

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年6月15日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	Oneグローバルバランス
【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】	当初自己設定：100万円を上限とします。 継続申込期間：1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年8月31日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について、半期報告書の提出に伴い記載事項の一部に変更が生じるため、流動性リスク管理規制に対応するため、当ファンドが投資する一部のマザーファンドの信託金限度額の引き上げのため、当ファンドが投資する一部のマザーファンドの対象指数の算出要領改定等に伴う所要の変更を行うため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(2)【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

2021年9月16日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始（予定）

< 訂正後 >

2021年9月16日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（2021年6月30日現在）

(略)

大株主の状況

（2021年6月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

(略)

< 訂正後 >

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円（2022年3月31日現在）

(略)

大株主の状況

（2022年3月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

(略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<訂正前>

(略)

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
	(略)
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式 [*] を主要投資対象とします。

投資態度

1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式^{*}に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。

(略)

5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

*東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄」に変更を行う予定です。

東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値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ことができます。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

(略)

(略)

<訂正後>

(略)

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
	(略)
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1.主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(略)</p> <p>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p><u>東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</u></p> <p><u>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</u></p> <p><u>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</u></p> <p><u>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</u></p> <p><u>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</u></p> <p><u>JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</u></p> <p><u>JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</u></p> <p><u>以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</u></p> </div> <p>(略)</p>
------	--

(略)

(3)【運用体制】

<訂正前>

(略)

運用体制は2021年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

< 訂正後 >

（略）

運用体制は2022年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

3【投資リスク】

< 訂正前 >

（略）

< その他の留意点 >

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

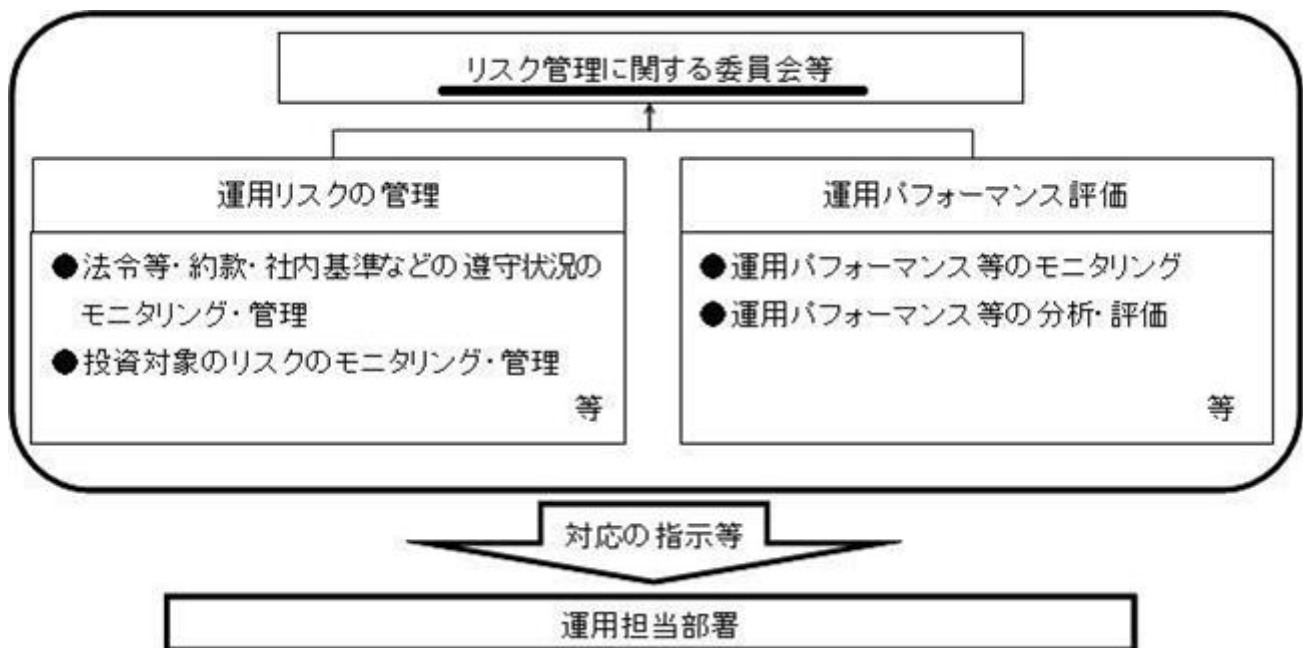
有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

（略）

< リスク管理体制 >

（略）

・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



リスク管理体制は2021年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

（略）

< その他の留意点 >

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

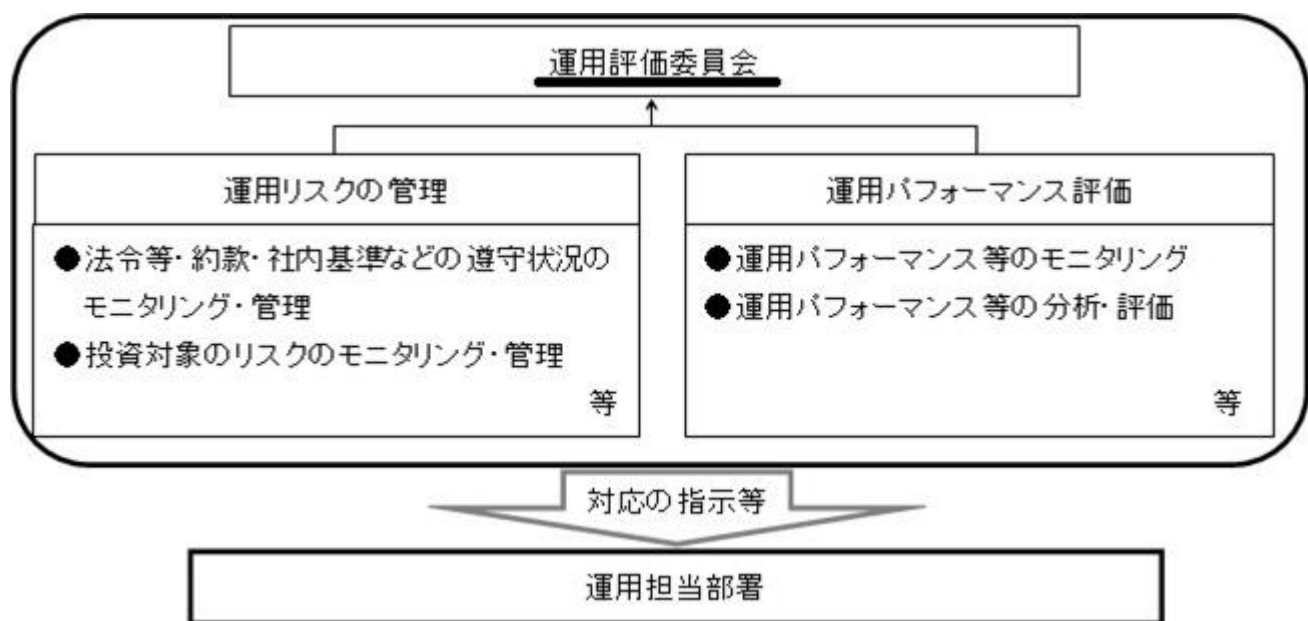
有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

