用)(適格機関投資家専用)

「SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(4%コース)(FoFs用)(適格機関投資家専用)」は、「Oneターゲットリターン・ファンド(4%コース)」が投資対象とする国内投資信託であります。

以下は、当該ファンドの運用会社より提供を受けた直近の監査済み財務諸表であります。

(1) 貸借対照表

	第1期 2021年1月20日現在
科 目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	52,862
コール・ローン	4,306,568
投資信託受益証券	70,404,891
親投資信託受益証券	290,702,756
流動資産合計	365,467,077
資産合計	365,467,077
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	300,674
未払受託者報酬	60,060
未払委託者報酬	620,562
未払利息	9
その他未払費用	6,900
流動負債合計	988,205
負債合計	988,205
純資産の部	
元本等	
元本	348,040,672
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	16,438,200
元本等合計	364,478,872
純資産合計	364,478,872
負債純資産合計	365,467,077

(2) 損益及び剰余金計算書

	第1期 自 2020年3月23日 至 2021年1月20日
科 目	金額(円)
営業収益	
受取配当金	557,751
有価証券売買等損益	12,236,395
為替差損益	99,274
営業収益合計	12,694,872
営業費用	
支払利息	10,788
受託者報酬	60,060
委託者報酬	620,562
その他費用	39,593
営業費用合計	731,003
営業利益又は営業損失()	11,963,869
経常利益又は経常損失()	11,963,869
当期純利益又は当期純損失()	11,963,869
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()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,474,331
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,474,331
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()	16,438,200

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき計算期間末日の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
4. 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及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。 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。 第1期計算期間の取扱い 当ファンドは2020年3月23日に設定されたため、当計算期間は2020年3月23日から2021年1月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

期別	第1期 2021年1月20日現在
1. 受益権の総数	348,040,672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) 1.0472円 (10,472円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2020年3月23日 至 2021年1月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(2,283,782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(9,680,087円)、信託約款に規定される収益調整金(4,474,331円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は16,438,200円(1万口当たり472.29円)であります。分配を行っておりません。

(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	第1期
	自 2020年3月23日 至 2021年1月20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。
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。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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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> <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>

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。
----------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2021年1月20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。
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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 2021年1月20日現在
該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 自 2020年3月23日 至 2021年1月20日
期首元本額	100,000,000円
期中追加設定元本額	248,040,672円
期中一部解約元本額	- 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 2021年1月20日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	9,487,849	
親投資信託受益証券	376,481	
合計	9,111,368	

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第1期 2021年1月20日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
	うち1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	32,531,726	-	32,832,400	300,674
ドル	32,531,726	-	32,832,400	300,674
合計	32,531,726	-	32,832,400	300,674

(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。

(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

2021年1月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	日本円	TOPIX連動型上場投資信託	18,350	35,268,700	
	日本円 小計		18,350	35,268,700	
	ドル	ISHARES CORE S&P 500 ETF	531	201,806.55	
		VANGUARD FTSE EUROPE ETF	2,205	136,269.00	
	ドル 小計		2,736	338,075.55	(35,136,191)
投資信託受益証券 合計			21,086	70,404,891	(35,136,191)
親投資信託受益証券	日本円	損保ジャパン日本債券マザーファンド	114,754,539	166,405,557	
		損保ジャパン外国債券マザーファンド	69,536,895	124,297,199	
親投資信託受益証券 合計			184,291,434	290,702,756	
合計				361,107,647	(35,136,191)

(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、口数を表示しております。

(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 投資信託受益証券 時価比率	有価証券の合計金額に対する比 率
ドル	投資信託受益証券 2銘柄	9.64%	9.73%

(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

注記事項(デリバティブ取引等に関する注記)において表示した表は、「投資信託財産計算規則」附属明細表別紙様式第1号第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に求められている項目(記載上の注意を含む。)を満たしているため、省略いたします。

(参考)

SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(4%コース)(FofS用)(適格機関投資家専用)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。

損保ジャパン日本債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年1月20日現在
科 目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	239,780,835
国債証券	13,177,182,800
地方債証券	1,320,503,000
特殊債券	621,083,900
社債券	3,632,227,000
未収利息	23,248,200
前払費用	2,949,119
流動資産合計	19,016,974,854
資産合計	19,016,974,854
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払利息	545
流動負債合計	100,000,545
負債合計	100,000,545
純資産の部	
元本等	
元本	13,044,889,468
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,872,084,841
元本等合計	18,916,974,309
純資産合計	18,916,974,309
負債純資産合計	19,016,974,854

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、地方債証券、特殊債券及び社債券</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．費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

期別	2021年1月20日現在	
1．受益権の総数	13,044,889,468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)	1.4501円 (14,501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 2020年3月23日 至 2021年1月20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。	
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、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</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>	

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>
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る場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年1月20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。
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年1月20日現在
該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	自 2020年3月23日 至 2021年1月20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	11,099,348,765円
同期中追加設定元本額	2,672,338,252円
同期中一部解約元本額	726,797,549円
元本の内訳*	
SNAM絶対収益ターゲットファンド(適格機関投資家専用)	358,356,046円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(2%コース)(FoFs用)(適格機関投資家専用)	51,710,878円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(4%コース)(FoFs用)(適格機関投資家専用)	114,754,539円
損保ジャパン日本債券ファンド	1,051,715,059円
ハッピーエイジング20	152,782,624円
ハッピーエイジング30	756,219,022円
ハッピーエイジング40	4,074,147,927円
ハッピーエイジング50	3,235,471,656円
ハッピーエイジング60	2,558,320,626円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジありコース	966,661円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 円ヘッジなしコース	7,502,335円
好配当グローバルREITプレミアム・ファンド 通貨セレクトコース	141,396,371円
好配当米国株式プレミアム・ファンド 通貨セレクト・プレミアムコース	6,842,858円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2035	247,488,061円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2045	84,553,171円
SOMPOターゲットイヤー・ファンド2055	28,928,646円
ターゲット・リターン戦略ファンド	173,732,988円
計	13,044,889,468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	2021年1月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	38,947,200
地方債証券	1,996,000
特殊債券	493,631
社債券	17,128,000
合計	24,308,831