(略)

<リスク管理体制>

(略)

- ・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2022年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

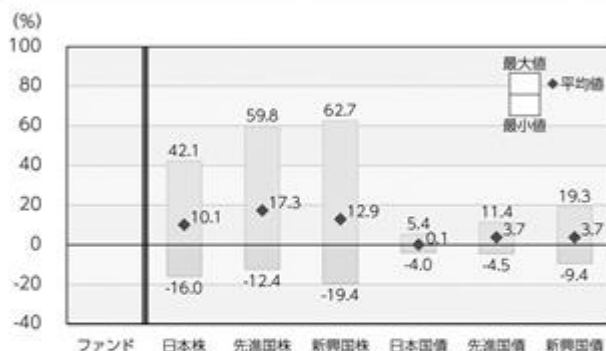
<更新・訂正後>

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2022年3月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2017年4月～2022年3月

*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
*ファンドは2022年3月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPMリサーチまたは株式会社JPMリサーチの関連会社(以下「JPM」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPMが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は、2021年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上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。

(略)

<訂正後>

(略)

上記は、2022年3月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上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。

(略)

5【運用状況】

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

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

2022年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	57,865,287	88.43
内 日本	57,865,287	88.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,572,905	11.57
純資産総額	65,438,192	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	401,814,220,820	96.94
内 日本	401,814,220,820	96.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,698,799,315	3.06
純資産総額	414,513,020,135	100.00

その他資産の投資状況

2022年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	12,691,180,000	3.06
内 日本	12,691,180,000	3.06

（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。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	736,176,961,668	95.56
内 アメリカ	520,707,165,567	67.59
内 イギリス	31,188,169,716	4.05
内 カナダ	29,148,579,424	3.78
内 スイス	24,925,594,327	3.24
内 フランス	22,850,236,612	2.97
内 ドイツ	18,001,504,773	2.34
内 オーストラリア	16,368,075,108	2.12
内 オランダ	13,693,883,045	1.78
内 アイルランド	13,301,664,244	1.73
内 スウェーデン	7,432,672,960	0.96
内 デンマーク	5,874,363,399	0.76

内	スペイン	5,161,513,910	0.67
内	香港	4,699,317,990	0.61
内	イタリア	3,870,632,187	0.50
内	ジャージー	2,847,766,594	0.37
内	フィンランド	2,558,349,631	0.33
内	シンガポール	2,311,616,912	0.30
内	ベルギー	1,826,781,559	0.24
内	ノルウェー	1,721,496,285	0.22
内	ケイマン諸島	1,651,218,339	0.21
内	イスラエル	1,522,995,381	0.20
内	バミューダ	970,697,840	0.13
内	オランダ領キュラソー	804,281,460	0.10
内	ルクセンブルグ	665,748,909	0.09
内	ニュージーランド	591,421,281	0.08
内	オーストリア	461,214,451	0.06
内	ポルトガル	366,026,510	0.05
内	リベリア	264,456,410	0.03
内	パナマ	223,692,203	0.03
内	マン島	165,824,641	0.02
投資信託受益証券		1,385,208,994	0.18
内	オーストラリア	1,044,038,369	0.14
内	シンガポール	341,170,625	0.04
投資証券		16,738,988,895	2.17
内	アメリカ	15,608,134,413	2.03
内	イギリス	475,124,711	0.06
内	フランス	317,195,899	0.04
内	香港	255,852,451	0.03
内	カナダ	82,681,421	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		16,104,402,733	2.09
純資産総額		770,405,562,290	100.00

その他資産の投資状況

2022年3月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
株価指数先物取引(買建)	16,269,567,659	2.11	
内			
内	アメリカ	12,234,471,570	1.59
内	ドイツ	2,318,236,519	0.30
内	イギリス	713,504,514	0.09
内	カナダ	624,664,656	0.08
内	オーストラリア	378,690,400	0.05

(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。

(注3) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
国債証券	419,681,158,950	82.39	
内			
内	日本	419,681,158,950	82.39

地方債証券		31,085,968,344	6.10
	内 日本	31,085,968,344	6.10
特殊債券		28,398,106,994	5.57
	内 日本	28,398,106,994	5.57
社債券		27,983,985,670	5.49
	内 日本	27,186,171,670	5.34
	内 フランス	797,814,000	0.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,259,875,824	0.44
純資産総額		509,409,095,782	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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	169,655,572,148	98.33
内 アメリカ	81,871,000,318	47.45
内 フランス	16,561,970,953	9.60
内 イタリア	14,812,196,033	8.59
内 ドイツ	12,098,517,425	7.01
内 スペイン	9,588,022,468	5.56
内 イギリス	9,107,061,292	5.28
内 ベルギー	3,703,812,762	2.15
内 カナダ	3,420,991,827	1.98
内 オランダ	3,112,482,967	1.80
内 オーストラリア	2,733,273,524	1.58
内 オーストリア	2,344,581,819	1.36
内 中国	1,937,941,583	1.12
内 アイルランド	1,319,818,217	0.76
内 メキシコ	1,289,199,189	0.75
内 フィンランド	1,003,080,255	0.58
内 マレーシア	922,931,607	0.53
内 イスラエル	752,230,135	0.44
内 ポーランド	742,682,949	0.43
内 デンマーク	720,135,006	0.42
内 シンガポール	712,823,514	0.41
内 スウェーデン	471,356,633	0.27
内 ノルウェー	429,461,672	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,875,849,935	1.67
純資産総額	172,531,422,083	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2022年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
----	-----------------	----	----	---------------------	---------------------	------------------	-----------------

1	国内債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	16,966,843	1.2986 22,033,836	1.2864 21,826,146	- -	33.35
2	外国債券パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,942,499	2.0529 16,305,528	2.0713 16,451,298	- -	25.14
3	外国株式パッシブ・ファンド マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,609,886	5.8228 9,374,110	6.2337 10,035,546	- -	15.34
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法) マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,929,254	3.2717 9,583,788	3.2610 9,552,297	- -	14.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年3月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	88.43
合計	88.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2022年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	7,655,900	2,243.53 17,176,269,669	2,222.50 17,015,237,750	- -	4.10
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	946,800	12,701.60 12,025,882,443	12,730.00 12,052,764,000	- -	2.91
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	136,900	58,425.69 7,998,477,761	57,250.00 7,837,525,000	- -	1.89
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,343,800	754.04 7,045,621,061	760.30 7,104,091,140	- -	1.71
5	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	95,900	56,646.49 5,432,399,333	63,250.00 6,065,675,000	- -	1.46
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス 業	1,113,500	5,639.09 6,279,136,759	5,414.00 6,028,489,000	- -	1.45
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	1,550,700	3,396.44 5,266,870,832	3,545.00 5,497,231,500	- -	1.33

8	任天堂 日本	株式 その他製品	85,300	59,399.14 5,066,746,709	61,670.00 5,260,451,000	- -	1.27
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,114,900	4,094.22 4,564,651,402	4,601.00 5,129,654,900	- -	1.24
10	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	888,900	5,347.55 4,753,437,905	5,559.00 4,941,395,100	- -	1.19
11	信越化学工業 日本	株式 化学	254,200	18,932.42 4,812,621,386	18,790.00 4,776,418,000	- -	1.15
12	日立製作所 日本	株式 電気機器	726,700	5,937.52 4,314,801,204	6,165.00 4,480,105,500	- -	1.08
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,080,800	3,825.58 4,134,687,572	4,005.00 4,328,604,000	- -	1.04
14	ダイキン工業 日本	株式 機械	192,500	22,549.73 4,340,823,220	22,410.00 4,313,925,000	- -	1.04
15	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,040,700	3,813.25 3,968,453,185	4,144.00 4,312,660,800	- -	1.04
16	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,187,400	3,484.27 4,137,231,742	3,498.00 4,153,525,200	- -	1.00
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,189,400	3,426.16 4,075,083,228	3,487.00 4,147,437,800	- -	1.00
18	HOYA 日本	株式 精密機器	294,900	15,204.75 4,483,883,475	14,030.00 4,137,447,000	- -	1.00
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,031,200	4,312.77 4,447,335,960	3,907.00 4,028,898,400	- -	0.97
20	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	170,700	21,623.87 3,691,194,814	23,510.00 4,013,157,000	- -	0.97
21	三井物産 日本	株式 卸売業	1,155,400	3,048.12 3,521,804,558	3,328.00 3,845,171,200	- -	0.93
22	日本電産 日本	株式 電気機器	391,600	9,963.39 3,901,665,385	9,748.00 3,817,316,800	- -	0.92
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	443,700	8,242.00 3,656,978,802	8,117.00 3,601,512,900	- -	0.87
24	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	490,800	7,169.41 3,518,747,220	7,128.00 3,498,422,400	- -	0.84
25	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	582,100	5,738.21 3,340,213,021	5,813.00 3,383,747,300	- -	0.82
26	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,245,300	1,459.28 3,276,535,146	1,428.00 3,206,288,400	- -	0.77
27	第一三共 日本	株式 医薬品	1,187,100	2,396.64 2,845,058,526	2,680.00 3,181,428,000	- -	0.77
28	SMC 日本	株式 機械	44,200	65,133.76 2,878,912,372	68,840.00 3,042,728,000	- -	0.73

29	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式	1,905,600	1,625.53	1,567.00	-	0.72
			銀行業		3,097,613,626	2,986,075,200	-	
30	ファナック	日本	株式	132,600	22,220.97	21,645.00	-	0.69
			電気機器		2,946,501,678	2,870,127,000	-	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年3月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.94
合計	96.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年3月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.53
輸送用機器		8.11
情報・通信業		7.99
化学		6.25
卸売業		5.92
サービス業		5.71
機械		5.18
銀行業		5.14
医薬品		4.76
小売業		4.10
食料品		3.15
陸運業		2.98
精密機器		2.45
その他製品		2.35
保険業		2.17
建設業		2.14
不動産業		1.90
その他金融業		1.11
電気・ガス業		1.09
鉄鋼		0.82
非鉄金属		0.79
証券、商品先物取引業		0.74
ガラス・土石製品		0.71
ゴム製品		0.64
海運業		0.62
金属製品		0.55
石油・石炭製品		0.43
繊維製品		0.43
空運業		0.41
鉱業		0.30
パルプ・紙		0.20
倉庫・運輸関連業		0.18
水産・農林業		0.09

合計	96.94
----	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,802,987	20,623.10 37,183,197,407	21,757.27 39,228,075,506	- -	5.09
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	783,973	36,148.70 28,339,610,323	38,413.32 30,115,009,953	- -	3.91
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	50,168	380,741.62 19,101,045,742	407,071.58 20,421,967,416	- -	2.65
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	93,830	107,903.15 10,124,553,065	133,893.43 12,563,221,109	- -	1.63
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	33,047	331,872.08 10,967,376,680	347,437.06 11,481,752,531	- -	1.49
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	31,433	331,469.74 10,419,088,410	349,165.20 10,975,309,954	- -	1.42
7	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	274,822	29,851.96 8,203,977,698	33,889.79 9,313,660,142	- -	1.21
8	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	260,172	26,507.39 6,896,481,458	27,886.56 7,255,302,478	- -	0.94

9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロ バイ ダー/ヘル スケア ア・サー ビス	103,449	58,379.47 6,039,298,174	63,743.15 6,594,166,138	- -	0.86
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	289,073	20,349.85 5,882,592,870	21,980.02 6,353,830,350	- -	0.82
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	143,396	38,826.12 5,567,511,248	43,767.88 6,276,140,053	- -	0.81
12	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	324,495	18,443.21 5,984,732,352	17,200.69 5,581,538,096	- -	0.72
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	183,537	27,389.72 5,027,028,267	27,409.24 5,030,609,773	- -	0.65
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	265,522	19,104.87 5,072,765,702	18,895.79 5,017,248,509	- -	0.65
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	308,983	15,594.88 4,818,553,682	15,981.67 4,938,065,330	- -	0.64
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	465,217	9,703.57 4,514,266,271	10,253.83 4,770,257,985	- -	0.62
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	114,752	42,565.94 4,884,527,139	37,752.41 4,332,165,630	- -	0.56
18	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	211,722	17,084.65 3,617,197,263	20,253.09 4,288,026,245	- -	0.56
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	96,432	45,317.36 4,370,043,765	44,334.55 4,275,269,672	- -	0.55
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	808,465	5,730.50 4,632,909,380	5,262.76 4,254,765,348	- -	0.55
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	617,383	6,106.14 3,769,827,515	6,418.13 3,962,445,341	- -	0.51
22	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノー ジー	194,212	17,691.95 3,435,989,609	20,041.36 3,892,273,093	- -	0.51
23	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	45,470	77,301.03 3,514,878,145	85,054.73 3,867,439,027	- -	0.50