(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

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年1月20日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第410回利付国債(2年)	830,000,000	832,207,800	
	第412回利付国債(2年)	200,000,000	200,612,000	
	第413回利付国債(2年)	620,000,000	622,021,200	
	第417回利付国債(2年)	600,000,000	602,442,000	
	第418回利付国債(2年)	330,000,000	331,527,900	
	第138回利付国債(5年)	1,090,000,000	1,097,324,800	
	第139回利付国債(5年)	170,000,000	171,212,100	
	第10回利付国債(40年)	10,000,000	10,700,600	
	第12回利付国債(40年)	160,000,000	150,136,000	
	第13回利付国債(40年)	50,000,000	46,854,500	
	第342回利付国債(10年)	340,000,000	343,791,000	
	第345回利付国債(10年)	160,000,000	161,998,400	
	第350回利付国債(10年)	20,000,000	20,273,800	
	第351回利付国債(10年)	100,000,000	101,341,000	
	第353回利付国債(10年)	200,000,000	202,544,000	
第355回利付国債(10年)	120,000,000	121,417,200		

第356回利付国債（10年）	30,000,000	30,338,700	
第358回利付国債（10年）	70,000,000	70,673,400	
第359回利付国債（10年）	200,000,000	201,692,000	
第360回利付国債（10年）	710,000,000	715,474,100	
第38回利付国債（30年）	310,000,000	394,326,200	
第43回利付国債（30年）	660,000,000	829,461,600	
第53回利付国債（30年）	160,000,000	160,539,200	
第55回利付国債（30年）	120,000,000	125,901,600	
第57回利付国債（30年）	490,000,000	513,299,500	
第58回利付国債（30年）	70,000,000	73,269,000	
第60回利付国債（30年）	160,000,000	171,184,000	
第63回利付国債（30年）	50,000,000	46,889,500	
第66回利付国債（30年）	120,000,000	112,095,600	
第67回利付国債（30年）	170,000,000	167,487,400	
第68回利付国債（30年）	70,000,000	68,872,300	
第113回利付国債（20年）	180,000,000	213,300,000	
第130回利付国債（20年）	110,000,000	130,209,200	
第131回利付国債（20年）	80,000,000	93,851,200	
第144回利付国債（20年）	140,000,000	163,055,200	
第148回利付国債（20年）	80,000,000	93,754,400	
第149回利付国債（20年）	40,000,000	46,944,800	
第150回利付国債（20年）	120,000,000	139,429,200	
第151回利付国債（20年）	740,000,000	840,728,800	
第152回利付国債（20年）	270,000,000	306,963,000	
第154回利付国債（20年）	340,000,000	387,052,600	
第157回利付国債（20年）	80,000,000	79,112,800	
第158回利付国債（20年）	260,000,000	268,582,600	
第166回利付国債（20年）	410,000,000	432,787,800	
第167回利付国債（20年）	30,000,000	30,603,600	
第170回利付国債（20年）	820,000,000	802,968,600	
第171回利付国債（20年）	460,000,000	449,930,600	
国債証券 合計	12,550,000,000	13,177,182,800	
地方債証券			
第807回東京都公募公債	400,000,000	398,696,000	
令和2年度第10回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,574,000	

	第15回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,848,000	
	第135回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,714,000	
	第180回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,712,000	
	第183回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,959,000	
地方債証券 合計		1,300,000,000	1,320,503,000	
特殊債券	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	400,000,000	399,948,000	
	第78回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	95,522,000	
	第17回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,812,000	10,900,658	
	第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,984,000	12,265,743	
	第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,224,000	24,985,118	
	第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,010,000	29,615,813	
	第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,690,000	47,846,568	
特殊債券 合計		620,720,000	621,083,900	
社債券	第1回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	100,000,000	103,183,000	
	第1回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	100,000,000	102,665,000	
	第1回積水ハウス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保	100,000,000	100,811,000	
	第1回アサヒホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	200,000,000	201,540,000	
	第14回株式会社セブン&アイホールディングス無担保社債(特)	100,000,000	100,333,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,349,000	
	第21回大王製紙株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,716,000	
	第1回大陽日酸株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	100,000,000	101,726,000	
	第1回武田薬品工業株式会社無担保社債(劣後特約付)FR	200,000,000	206,154,000	
	日本製鉄株式会社第1回無担保社債(劣後特約付)FR	100,000,000	99,787,000	
	第1回日本生命第1回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	100,000,000	101,090,000	
	第1回日本生命第5回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	200,000,000	199,642,000	

第1回ドンキホーテホールディングス無担保社債 (劣後特約付)	100,000,000	101,850,000	
第1回ニプロ利払繰延条項・期限前償還条項付無担	100,000,000	101,505,000	
第17回NTTファイナンス株式会社無担保社債 (日本電信電話保)	100,000,000	100,759,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債 (日本電信電話保)	100,000,000	101,203,000	
第69回アコム株式会社無担保社債(特定社債間 限定同順位特約付)	100,000,000	102,864,000	
第29回株式会社ジャックス無担保社債(社債間 限定同順位特約付)	100,000,000	100,000,000	
第3回三井住友海上火災保険株式会社利払繰延条 項・期限前償還条	400,000,000	402,572,000	
第2回株式会社T&Dホールディングス無担保社 債(劣後特約付)	100,000,000	100,094,000	
第1回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前	200,000,000	203,310,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債 (一般担保付)	200,000,000	202,066,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債 (一般担保付)	100,000,000	101,043,000	
第3回A号富国生命劣後FR	200,000,000	198,180,000	
第3回A号明治安田生命劣後FR	200,000,000	199,746,000	
第2回A号住友生命劣後FR	100,000,000	100,039,000	
社債券 合計	3,600,000,000	3,632,227,000	
合計		18,750,996,700	

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。

損保ジャパン外国債券マザーファンド

貸借対照表

	2021年1月20日現在
科 目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,068,690
コール・ローン	8,460,062
国債証券	1,757,096,097
派生商品評価勘定	1,697,664
未収利息	9,445,368
前払費用	1,334,023
流動資産合計	1,785,101,904
資産合計	1,785,101,904
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,052,857
未払利息	19
流動負債合計	11,052,876
負債合計	11,052,876
純資産の部	
元本等	
元本	992,494,025
剰余金	
剰余金又は欠損金()	781,555,003
元本等合計	1,774,049,028
純資産合計	1,774,049,028
負債純資産合計	1,785,101,904

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	2021年1月20日現在	
1. 受益権の総数	992,494,025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	1.7875円
	(1万口当たり純資産額)	(17,875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 2020年3月23日 至 2021年1月20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。
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、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。 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。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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	(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。 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。
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る場合、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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年1月20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。
------------	--

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年1月20日現在
該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	自 2020年3月23日 至 2021年1月20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	935,665,457円
同期中追加設定元本額	358,299,669円
同期中一部解約元本額	301,471,101円
元本の内訳*	
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(2%コース)(FoFs用)(適格機関投資家専用)	29,524,556円
SOMPOターゲット・リターン戦略ファンド(4%コース)(FoFs用)(適格機関投資家専用)	69,536,895円
損保ジャパン外国債券ファンド	789,225,728円
ターゲット・リターン戦略ファンド	104,206,846円
計	992,494,025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	2021年1月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	21,928,942
合計	21,928,942

(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	2021年1月20日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
	うち1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	1,758,489,127	-	1,767,844,320	9,355,193
ドル	752,732,274	-	761,483,100	8,750,826
カナダドル	41,039,130	-	41,325,020	285,890
メキシコペソ	15,110,100	-	15,462,180	352,080
ユーロ	733,397,717	-	731,823,560	1,574,157
債券	120,808,781	-	122,321,620	1,512,839
スウェーデンク ローナ	6,207,851	-	6,155,240	52,611
ノルウェーク ローネ	3,668,545	-	3,678,360	9,815
デンマークク ローネ	8,160,000	-	8,140,800	19,200
ポーランドズロ チ	10,013,946	-	9,962,250	51,696
オーストラリア ドル	52,696,935	-	52,779,310	82,375
シンガポールド ドル	14,653,848	-	14,712,880	59,032
合計	1,758,489,127	-	1,767,844,320	9,355,193

(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

2021年1月20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 0.125 220630	710,000	710,021.30	
		Treasury 1.5 300215	610,000	635,443.10	
		Treasury 1.625 230531	60,000	62,076.00	
		Treasury 1.75 291115	100,000	106,515.00	
		Treasury 1.875 220228	80,000	81,565.60	
		Treasury 1.875 260630	650,000	697,274.50	
		Treasury 2.125 240229	270,000	286,008.30	
		Treasury 2.125 250515	820,000	882,074.00	
		Treasury 2.25 270215	20,000	21,948.40	
		Treasury 2.25 270815	780,000	857,750.40	
		Treasury 2.375 290515	150,000	167,296.50	
		Treasury 2.75 250228	650,000	714,135.50	
		Treasury 2.75 280215	490,000	556,605.70	
		Treasury 2.75 421115	200,000	239,436.00	
		Treasury 2.75 470815	50,000	60,343.50	
		Treasury 2.875 430515	60,000	73,302.60	
		Treasury 2.875 490515	130,000	161,341.70	

	Treasury 3.0 441115	115,000	143,695.95
	Treasury 3.0 450515	90,000	112,653.90
	Treasury 3.0 470215	40,000	50,406.00
	Treasury 3.0 480215	280,000	353,805.20
	Treasury 3.5 390215	50,000	65,929.50
	Treasury 4.625 400215	90,000	136,195.20
	Treasury 6.125 271115	85,000	115,546.45
ドル 合計		6,580,000	7,291,370.30 (757,792,115)
カナダドル	CANADA 1.5 230601	123,000	126,880.65
	CANADA 3.5 451201	50,000	72,703.50
	CANADA 5.0 370601	28,000	44,299.08
	CANADA 5.75 290601	179,000	252,339.88
カナダドル 合計		380,000	496,223.11 (40,536,465)
メキシコペソ	MEXICO 8.0 231207	1,060,000	1,164,399.40
	MEXICO 8.5 290531	880,000	1,070,748.80
	MEXICO 8.5 381118	570,000	698,780.10
メキシコペソ 合計		2,510,000	2,933,928.30 (15,520,480)
ユーロ	AUSTRIA 0.75 261020	100,000	107,931.00
	AUSTRIA 3.8 620126	10,000	24,015.80
	AUSTRIA 4.15 370315	50,000	85,127.50
	BELGIUM 2.25 230622	85,000	91,114.05
	BELGIUM 3.0 340622	80,000	113,833.60
	BELGIUM 4.25 410328	40,000	72,424.80
	BELGIUM 5.0 350328	20,000	34,665.00
	BELGIUM 5.5 280328	37,000	53,288.14
	FINLAND 0.75 310415	80,000	89,468.00
	FRA 0.00 240325	20,000	20,424.00
	FRA 0.75 281125	110,000	120,524.80
	FRANCE 0.0 220225	10,000	10,064.50
	FRANCE 0.0 220525	250,000	252,125.00
	FRANCE 0.0 291125	220,000	227,466.80
	FRANCE 0.25 261125	70,000	73,370.50