24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	76,859	45,696.22 3,512,165,873	49,145.83 3,777,299,501	- -	0.49
25	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	45,194	70,989.68 3,208,307,777	77,239.10 3,490,744,115	- -	0.45
26	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	199,836	18,300.69 3,657,138,451	17,252.09 3,447,589,536	- -	0.45
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	450,836	7,432.55 3,350,864,975	7,613.88 3,432,612,060	- -	0.45
28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生 活必需品 小売り	48,526	62,584.47 3,036,974,222	70,554.16 3,423,711,328	- -	0.44
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	463,112	6,540.92 3,029,182,145	6,859.95 3,176,929,563	- -	0.41
30	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	89,434	29,337.61 2,623,779,968	35,479.63 3,173,085,864	- -	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	95.56
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.17
合計	97.91

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年3月31日現在

業種	国内/外国	投資比率 (%)
ソフトウェア	外国	7.25
銀行		5.85
コンピュータ・周辺機器		5.35
半導体・半導体製造装置		4.95
医薬品		4.90
石油・ガス・消耗燃料		4.17
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.15
情報技術サービス		3.78
資本市場		3.21
保険		3.06
インターネット販売・通信販売		3.03
ヘルスケア機器・用品		2.41
自動車		2.27
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.17
化学		2.00
電力		1.73
ホテル・レストラン・レジャー		1.73
バイオテクノロジー		1.73

金属・鉱業	1.72
飲料	1.61
機械	1.59
食品	1.53
食品・生活必需品小売り	1.50
専門小売り	1.48
航空宇宙・防衛	1.47
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.45
繊維・アパレル・贅沢品	1.34
各種電気通信サービス	1.21
娯楽	1.18
陸運・鉄道	1.15
各種金融サービス	1.06
家庭用品	1.06
コングロマリット	0.98
メディア	0.91
総合公益事業	0.87
電気設備	0.80
通信機器	0.68
専門サービス	0.68
タバコ	0.64
航空貨物・物流サービス	0.60
電子装置・機器・部品	0.54
建設関連製品	0.53
パーソナル用品	0.52
複合小売り	0.48
消費者金融	0.46
商業サービス・用品	0.43
不動産管理・開発	0.38
商社・流通業	0.34
家庭用耐久財	0.28
無線通信サービス	0.27
容器・包装	0.26
エネルギー設備・サービス	0.23
建設資材	0.23
建設・土木	0.21
自動車部品	0.19
ガス	0.13
運送インフラ	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
水道	0.11
紙製品・林産品	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
販売	0.09
海運業	0.08
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	95.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	137回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,700,000,000	100.25 5,714,250,000	100.23 5,713,395,000	0.1 2023/9/20	1.12
2	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,400,000,000	100.35 5,418,954,000	100.41 5,422,572,000	0.1 2025/6/20	1.06
3	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,280,000,000	101.17 5,342,132,000	101.11 5,339,083,200	0.6 2023/12/20	1.05
4	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,110,000,000	100.21 5,120,731,000	100.20 5,120,628,800	0.1 2028/3/20	1.01
5	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,050,000,000	101.16 5,108,580,000	101.06 5,103,580,500	0.8 2023/6/20	1.00
6	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.27 5,013,800,000	100.25 5,012,900,000	0.1 2023/12/20	0.98
7	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,750,000,000	100.37 4,767,743,000	100.40 4,769,000,000	0.1 2026/6/20	0.94
8	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,410,000,000	101.35 4,469,604,000	101.38 4,471,078,500	0.4 2025/6/20	0.88
9	141回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,410,000,000	100.31 4,423,795,100	100.33 4,424,685,300	0.1 2024/9/20	0.87
10	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,390,000,000	100.34 4,405,016,000	100.35 4,405,496,700	0.1 2026/12/20	0.86
11	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,330,000,000	101.26 4,384,558,000	101.29 4,385,943,600	0.4 2025/3/20	0.86
12	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,340,000,000	100.16 4,346,944,000	100.09 4,344,166,400	0.1 2028/9/20	0.85
13	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,290,000,000	100.34 4,304,586,000	100.37 4,306,259,100	0.1 2026/9/20	0.85
14	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,240,000,000	100.34 4,254,416,000	100.34 4,254,712,800	0.1 2027/3/20	0.84
15	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	99.42 4,076,553,000	99.35 4,073,555,000	0.1 2030/12/20	0.80

16	139回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,050,000,000	100.29 4,061,838,000	100.27 4,061,137,500	0.1 2024/3/20	0.80
17	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,910,000,000	101.42 3,965,522,000	101.45 3,967,007,800	0.4 2025/9/20	0.78
18	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,960,000,000	99.68 3,947,546,000	99.55 3,942,298,800	0.1 2030/6/20	0.77
19	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,940,000,000	99.57 3,923,058,000	99.45 3,918,566,400	0.1 2030/9/20	0.77
20	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,860,000,000	101.36 3,912,526,400	101.26 3,908,867,600	0.8 2023/9/20	0.77
21	147回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,900,000,000	99.99 3,899,610,000	100.03 3,901,521,000	0.005 2026/3/20	0.77
22	148回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,900,000,000	99.98 3,899,411,000	100.00 3,900,000,000	0.005 2026/6/20	0.77
23	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,910,000,000	99.22 3,879,634,700	98.95 3,869,023,200	0.1 2031/12/20	0.76
24	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,830,000,000	100.29 3,841,149,000	100.31 3,841,949,600	0.1 2027/6/20	0.75
25	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.46 3,817,840,000	100.42 3,816,264,000	0.1 2025/12/20	0.75
26	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,810,000,000	100.12 3,814,795,000	99.89 3,805,885,200	0.1 2029/6/20	0.75
27	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	99.49 3,780,757,000	99.13 3,767,282,000	0.1 2031/6/20	0.74
28	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,750,000,000	100.39 3,764,625,000	100.41 3,765,600,000	0.1 2025/9/20	0.74
29	143回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.34 3,712,845,000	100.40 3,714,800,000	0.1 2025/3/20	0.73
30	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,690,000,000	100.27 3,699,963,000	100.30 3,701,070,000	0.1 2027/9/20	0.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年3月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	82.39
地方債証券	6.10