FRANCE 1.0 270525	180,000	197,852.40	
FRANCE 1.25 340525	90,000	106,541.10	
FRANCE 2.75 271025	75,000	91,893.00	
FRANCE 4.0 381025	35,000	59,823.40	
FRANCE 4.0 550425	20,000	42,872.60	
FRANCE 4.0 600425	30,000	68,020.50	
FRANCE 5.75 321025	130,000	223,180.10	
GERMANY 0 300215	200,000	210,882.00	
GERMANY 0.0 220408	280,000	282,307.20	
GERMANY 0.0 220610	160,000	161,492.80	
GERMANY 0.25 290215	110,000	118,099.30	
GERMANY 1.5 240515	95,000	102,209.55	
GERMANY 2.5 460815	50,000	85,355.50	
GERMANY 4.0 370104	70,000	120,477.70	
IRELAND 1.0 260515	100,000	108,438.00	
IRELAND 2.0 450218	10,000	14,262.40	
ITALY 1.0 220715	360,000	367,462.80	
ITALY 1.35 220415	50,000	51,069.50	
ITALY 1.75 240701	10,000	10,667.40	
ITALY 2.0 251201	88,000	96,662.72	
ITALY 2.45 330901	260,000	311,662.00	
ITALY 2.7 470301	50,000	64,472.50	
ITALY 2.8 281201	135,000	160,627.05	
ITALY 2.8 670301	10,000	13,294.10	
ITALY 3.25 460901	30,000	42,231.60	
ITALY 4.0 370201	5,000	7,202.35	
ITALY 4.75 440901	20,000	33,963.60	
ITALY 5.0 400901	95,000	158,384.00	
NETHERLANDS 0.5 260715	80,000	85,208.00	
NETHERLANDS 2.25 220715	10,000	10,439.60	
NETHERLANDS 2.5 330115	40,000	54,228.40	
NETHERLANDS 2.75 470115	30,000	52,988.10	
NETHERLANDS 4.0 370115	20,000	34,082.80	
NETHERLANDS 5.5 280115	20,000	28,715.40	
SPAIN 0.25 240730	220,000	225,579.20	

	SPAIN 0.4 220430	50,000	50,603.00	
	SPAIN 0.45 221031	50,000	50,904.50	
	SPAIN 1.5 270430	30,000	33,368.70	
	SPAIN 2.15 251031	10,000	11,227.40	
	SPAIN 3.45 660730	10,000	17,988.30	
	SPAIN 4.2 370131	40,000	63,428.00	
	SPAIN 4.7 410730	70,000	124,866.70	
	SPAIN 4.9 400730	10,000	18,004.80	
	SPAIN 5.15 281031	50,000	70,583.00	
	SPAIN 5.75 320730	90,000	147,350.70	
	SPAIN 6.0 290131	15,000	22,374.90	
ユーロ 合計		4,775,000	5,789,192.16 (730,596,050)	
ポンド	UK GILT 1.5 260722	35,000	37,882.60	
	UK GILT 2.25 230907	30,000	31,846.20	
	UK GILT 3.5 450122	60,000	94,818.00	
	UK GILT 4.0 600122	27,000	56,083.59	
	UK GILT 4.25 271207	30,000	38,586.30	
	UK GILT 4.25 360307	25,000	38,192.00	
	UK GILT 4.25 390907	145,000	234,463.55	
	UK GILT 4.25 401207	10,000	16,457.10	
	UK GILT 4.25 461207	28,000	50,211.56	
	UK GILT 4.25 491207	20,000	37,490.00	
	UK GILT 4.25 551207	30,000	61,183.20	
	UK GILT 4.5 340907	20,000	30,499.80	
	UK GILT 4.5 421207	25,000	43,635.00	
	UK GILT 5.0 250307	20,000	24,187.20	
	UK GILT 6.0 281207	30,000	43,657.50	
	UK GILT 1.75 220907	10,000	10,305.70	
ポンド 合計		545,000	849,499.30 (120,425,020)	
スウェーデンクローナ	SWEDEN 1.5 231113	140,000	147,317.80	
	SWEDEN 2.5 250512	265,000	296,924.55	
	SWEDEN 3.5 390330	10,000	15,476.70	

スウェーデンクローナ 合計		415,000	459,719.05 (5,728,099)
ノルウェークローネ	NORWAY 1.375 300819	110,000	113,422.10
	NORWAY 2.0 230524	130,000	134,774.90
ノルウェークローネ 合計		240,000	248,197.00 (3,023,039)
デンマーククローネ	DENMARK 1.5 231115	260,000	275,605.20
	DENMARK 4.5 391115	90,000	170,334.90
デンマーククローネ 合計		350,000	445,940.10 (7,563,144)
ポーランドズロチ	POLAND 2.5 260725	300,000	332,442.00
ポーランドズロチ 合計		300,000	332,442.00 (9,225,265)
オーストラリアドル	AUSTRALIA 3.75 370421	50,000	65,484.50
	AUSTRALIA 4.75 270421	470,000	590,677.20
オーストラリアドル 合計		520,000	656,161.70 (52,558,552)
シンガポールドル	SINGAPORE 2.875 290701	50,000	57,993.00
	SINGAPORE 3.5 270301	105,000	122,485.65
シンガポールドル 合計		155,000	180,478.65 (14,127,868)
合計			1,757,096,097 (1,757,096,097)

(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 24銘柄	42.72%	43.13%
カナダドル	国債証券 4銘柄	2.28%	2.31%
メキシコペソ	国債証券 3銘柄	0.87%	0.88%
ユーロ	国債証券 61銘柄	41.18%	41.58%
ポンド	国債証券 16銘柄	6.79%	6.85%
スウェーデンクローナ	国債証券 3銘柄	0.32%	0.33%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	0.17%	0.17%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	0.43%	0.43%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	0.52%	0.53%
オーストラリアドル	国債証券 2銘柄	2.96%	2.99%
シンガポールドル	国債証券 2銘柄	0.80%	0.80%