特殊債券	5.57
社債券	5.49
合計	99.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証 券	1,056,225,700	94.47 997,829,042	90.67 957,782,155	1.25 2031/8/15	0.56
2	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	996,254,600	97.78 974,164,173	94.01 936,634,988	1.625 2031/5/15	0.54
3	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	949,746,400	93.65 889,474,695	90.27 857,368,715	1.125 2031/2/15	0.50
4	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	925,268,400	90.30 835,579,278	86.88 803,899,201	0.625 2030/8/15	0.47
5	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	778,400,400	102.26 796,059,506	100.83 784,907,336	2.75 2023/11/15	0.45
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	855,506,100	95.97 821,050,407	91.51 782,921,753	1.375 2031/11/15	0.45
7	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	738,011,700	102.49 756,409,870	100.77 743,719,754	2.75 2024/2/15	0.43
8	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証 券	766,161,400	97.56 747,469,125	96.21 737,131,061	0.125 2024/1/15	0.43
9	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証 券	726,996,600	98.82 718,438,437	95.67 695,588,069	1.5 2027/1/31	0.40
10	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	667,025,500	101.77 678,880,524	98.85 659,365,124	2.25 2025/11/15	0.38
11	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	641,323,600	105.95 679,490,550	102.26 655,878,636	2.875 2028/5/15	0.38
12	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	659,682,100	101.72 671,079,818	99.35 655,404,469	2.25 2024/11/15	0.38
13	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	734,340,000	91.62 672,810,333	88.51 650,005,639	0.875 2030/11/15	0.38
14	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証 券	674,368,900	97.47 657,372,042	96.05 647,736,593	0.25 2024/3/15	0.38
15	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証 券	673,145,000	97.64 657,261,933	96.05 646,587,322	0.375 2024/4/15	0.37
16	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	624,189,000	102.14 637,557,438	100.21 625,554,413	2.5 2024/5/15	0.36
17	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証 券	700,070,800	91.89 643,326,454	86.97 608,897,510	1.875 2051/2/15	0.35
18	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証 券	616,845,600	101.00 623,014,412	98.53 607,785,680	2 2025/2/15	0.35
19	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	537,231,000	117.25 629,939,177	112.88 606,447,842	2.5 2030/5/25	0.35

20	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	619,293,400	102.89 637,208,164	97.43 603,424,006	2.375 2051/5/15	0.35
21	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	591,143,700	104.90 620,165,677	101.13 597,840,244	2.625 2029/2/15	0.35
22	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	592,367,600	101.29 600,018,240	99.58 589,914,823	2.125 2024/3/31	0.34
23	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	589,177,000	103.54 610,051,891	99.96 588,995,533	0.75 2028/5/25	0.34
24	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	583,800,300	100.97 589,501,470	99.14 578,828,872	2 2024/5/31	0.34
25	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	575,233,000	102.64 590,467,682	99.67 573,390,452	2.375 2027/5/15	0.33
26	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	554,426,700	106.13 588,437,052	102.40 567,767,591	2.875 2028/8/15	0.33
27	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証券	587,472,000	97.41 572,278,655	96.01 564,087,858	0.125 2024/2/15	0.33
28	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	647,443,100	90.58 586,491,537	87.03 563,528,400	0.625 2030/5/15	0.33
29	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	564,217,900	101.93 575,130,812	99.78 563,027,749	2.375 2024/8/15	0.33
30	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証券	556,874,500	101.99 567,964,797	100.33 558,723,494	2.5 2024/1/31	0.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年3月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.33
合計	98.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・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】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年3月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0406月	買建	652	12,115,000,160	12,691,180,000	3.06

（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）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Jun22	買建	435	11,447,294,889	12,234,471,570	1.59
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun22	買建	439	2,242,181,081	2,318,236,519	0.30
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun22	買建	59	687,347,017	713,504,514	0.09
	モントルオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun22	買建	24	611,289,753	624,664,656	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun22	買建	22	363,963,500	378,690,400	0.05

（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）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・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】

直近日（2022年3月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
2021年9月末日	6	-	0.9910	-
10月末日	17	-	1.0102	-
11月末日	37	-	0.9959	-
12月末日	48	-	1.0154	-
2022年1月末日	55	-	0.9747	-
2月末日	60	-	0.9689	-

3月末日	65	-	0.9966	-
------	----	---	--------	---

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
2021年9月16日～2022年3月15日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
2021年9月16日～2022年3月15日	4.1

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
2021年9月16日～ 2022年3月15日	81,269,438	17,938,179

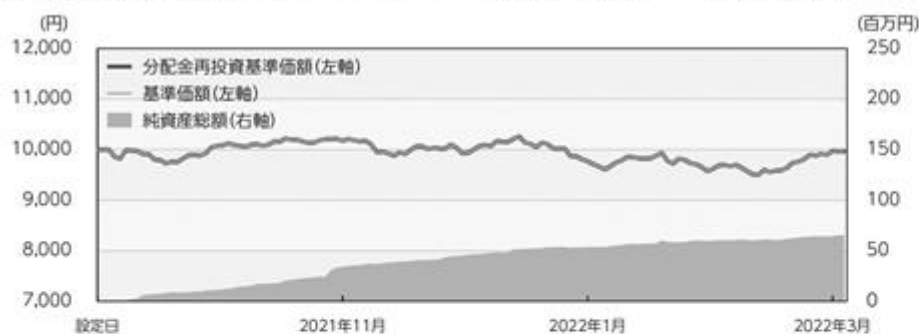
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2022年3月31日

基準価額・純資産の推移 (2021年9月16日～2022年3月31日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2021年9月16日)

分配の推移(税引前)

基準日現在、分配実績
はありません。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	33.35
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.14
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.34
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	14.60

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.10
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.91
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.89
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.71
5	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.46

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.09
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.91
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.65
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.63
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.49

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2022年3月31日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	137回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2023/9/20	1.12
2	144回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/6/20	1.06
3	332回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2023/12/20	1.05
4	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.01
5	329回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2023/6/20	1.00

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.56
2	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.54
3	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.50
4	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.47
5	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.45

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2021年は設定日から年末までの収益率、および2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

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

<更新・訂正後>

- (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1期中間計算期間（2021年9月16日から2022年3月15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。

1【財務諸表】

【Oneグローバルバランス】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		第1期中間計算期間末 2022年3月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		7,327,080
親投資信託受益証券		53,612,865
未収入金		1,000,000
流動資産合計		61,939,945
資産合計		61,939,945
負債の部		
流動負債		
未払解約金		997,058
未払受託者報酬		6,036
未払委託者報酬		202,794
その他未払費用		632
流動負債合計		1,206,520
負債合計		1,206,520
純資産の部		
元本等		
元本		63,331,259
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		2,597,834
(分配準備積立金)		-
元本等合計		60,733,425
純資産合計		60,733,425
負債純資産合計		61,939,945