（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

注記事項（デリバティブ取引等に関する注記）において表示した表は、「投資信託財産計算規則」附属明細表別紙様式第1号第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に求められている項目（記載上の注意を含む。）を満たしているため、省略いたします。

フィデリティ・ターゲット・リターン・ファンド(適格機関投資家専用)

「フィデリティ・ターゲット・リターン・ファンド(適格機関投資家専用)」は、「One ターゲットリターン・ファンド(4%コース)」が投資対象とする国内投資信託であります。

以下は、当該ファンドの運用会社より提供を受けた直近の監査済み財務諸表であります。

(1) 貸借対照表

区 分	当監査対象期間
	2021年1月25日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	1,637,641,452
未収入金	2,171,289
流動資産合計	1,639,812,741
資産合計	1,639,812,741
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	180,421
未払委託者報酬	1,864,733
その他未払費用	107,436
流動負債合計	2,152,590
負債合計	2,152,590
純資産の部	
元本等	
元本	1,252,578,512
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	385,081,639
(分配準備積立金)	348,708,136
元本等合計	1,637,660,151
純資産合計	1,637,660,151
負債純資産合計	1,639,812,741

(2) 損益及び剰余金計算書

区 分	当監査対象期間 自 2020年 3月16日(設定日) 至 2021年 1月25日
	金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	353,272,258
営業収益合計	353,272,258
営業費用	
受託者報酬	383,609
委託者報酬	3,964,839
その他費用	215,674
営業費用合計	4,564,122
営業利益又は営業損失()	348,708,136
経常利益又は経常損失()	348,708,136
当期純利益又は当期純損失()	348,708,136
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,373,503
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	36,373,503
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	385,081,639

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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	当監査対象期間 2021年1月25日現在
1. 元本の推移	
期首元本額	1,050,237,000 円
期中追加設定元本額	202,341,512 円
期中一部解約元本額	- 円
2. 受益権の総数	1,252,578,512 口
3. 1口当たり純資産額	1.3074 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

当監査対象期間 自 2020年3月16日(設定日) 至 2021年1月25日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として、委託者報酬の中から支弁している額 純資産総額に対して年率0.32%以内の額
2. 分配金の計算過程 計算期間末における配当等収益から費用を控除した額(4,425,703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)、有価証券売買等損益から費用を控除した額(344,282,433円)、信託約款に規定される収益調整金(36,373,503円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は385,081,639円(1口当たり0.307431円)ですが、分配は行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドおよび主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を当ファンドおよび親投資信託受益証券の貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。</p> <p>当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク等があります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行う方法を併用し検証しています。

. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 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。</p> <p>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>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	当監査対象期間 2021年1月25日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	352,370,073
合 計	352,370,073

(デリバティブ取引に関する注記)

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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	フィデリティ・ターゲット・リターン・マ ザーファンド	1,248,582,992	1,637,641,452	
親投資信託受益証券	合計	1,248,582,992	1,637,641,452	
合計		1,248,582,992	1,637,641,452	

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

(参考情報)

ファンドは、「フィデリティ・ターゲット・リターン・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す。

なお、同親投資信託の状況は以下のとおりです。

「フィデリティ・ターゲット・リターン・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区 分	2021年1月25日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2
金銭信託	295,982,126
投資信託受益証券	1,275,900,497
派生商品評価勘定	21,381,653
未収入金	123,312
差入委託証拠金	50,691,830
流動資産合計	1,644,079,420
資産合計	1,644,079,420
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,229,354
未払解約金	2,171,289
その他未払費用	22,582
流動負債合計	6,423,225
負債合計	6,423,225
純資産の部	
元本等	
元本	1,248,582,992
剰余金	
剰余金又は欠損金()	389,073,203
元本等合計	1,637,656,195
純資産合計	1,637,656,195
負債純資産合計	1,644,079,420

(2) 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>投資信託受益証券</p> <p>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、金融商品取引所等に上場されているものについては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しており、金融商品取引所等に上場されていないものについては、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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 為替予約取引</p> <p>為替予約の評価は、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> <p>(2) 直物為替先渡取引</p> <p>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、価格情報会社の提供する価格等で評価しております。</p> <p>(3) 先物取引</p> <p>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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 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、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）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。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)

項 目	2021年1月25日現在
1. 元本の推移	
期首元本額	1,050,237,000 円
期中追加設定元本額	202,144,507 円
期中一部解約元本額	3,798,515 円
2. 期末元本額及びその内訳	
フィデリティ・ターゲット・リターン・ファンド（適格機関投資家専用）	1,248,582,992 円
計	1,248,582,992 円
3. 受益権の総数	1,248,582,992 口
4. 1口当たり純資産額	1.3116 円

(金融商品に関する注記)

・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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
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、デリバティブ取引、金銭債権および金銭債務であり、その内容を貸借対照表、有価証券に関する注記、デリバティブ取引に関する注記および附属明細表に記載しております。 デリバティブ取引は、為替変動リスク、価格変動リスクの回避および信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。 当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	投資リスクの管理および投資行動のチェックについては、運用部門が自ら行う方法と運用部門から独立したコンプライアンス部門が行う方法を併用し検証しています。

・金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2021年1月25日現在
	当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	190,552,296
合 計	190,552,296

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

種類	2021年1月25日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,246,020,122	-	1,245,129,921	890,201
南アフリカ・ランド	48,464,994	-	48,760,272	295,278
アメリカ・ドル	947,813,065	-	945,732,180	2,080,885
イギリス・ポンド	173,109,759	-	173,678,592	568,833
シンガポール・ドル	32,591,544	-	32,668,317	76,773
ユーロ	44,040,760	-	44,290,560	249,800
買建	131,553,539	-	131,606,228	52,689
アメリカ・ドル	46,697	-	46,697	-
スウェーデン・ク ローナ	48,739,465	-	49,196,826	457,361
メキシコ・ペソ	82,767,377	-	82,362,705	404,672
合計	1,377,573,661	-	1,376,736,149	942,890

(注1) 時価の算定方法

1. 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。

(1) 予約為替の受渡し日(以下「当該日」という。)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対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 当該日の対顧客先物相場の仲値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。

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、発表されている対顧客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算出したレートにより評価しております。

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により評価しております。

2. 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、対顧客相場の仲値により評価しております。

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されていません。

種類	2021年1月25日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
直物為替先渡取引				
売建	106,501,745	-	106,497,288	4,457
台湾・ドル	106,501,745	-	106,497,288	4,457
買建	227,679,755	-	226,356,870	1,322,885
フィリピン・ペソ	65,496,967	-	65,386,784	110,183
チリ・ペソ	48,541,053	-	49,105,653	564,600
ロシア・ルーブル	48,632,091	-	47,601,897	1,030,194
インドネシア・ルピア	40,641,805	-	40,804,978	163,173
ブラジル・リアル	24,367,839	-	23,457,558	910,281
合計	334,181,500	-	332,854,158	1,318,428

(注1) 時価の算定方法

1. 価格情報会社が計算し、提供する価格等により評価しております。
2. 直物為替先渡取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

株式関連

種類	2021年1月25日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
先物取引				
買建	395,101,562	-	413,212,739	18,111,177
合計	395,101,562	-	413,212,739	18,111,177

(注1) 時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

2. 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されていません。

債券関連

種類	2021年1月25日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
先物取引				
買建	107,888,541	-	107,305,201	583,340
合計	107,888,541	-	107,305,201	583,340

(注1) 時価の算定方法

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
2. 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

(注2) デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されていません。

(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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	日本円	TOPIX連動型上場投資信託	33,140	64,125,900	
	日本円 小計		33,140	64,125,900	
	アメリカ・ドル	AMUNDI PHYSICAL GOLD ETC	6,152.00	455,106.50	
		ISHARES CORE EM IMI ACC	13,670.00	523,561.00	
		ISHARES CORE S&P 500 UCITS ETF	7,948.00	3,081,757.52	
		ISHARES GLB CORP USD H ACC	183,213.00	1,103,675.11	
		ISHARES II PLC-JPM EMER MKT BD	516,575.00	3,099,450.00	
		ISHARES USD CORP BOND USD A	112,112.00	723,010.28	
		ISHARES USD HY CORP USD DIST	6,951.00	719,567.52	
		LYXOR CORE US TIPS DR UCIT ETF	3,153.00	367,371.79	
	アメリカ・ドル 小計		849,774.00	10,073,499.72 (1,046,032,211)	
	イギリス・ポンド	ISHARES CORE FTSE 100 ACC	2,819.00	318,716.14	
		ISHR GLB HY CORP	111,035.00	556,840.52	
	イギリス・ポンド 小計		113,854.00	875,556.66 (124,425,356)	
	ユーロ	XTRACKERS CSI300 SWAP UCIT	19,924.00	326,952.84	
ユーロ 小計		19,924.00	326,952.84 (41,317,030)		
投資信託受益証券 合計				1,275,900,497 (1,211,774,597)	
合計				1,275,900,497 (1,211,774,597)	

(注) 投資信託受益証券における券面総額の数値は証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に関するもので、内書きであります。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 8銘柄	100%	86.32%
イギリス・ポンド	投資信託受益証券 2銘柄	100%	10.27%
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	100%	3.41%

信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

東京海上キャリアターゲット(4%コース向け)(FofS用) <適格機関投資家限定>

「東京海上キャリアターゲット(4%コース向け)(FofS用) <適格機関投資家限定>」は、「Oneターゲットリターン・ファンド(4%コース)」が投資対象とする国内投資信託であります。

以下は、当該ファンドの運用会社より提供を受けた直近の監査済み財務諸表であります。

(1)貸借対照表

		第1期 [2021年 1月18日現在]	
区 分	注記 番号	金額(円)	
資産の部			
流動資産			
	親投資信託受益証券		261,150,092
	未収入金		259,101
	流動資産合計		261,409,193
	資産合計		261,409,193
負債の部			
流動負債			
	未払受託者報酬		15,709
	未払委託者報酬		235,597
	その他未払費用		7,795
	流動負債合計		259,101
	負債合計		259,101
純資産の部			
元本等			
	元本	1	256,875,813
剰余金			
	期末剰余金又は期末欠損金()		4,274,279
	(分配準備積立金)		299,089
	元本等合計		261,150,092
	純資産合計		261,150,092
	負債純資産合計		261,409,193

(2)損益及び剰余金計算書

		第1期	
		自 2020年 3月10日	
		至 2021年 1月18日	
区 分	注記 番号	金額(円)	
営業収益			
有価証券売買等損益		713,147	
営業収益合計		713,147	
営業費用			
受託者報酬		21,335	
委託者報酬	1	319,911	
その他費用		10,517	
営業費用合計		351,763	
営業利益又は営業損失()		1,064,910	
経常利益又は経常損失()		1,064,910	
当期純利益又は当期純損失()		1,064,910	
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()			
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,339,189	
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		5,339,189	
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	2		
期末剰余金又は期末欠損金()		4,274,279	

(3)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第1期 自 2020年 3月10日 至 2021年 1月18日
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)