(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 2021年9月16日 至 2022年3月15日
営業収益	
受取利息	3
有価証券売買等損益	2,622,135
営業収益合計	2,622,132
営業費用	
支払利息	108
受託者報酬	6,036
委託者報酬	202,794
その他費用	632
営業費用合計	209,570
営業利益又は営業損失()	2,831,702
経常利益又は経常損失()	2,831,702
中間純利益又は中間純損失()	2,831,702
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()	178,524
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	138,712
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	138,712
剰余金減少額又は欠損金増加額	83,368
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	83,368
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()	2,597,834

(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1期中間計算期間
	自 2021年9月16日 至 2022年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間末 2022年3月15日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	80,269,438円
期中一部解約元本額	17,938,179円
2. 受益権の総数	63,331,259口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,597,834円であり ます。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(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期中間計算期間末 2022年3月15日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期中間計算期間末 2022年3月15日現在

1口当たり純資産額	0.9590円
(1万口当たり純資産額)	(9,590円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年3月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,772,266,701
株式	302,097,203,660
派生商品評価勘定	239,593,130
未収配当金	718,678,817
差入委託証拠金	327,600,000
流動資産合計	312,155,342,308
資産合計	312,155,342,308
負債の部	
流動負債	
前受金	177,515,000
未払解約金	3,833,156,361
流動負債合計	4,010,671,361
負債合計	4,010,671,361
純資産の部	
元本等	
元本	101,809,149,709
剰余金	
剰余金又は欠損金()	206,335,521,238
元本等合計	308,144,670,947
純資産合計	308,144,670,947
負債純資産合計	312,155,342,308

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年9月16日 至 2022年3月15日
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、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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年3月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	127,470,731,813円
同期中追加設定元本額	99,325,897,525円
同期中一部解約元本額	124,987,479,629円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,701,433,639円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,022,979,996円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,661,837,435円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,709,795,206円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,937,232円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	25,929,229円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	103,816,123円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,866,069円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,103,225円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,896,115円
たわらノーロード TOPIX	1,402,548,718円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,077,697,172円
たわらノーロード バランス(堅実型)	43,960,457円
たわらノーロード バランス(標準型)	278,352,474円
たわらノーロード バランス(積極型)	426,185,982円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	3,672,658円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	172,732,394円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	434,693,070円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	287,401,810円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	410,886,261円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	726,029円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,009,993円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	40,956,359円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,136,613円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	18,679,521円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,949,777,145円
Oneグローバルバランス	2,987,519円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,081,528,510円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,564,940,172円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,843,170,186円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	352,213,588円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,115,948,962円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,125,077,998円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,620,397円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,059,266,348円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,639,449円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	309,475,685円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	308,861,026円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	546,708,833円
クルーズコントロール	75,393,443円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	338,355,786円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	574,881,243円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	48,598,382円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	23,720,265円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	149,486,605円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	364,608,552円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,031,081,919円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	299,933,872円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	49,990,359円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	21,024,864円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	17,197,777円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	121,090,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,149,487円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	13,248,260円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	13,713,933円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	21,508,092円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	8,254,524円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	12,951,379円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	58,656,822円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	21,400,356円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	84,110,969円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	35,164,588円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	24,440,349円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	11,831,677円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	24,579,073円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)	35,343,107円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	34,428,091円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	106,256,286円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	22,429,851円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	51,639,178円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	99,402,852円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,829,909円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,669,183円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,571,449円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,238,584円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,945,752円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,835,108円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	543,418,231円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	621,758,823円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,778,569,586円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	29,629,553円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	28,589,501円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	292,643,513円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	72,589,955円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,397,771円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	344,067,669円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,169,520円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	72,434,630円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	169,038,094円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	227,074,747円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	37,090,194円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,604,229円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	4,222,215円
コア資産形成ファンド	3,090,715円
MHAMトピックスファンド	704,241,193円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	64,968,914円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	594,499,033円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,016,054,461円
計	101,809,149,709円
2. 受益権の総数	101,809,149,709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	2022年3月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (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)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2022年3月15日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	5,886,025,000	-	6,125,730,000	239,705,000	
合計	5,886,025,000	-	6,125,730,000	239,705,000	

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年3月15日現在
1口当たり純資産額	3.0267円
(1万口当たり純資産額)	(30,267円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年3月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	8,525,072,602
コール・ローン	449,008,488
株式	595,417,947,464
投資信託受益証券	1,105,854,734
投資証券	13,874,656,729
派生商品評価勘定	4,501,449
未収入金	1,251,128
未収配当金	1,055,039,111
差入委託証拠金	3,780,109,684
流動資産合計	624,213,441,389
資産合計	
624,213,441,389	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	87,541,842
未払金	28,353,861
未払解約金	2,402,950,333
流動負債合計	2,518,846,036
負債合計	
2,518,846,036	
純資産の部	
元本等	
元本	113,496,479,072
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	508,198,116,281
元本等合計	621,694,595,353
純資産合計	
621,694,595,353	
負債純資産合計	
624,213,441,389	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年9月16日 至 2022年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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>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>投資証券</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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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金融商品取引所等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>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
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>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年3月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	117,772,327,909円
同期中追加設定元本額	53,845,258,596円
同期中一部解約元本額	58,121,107,433円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,392,102,246円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,190,189円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	14,023,363円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	71,797,897円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	19,774,288円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	11,721,611円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,183,927円
たわらノーロード 先進国株式	30,043,497,647円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	387,785,578円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,814,822,371円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	604,832,032円
たわらノーロード バランス(堅実型)	70,183,214円
たわらノーロード バランス(標準型)	577,517,679円
たわらノーロード バランス(積極型)	708,913,564円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	978,767円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	148,165,312円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	443,096,872円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	332,969,037円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	492,920,800円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,250,350円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	19,867,010円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,402,142円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,722,665円
たわらノーロード 全世界株式	248,921,984円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,254,502,500円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,270,118,988円
Oneグローバルバランス	1,659,532円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	157,200,792円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	786,561,941円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,008,795,887円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	96,417,503円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	265,893,447円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	249,398,623円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,707,695円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	688,599,498円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	134,292,551円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,377,618円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	172,035,194円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	307,636,538円
クルーズコントロール	20,585,230円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	189,274,749円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	149,631,213円
ワールドアセットバランス(基本コース)	203,026,933円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	217,571,884円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	27,383,489円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	13,516,135円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	48,523,178円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	99,222,483円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	257,848,173円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	167,630,795円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	25,532,209円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,851,451円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,748,372円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	32,891,548円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	652,547円

インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	126,295円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	83,555円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	3,567,658円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	13,744円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	111,606円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	557,287円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	43,260,162円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	75,883円
M S C I コクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	991,951,278円
D I A M 外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	63,323,188円
D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,191,252,492円
D I A M 先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,189,466,106円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,082,440,550円
D I A M ワールドバランス25V A (適格機関投資家限定)	8,157,951円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	206,917円
D I A M グローバル・バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	28,742,911円
D I A M グローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	55,177,897円
D I A M 国際分散バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	2,677,704円
D I A M 国際分散バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	22,184,162円
D I A M 国内重視バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,543,805円
D I A M 国内重視バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	457,827円
D I A M 世界バランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	3,850,869円
D I A M 世界バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	25,666,490円
D I A M バランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	200,908,690円
D I A M バランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	301,627,474円
D I A M バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	986,325,767円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	82,243,676円
D I A M グローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	47,629,463円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	324,935,091円
D I A M 世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	13,409,591円
D I A M 世界バランスファンド55V A (適格機関投資家限定)	3,498,399円
D I A M 世界アセットバランスファンド2V A (適格機関投資家限定)	127,095,981円
D I A M 世界アセットバランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	11,183,083円
D I A M 世界アセットバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	40,165,776円
D I A M 世界アセットバランスファンド3V A (適格機関投資家限定)	62,470,966円
D I A M 世界アセットバランスファンド4V A (適格機関投資家限定)	125,903,706円
動的パッケージファンド<DC年金>	2,291,242円
コア資産形成ファンド	1,556,574円

MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,684,766,401円
MHAM外国株式インデックスファンド	134,776,907円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	17,985,509円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	307,566,487円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,809,511,264円
計	113,496,479,072円
2. 受益権の総数	113,496,479,072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	2022年3月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (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)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年3月15日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	2,101,379,066	-	2,111,458,354	10,079,288
イギリス・ポンド	1,505,280,000	-	1,513,566,720	8,286,720
オーストラリア・ドル	191,118,956	-	191,729,246	610,290
カナダ・ドル	94,109,400	-	93,510,670	598,730
ユーロ	73,828,800	-	73,758,720	70,080
ユーロ	237,041,910	-	238,892,998	1,851,088
買建	1,248,944,814	-	1,248,939,325	5,489
アメリカ・ドル	867,909,654	-	867,905,357	4,297
イギリス・ポンド	76,940,000	-	76,937,900	2,100
オーストラリア・ドル	42,505,000	-	42,504,850	150
カナダ・ドル	46,100,000	-	46,099,200	800

スイス・フラン	14,598,991	-	14,599,177	186
スウェーデン・クローナ	6,941,186	-	6,941,186	-
デンマーク・クローネ	6,751,293	-	6,751,409	116
ニュージーランド・ドル	4,105,903	-	4,105,769	134
ユーロ	168,324,000	-	168,325,690	1,690
香港・ドル	14,768,787	-	14,768,787	-
合計	3,350,323,880	-	3,360,397,679	10,084,777

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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。

計算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。

計算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。

・計算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先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算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. 計算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、計算日の対顧客電信売買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。

株式関連

種類	2022年3月15日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	12,386,987,181	-	12,314,031,565	72,955,616
合計	12,386,987,181	-	12,314,031,565	72,955,616

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 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で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年3月15日現在	
1口当たり純資産額	5.4777円
(1万口当たり純資産額)	(54,777円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年3月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	702,973,514
国債証券	541,394,787,550
地方債証券	31,612,936,010
特殊債証券	28,954,235,014
社債証券	27,991,832,940
未収利息	968,125,299
前払費用	446,635,271
流動資産合計	632,071,525,598
資産合計	
632,071,525,598	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	219,655,000
流動負債合計	219,655,000
負債合計	
219,655,000	
純資産の部	
元本等	
元本	491,046,662,100
剰余金	
剰余金又は欠損金()	140,805,208,498
元本等合計	631,851,870,598
純資産合計	
631,851,870,598	
負債純資産合計	
632,071,525,598	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年9月16日 至 2022年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年3月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	355,207,705,009円
同期中追加設定元本額	440,574,768,721円
同期中一部解約元本額	304,735,811,630円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,792,019,945円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	143,425,444円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	164,241,947円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	154,873,088円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	677,658,541円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	133,587,952円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,730,893円
たわらノーロード 国内債券	15,988,353,256円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,552,467,591円
たわらノーロード バランス(堅実型)	902,019,625円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,516,957,007円
たわらノーロード バランス(積極型)	191,731,421円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	76,409,454円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	1,325,922,692円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,241,726,198円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	329,780,421円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	22,630,274円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	17,471,029円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	13,703,147円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	96,153,016円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,068,612円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	414,272円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,325,348,759円
Oneグローバルバランス	15,720,655円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,958,556,032円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,434,892,149円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,127,526,957円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,175,494,809円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,309,026,565円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	379,412,933円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	88,556,920円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,051,936,044円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,779,946円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,293,291,570円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,565,379,262円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	334,943,847円
投資のソムリエ	113,872,003,623円
クルーズコントロール	190,098,026円
投資のソムリエ<DC年金>	6,907,317,982円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,613,076,680円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	745,980,176円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	7,329,653,103円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	49,544,420,741円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	36,447,114円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	17,999,544円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	60,194,739円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	230,936,137円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,246,541,303円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,091,593,418円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,383,988,624円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	37,377,953円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	15,418,280円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	12,542,617円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	342,653,511円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	842,853円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,720,991,521円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,763,697,731円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,483,958,950円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,076,609,217円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,701,559,597円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	3,667,013,694円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,873,334,713円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,535,191,373円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,901,022,242円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,198,874,241円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,821,833,234円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(債券動的アロケーション型)(適格機関投資家限定)	377,024,471円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	274,994,337円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,696,248,214円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,703,682,008円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,675,072,205円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	2,924,196,087円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	78,653,589円