区 分	第1期 [2021年 1月18日現在]
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	255,875,813円
期中一部解約元本額	円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	256,875,813口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年 3月10日 至 2021年 1月18日
1. 1 投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託する場合における当該委託に要する費用純資産総額に対して年10,000分の16.42の率を乗じて得た金額
2. 2 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(299,089円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,975,190円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は4,274,279円(1万口当たり166.38円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

区 分	第1期 自 2020年 3月10日 至 2021年 1月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。
-------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 [2021年 1月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)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)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、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る場合、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)

第1期(自 2020年3月10日 至 2021年1月18日)

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	686,728円
合計	686,728円

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(1口当たり情報に関する注記)

第1期 [2021年 1月18日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0166円 10,166円)

(4)附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	東京海上キャリアターゲットマザーファンド	255,503,466	261,150,092	
親投資信託受益証券 合計		255,503,466	261,150,092	
合計		255,503,466	261,150,092	

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。

(ご参考)

当ファンドは、「東京海上キャリアターゲットマザーファンド」を主要な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」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「東京海上キャリアターゲットマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

			[2021年 1月18日現在]
区 分	注記 番号	金額(円)	
資産の部			
流動資産			
預金		13,422,106	
コール・ローン		366,288,236	
株式		118,671,980	
国債証券		903,889,412	
投資証券		331,356,924	
派生商品評価勘定		52,858,962	
未収配当金		293,500	
未収利息		24,284	
前払金		1,520,000	
前払費用		94,554	
差入委託証拠金		138,272,193	
流動資産合計		1,926,692,151	
資産合計		1,926,692,151	
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		59,013,855	
未払解約金		7,845,291	
未払利息		267	
流動負債合計		66,859,413	
負債合計		66,859,413	
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,819,632,146	
剰余金			
剰余金又は欠損金()		40,200,592	
元本等合計		1,859,832,738	
純資産合計		1,859,832,738	

負債純資産合計

1,926,692,151

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年 3月10日 至 2021年 1月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式および投資証券 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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)国債証券 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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 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、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 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、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 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 外貨建取引については、「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）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。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)

区 分	[2021年 1月18日現在]
1. 1 本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	1,573,360,565円
同期中における追加設定元本額	278,706,948円
同期中における一部解約元本額	32,435,367円
同期末における元本額	1,819,632,146円
元本の内訳*	
東京海上キャリアターゲット3 <適格機関投資家限定>	1,564,128,680円
東京海上キャリアターゲット(4%コース向け) (FoFs用) <適格機関投資家限定>	255,503,466円
計	1,819,632,146円

2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,819,632,146口
--	----------------

(注)*は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

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2020年 3月10日 至 2021年 1月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引及び為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2021年 1月18日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)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)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、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。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、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。

(有価証券に関する注記)

(自 2020年3月10日 至 2021年1月18日)

売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	5,318,691円
国債証券	4,312,558円
投資証券	561,313円
合計	444,820円

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年1月17日から2021年1月18日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(1) 株式関連

(2021年1月18日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	218,556,260		224,123,765	5,567,505
	S&P/TSE60 IX	50,177,656		51,792,291	1,614,635
	FTSE 100 IDX	55,739,262		56,542,848	803,586
	SWISS MKT IX	59,620,288		62,753,600	3,133,312
	SPI 200 FUT	53,019,054		53,035,026	15,972
	売建	202,644,968		210,094,914	7,449,946
	日経平均株価指数先物	54,800,000		56,380,000	1,580,000
	DAX INDX FUT	41,798,158		43,177,118	1,378,960
	OMX30 IND FU	53,073,962		53,112,774	38,812
	HANG SENG ID	52,972,848		57,425,022	4,452,174
合 計	421,201,228		434,218,679	1,882,441	

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2) 債券関連

(2021年1月18日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	950,456,923		946,111,538	4,345,385
	US 10YR NOTE	357,940,955		355,252,732	2,688,223
	CAN 10YR BND	229,847,103		228,570,722	1,276,381
	AUST 10YR 6%	362,668,865		362,288,084	380,781
	売建	1,061,234,065		1,060,777,220	456,845
	長期国債標準物先物	608,000,000		606,880,000	1,120,000
	EURO-BUND FU	222,112,848		222,714,576	601,728
	EURO-OAT FUT	231,121,217		231,182,644	61,427
合 計		2,011,690,988		2,006,888,758	3,888,540

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(3) 通貨関連

(2021年1月18日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			1年超		
	為替予約取引				
	買建	399,438,183		397,173,000	2,265,183
	英ポンド	84,240,696		84,582,000	341,304
	スウェーデンクローネ	195,905,892		192,816,000	3,089,892

市場取引 以外の取引	豪ドル	119,291,595		119,775,000	483,405
	売建	1,618,936,227		1,614,358,000	4,578,227
	米ドル	329,554,539		332,192,000	2,637,461
	加ドル	40,548,800		40,670,000	121,200
	ユーロ	646,388,860		639,489,000	6,899,860
	スイスフラン	246,120,630		244,671,000	1,449,630
	ノルウェークローネ	54,653,418		54,495,000	158,418
	豪ドル	294,238,430		295,445,000	1,206,570
	ニュージーランドドル	7,431,550		7,396,000	35,550
	合計	2,018,374,410		2,011,531,000	2,313,044

(注)1.時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買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。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値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。

- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(4) 商品関連

(2021年1月18日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	商品先物取引				
	買建	539,672,253		576,418,210	36,745,957
	CORN FUTURE	205,188,846		226,473,996	21,285,150
	COTTON NO.2	121,407,895		124,010,914	2,603,019
	WHEAT FUTURE	205,151,207		215,126,674	9,975,467
	WTI CRUDE FU	7,924,305		10,806,626	2,882,321
	売建	543,236,997		582,671,113	39,434,116

市場取引	CORN FUTURE	205,720,974		227,644,679	21,923,705
	COTTON NO.2	120,628,133		122,881,764	2,253,631
	WHEAT FUTURE	209,157,747		221,259,134	12,101,387
	WTI CRUDE FU	7,730,143		10,885,536	3,155,393
	合 計	1,082,909,250		1,159,089,323	2,688,158

(注)1.時価の算定方法

商品先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2.商品先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報に関する注記)

[2021年 1月18日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0221円 10,221円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘 柄	株式数	評価額		備 考
		単価	金額	
コムシスホールディングス	900	3,270.00	2,943,000	
大成建設	500	3,560.00	1,780,000	
大林組	2,000	925.00	1,850,000	
清水建設	2,300	765.00	1,759,500	
長谷工コーポレーション	1,500	1,222.00	1,833,000	
鹿島建設	1,300	1,419.00	1,844,700	
大東建託	300	9,230.00	2,769,000	
大和ハウス工業	600	3,055.00	1,833,000	
積水ハウス	800	2,063.00	1,650,400	
協和エクシオ	1,000	2,874.00	2,874,000	
明治ホールディングス	400	7,270.00	2,908,000	
日本たばこ産業	1,400	2,028.50	2,839,900	
帝人	900	1,925.00	1,732,500	

東ソー	1,100	1,731.00	1,904,100	
三井化学	600	2,925.00	1,755,000	
宇部興産	900	1,914.00	1,722,600	
武田薬品工業	800	3,609.00	2,887,200	
アステラス製薬	1,800	1,661.50	2,990,700	
横浜ゴム	1,100	1,578.00	1,735,800	
ブリヂストン	500	3,922.00	1,961,000	
A G C	500	3,740.00	1,870,000	
日本特殊陶業	1,000	1,799.00	1,799,000	
丸一鋼管	800	2,338.00	1,870,400	
アマダ	1,500	1,197.00	1,795,500	
マブチモーター	400	4,125.00	1,650,000	
キヤノン	900	2,182.00	1,963,800	
トヨタ自動車	200	7,636.00	1,527,200	
凸版印刷	1,200	1,487.00	1,784,400	
大日本印刷	900	1,862.00	1,675,800	
中部電力	2,300	1,303.00	2,996,900	
関西電力	3,000	1,029.50	3,088,500	
中国電力	2,400	1,260.00	3,024,000	
東北電力	3,400	891.00	3,029,400	
九州電力	3,300	961.00	3,171,300	
電源開発	1,200	1,675.00	2,010,000	
大阪瓦斯	1,400	2,016.00	2,822,400	
セイノーホールディングス	2,000	1,445.00	2,890,000	
日本電信電話	1,100	2,737.50	3,011,250	
K D D I	900	3,232.00	2,908,800	
ソフトバンク	2,200	1,355.00	2,981,000	
双日	7,600	245.00	1,862,000	
伊藤忠商事	1,000	3,102.00	3,102,000	
三井物産	900	1,978.50	1,780,650	
三菱商事	1,100	2,662.00	2,928,200	
ローソン	600	4,945.00	2,967,000	
エービーシー・マート	500	5,750.00	2,875,000	
ミクシィ	1,100	2,482.00	2,730,200	
H . U . グループホールディングス	1,000	2,962.00	2,962,000	
ユー・エス・エス	1,400	2,102.00	2,942,800	
日本郵政	3,600	855.30	3,079,080	
合 計	70,100	-	118,671,980	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	日本円			日本円		
		第955回国庫短期証券	120,000,000	120,015,720		
	日本円小計		120,000,000	120,015,720		
			銘柄数	1		
			比率	6.5%	9.7%	
	ユーロ				ユーロ	
		FRTR 0 02/25/22		3,900,000	3,907,800.00	
	ユーロ小計		3,900,000	3,907,800.00 (489,881,808)		
			銘柄数	1		
			比率	26.3%	39.7%	
	豪ドル				豪ドル	
		ACGB 0 1/4 11/21/25		3,700,000	3,681,340.90	
豪ドル小計		3,700,000	3,681,340.90 (293,991,884)			
		銘柄数	1			
		比率	15.8%	23.8%		
国債証券合計				円 903,889,412 (783,873,692)		
投資証券	米ドル			米ドル		
		VANGUARD S/T CORP BOND ETF	38,399	3,191,340.89		
	米ドル小計		38,399	3,191,340.89 (331,356,924)		
			銘柄数	1		
		比率	17.8%	26.8%		
投資証券合計				円 331,356,924 (331,356,924)		
合計				円 1,235,246,336 (1,115,230,616)		

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額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

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

(2021年9月30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)【事業の内容及び営業の状況】

「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。

2021年9月30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	1,477,811,772,523
追加型株式投資信託	830	15,745,450,676,086
単位型公社債投資信託	28	60,443,549,223
単位型株式投資信託	218	1,335,153,410,848
合計	1,102	18,618,859,408,680

(3)【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

5【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36期事業年度(自2020年4月1日至2021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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

(3) 【株主資本等変動計算書】

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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		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	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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	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		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	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

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。

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

第36期(自2020年4月1日至2021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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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
2021年6月16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
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17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。

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	-

第36期(2021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	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(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、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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	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	-

第36期(2021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	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

(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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36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。

第36期(2021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	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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)
投資信託	996	-	3

(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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

(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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

(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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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% ~ 3.76%

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103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

(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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
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	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85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	5,149,555千円	5,016,672千円

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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
	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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

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) 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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	15,005,011千円	14,125,803千円
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。

独立監査人の監査報告書

2021年5月26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 丘本 正彦 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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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2021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。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月5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 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員

中間監査意見

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One ターゲットリターン・ファンド(4%コース)の2021年3月26日から2021年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、One ターゲットリターン・ファンド(4%コース)の2021年9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中間計算期間(2021年3月26日から2021年9月25日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、アセットマネジメントOne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、中間監査の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。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の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。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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

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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。