AMOne コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	408,623,911円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	151,596,362円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	96,867,174円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	27,330,786円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	96,993,214円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	33,779,792円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,009,669円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	25,393,906円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	112,694,944円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,515,271,166円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,261,355,196円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,313,700,340円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	108,021,982円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	174,470,792円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,132,045,430円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	175,964,631円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,222,155円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	2,231,750,606円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	48,967,009円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	352,705,913円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	546,319,820円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	917,645,427円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	295,478,300円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	99,598,945円
One コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	844,957,312円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	841,347,658円
動的パッケージファンド<DC年金>	435,661,322円
コア資産形成ファンド	298,616,235円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	42,369,614,156円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	60,173,544,177円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	14,253,722,777円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	2,083,684,862円
計	491,046,662,100円
2. 受益権の総数	491,046,662,100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	2022年3月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</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。</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。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>

(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)

	2022年3月15日現在
1口当たり純資産額	1,2867円
(1万口当たり純資産額)	(12,867円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年3月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	831,620,123
コール・ローン	187,301,922
国債証券	165,382,178,206
未収利息	810,437,973
前払費用	169,872,373
流動資産合計	167,381,410,597
資産合計	167,381,410,597
負債の部	
流動負債	
未払解約金	113,135,000
流動負債合計	113,135,000
負債合計	113,135,000
純資産の部	
元本等	
元本	83,356,795,054
剰余金	
剰余金又は欠損金()	83,911,480,543
元本等合計	167,268,275,597
純資産合計	167,268,275,597
負債純資産合計	167,381,410,597

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年9月16日 至 2022年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. 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 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「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条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年3月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	71,978,913,518円
同期中追加設定元本額	23,056,406,394円
同期中一部解約元本額	11,678,524,858円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,979,652,708円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	12,318,303円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	41,415,636円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	145,582,339円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	57,934,032円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	34,587,798円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	22,681,845円
たわらノーロード 先進国債券	13,449,116,201円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,080,933円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,697,389,145円
たわらノーロード バランス（堅実型）	49,266,138円
たわらノーロード バランス（標準型）	237,677,975円
たわらノーロード バランス（積極型）	48,939,973円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	6,661,918円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	328,236,239円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	386,186,943円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	74,576,325円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	375,703円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,121,688円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	27,842,225円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,166,144円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,045,520円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,300,703,491円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	581,487,163円
O n eグローバルバランス	7,600,717円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	711,700,267円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	2,226,508,317円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,403,942,419円

DIAM DC バランス30インデックスファンド	402,785,778円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	838,867,705円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	687,556,756円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,028,565円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	469,729,710円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,893,951円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	142,143,683円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	125,371,251円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	214,713,670円
クルーズコントロール	179,829,630円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	347,129,725円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	414,531,330円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,479,592円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	89,285,132円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	515,001円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	358,315円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	100,794,148円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	418,167円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	546,045円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	3,468,868円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	244,285,953円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	294,771円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,739,805,045円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,636,182,524円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,562,642,072円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,405,248,281円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,361,877円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	645,235円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	386,941,048円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	247,732,311円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	17,550,169円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	41,513,289円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,673,969円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	643,406円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	16,231,422円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	48,003,763円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,974,602,616円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,573,006,397円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,768,385,387円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	115,126,259円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	156,204,377円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	1,829,583,388円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	413,368,583円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	3,267,469円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	356,791,931円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	350,790,421円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	471,331,016円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	57,564,637円
動的パッケージファンド< D C年金>	48,940,507円
コア資産形成ファンド	32,935,531円
M H A M外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	2,642,832,222円
M H A M外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	250,786,269円
M H A M動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	6,649,531,929円
M H A M外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,589,599,035円
計	83,356,795,054円
2. 受益権の総数	83,356,795,054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	2022年3月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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)

	2022年3月15日現在
1口当たり純資産額	2.0067円
(1万口当たり純資産額)	(20,067円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年3月31日現在

資産総額	65,941,634円
負債総額	503,442円
純資産総額（ - ）	65,438,192円
発行済数量	65,661,974口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9966円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	415,270,981,593円
負債総額	757,961,458円
純資産総額（ - ）	414,513,020,135円
発行済数量	127,112,336,018口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2610円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	771,026,182,732円
負債総額	620,620,442円
純資産総額（ - ）	770,405,562,290円
発行済数量	123,586,748,009口
1口当たり純資産額（ / ）	6.2337円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	513,001,718,451円
負債総額	3,592,622,669円
純資産総額（ - ）	509,409,095,782円
発行済数量	395,992,037,449口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2864円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年3月31日現在

資産総額	172,688,099,541円
負債総額	156,677,458円
純資産総額（ - ）	172,531,422,083円
発行済数量	83,295,453,199口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0713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（2021年6月30日現在）

（略）

(2) 会社の機構（2021年6月30日現在）

（略）

< 訂正後 >

(1) 資本金の額（2022年3月31日現在）

（略）

(2) 会社の機構（2022年3月31日現在）

（略）

2【事業の内容及び営業の概況】

< 訂正前 >

（略）

2021年6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	1,450,767,809,461
追加型株式投資信託	832	15,901,915,328,451
単位型公社債投資信託	29	62,455,496,430
単位型株式投資信託	213	1,310,125,137,088
合計	1,100	18,725,263,771,430

< 訂正後 >

（略）

2022年3月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,478,274,797,635
追加型株式投資信託	812	15,311,739,458,456
単位型公社債投資信託	27	53,798,310,639
単位型株式投資信託	223	1,265,390,314,377
合計	1,088	18,109,202,881,107

3【委託会社等の経理状況】

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

<更新・訂正後>

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、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）、ならびに同規則第38条及び第57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．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万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、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、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間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	1,278,455	1,119,327
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	3,524,781	3,991,834
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	9,482,127	11,153,554
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 其他有価証券」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 其他有価証券(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 其他有価証券(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の主な原因別の内訳

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

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：中間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、平成28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。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</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）に基づく定額法によっております。</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、中間決算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中間会計期間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中間会計期間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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日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. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 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。

会計上の見積りの変更

第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計方針の変更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の適用

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

(中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30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）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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 （百万円）	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	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、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。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

（注）現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「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。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。
これらについては、「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)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開
示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)			
1. 子会社株式 関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。			
2. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上 表に含めておりません。			

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

(2) 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 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 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 76,224百万円

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

(4) 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 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

(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。

(5) 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 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

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

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

(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。

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬（注）	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6.重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

（セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

（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。

（1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

（注）潜在株式調整後1株当たり中間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。

1株当たり中間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37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
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中間純利益金額	8,741百万円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

(注) 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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年4月22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 稲葉 宏和
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グローバルバランスの2021年9月16日から2022年3月15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グローバルバランスの2022年3月15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9月16日から2022年3月15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) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月25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

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、「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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、アセットマネジメントOne株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の経営成績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、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、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。

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。

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、企業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、監査等委員会に対して、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。

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 データは中間監査の対象には含まれておりません。