

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券報告書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2024年9月17日提出
<b>【計算期間】</b>	第5特定期間(自 2023年12月16日 至 2024年6月17日) みらいのサイフ(エントリーコース) みらいのサイフ(ベーシックコース) みらいのサイフ(アドバンスコース)
<b>【ファンド名】</b>	
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 杉原 規之
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	積木 利浩
<b>【連絡場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

## 1 日本を含む世界の様々な資産に分散投資します。

- 各マザーファンドを通じて、主として世界(日本を含む)の株式\*1、債券、金に実質的に投資を行います。

\*1 株式については新興国を含みます。

投資対象とするマザーファンド

ファンド名	マザーファンド
みらいのサイフ(エントリーコース)	ターゲットリスク・バランス・マザーファンドI
みらいのサイフ(ベーシックコース)	ターゲットリスク・バランス・マザーファンドII
みらいのサイフ(アドバンスコース)	ターゲットリスク・バランス・マザーファンドIII

- 運用にあたっては、株価指数先物取引、債券先物取引および上場している投資信託証券(ETF)等を活用します。
- 外貨建ての証拠金については、原則として対円での為替ヘッジを行います。

※金への投資はETFを活用します。

※[ターゲットリスク・バランス・マザーファンドI]および[ターゲットリスク・バランス・マザーファンドII]においては、株価指数先物取引および債券先物取引の買建金額は、信託財産の純資産総額以内\*2を基本とします。

\*2 純資産総額が僅少な場合等には、上記買建金額が信託財産の純資産総額をやむを得ず超える場合があります。

※[ターゲットリスク・バランス・マザーファンドIII]のポートフォリオの構築においては、上記先物取引の買建金額の合計が信託財産の純資産総額の200%程度の範囲内で運用を行います。

## 2 基本配分戦略と機動的配分戦略を活用し、基準価額の大幅な下落を抑えるように努めつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

### 基本配分戦略(月次戦略)

- 統計的手法を活用し、分散効果が最大となることをめざして国・地域別配分比率を調整した株式ポートフォリオおよび債券ポートフォリオをそれぞれ構築します。
- 各ポートフォリオの変動リスクおよび相関を用い、目標リスクに近づくよう各ポートフォリオの配分比率を決定します。そのうえで、株式ポートフォリオの中長期的なリターン傾向を基に、株式ポートフォリオの配分を調整し、最終的な各ポートフォリオの配分比率を決定します。
- 金の配分比率は以下の通りとします。

エントリーコース/ベーシックコース	純資産総額の5%程度
アドバンスコース	純資産総額の10%程度

- 基本配分戦略は月次で行います。

※基本配分戦略に関して、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。

### 機動的配分戦略(日次戦略)

- 市場環境に応じて、株式ポートフォリオ、債券ポートフォリオの配分比率を調整します。
- 株式ポートフォリオと債券ポートフォリオのそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、株式ポートフォリオ、債券ポートフォリオの配分比率を調整することで基準価額の下落の抑制をめざします。
- 機動的配分戦略は日次で行います。

※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

### 3 基準価額の変動リスク<sup>\*3</sup>を一定程度<sup>\*4</sup>に抑えることをめざして、運用を行います。

●目標リスク水準の異なる3つのファンドから選択いただけます。また、各ファンド間でスイッチングが可能です。

\*3 基準価額の変動の大きさを表し、この値が小さいほど、基準価額の変動が小さいことを意味します。ファンドでは、これを「目標リスク」と表すことがあります。

\*4 各ファンドが目標とする基準価額の変動リスクは以下の通りです。

ファンド	基準価額の変動リスク <sup>*5</sup>
エントリーコース	年率2%程度
ベーシックコース	年率4%程度
アドバンスコース <sup>*6</sup>	年率8%程度

\*5 上記数値は中長期的なリスク水準の目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれをも約束するものではありません。また、各ファンドが年率2%程度・4%程度・8%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

\*6 アドバンスコースのポートフォリオの構築においては、実質的に、先物取引の買建金額の合計が信託財産の純資産総額の200%程度の範囲内で運用を行います。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合や一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

### 4 毎月15日の決算日(休業日の場合は翌営業日)に収益の分配を行います。



・上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

●各決算期末の前営業日の基準価額に応じて、原則として、以下の金額の分配をめざします。

※基準価額は、1万口当たりとし、ファンド設定来の支払済み分配金(税引前)を含みません。

各決算期末の前営業日の基準価額	予想分配金額(毎月分配、1万口当たり、税引前)		
	エントリーコース	ベーシックコース	アドバンスコース
10,500円未満	基準価額の水準等を勘案して決定	基準価額の水準等を勘案して決定	基準価額の水準等を勘案して決定
10,500円以上 11,000円未満	5円	20円	40円
11,000円以上	10円	30円	60円

※分配対象額が少額の場合、各決算期末の前営業日から当該決算期末までに基準価額が急激に変動した場合等には、上記と異なる分配金額となることや分配を行わないことがあります。

※各決算期末の前営業日の基準価額水準に応じて、予想分配金額は変動します。基準価額が上記の一定水準に一度でも到達すれば、その水準に応じた予想分配金額が次期決算以降も継続されるというものではありません。

※分配を行うことにより基準価額は下落します。このため、次期決算以降の分配金額は変動する場合があります。

※上記の表は、基準価額水準における予想分配金額を示すことを目的としています。分配金額は予想に基づくものであり、将来の運用の成果を示唆および保証するものではありません。

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配を約束するものではありません。また、分配金が支払われない場合もあります。

※投資者ごとに購入金額が異なるため、基準価額が10,000円を超えて支払われた分配金であっても、分配金の一部または全部が実質的に元本の払い戻しに相当する場合があります。

## 運用プロセス

基本配分戦略  
(月次戦略)

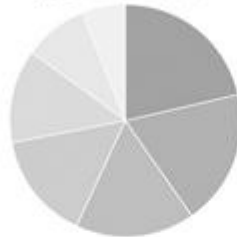
分散効果(=リスク低減効果)が最大となることをめざして統計的手法を活用します。そのうえで、中長期的な株式のリターン傾向を勘案してポートフォリオの配分比率を決定します。

## 各ファンドの基本配分比率決定のイメージ

## ステップ1

株式と債券それぞれで分散効果(=リスク低減効果)が最大となることをめざして、国・地域別配分比率を調整したポートフォリオを構築します。

株式ポートフォリオ



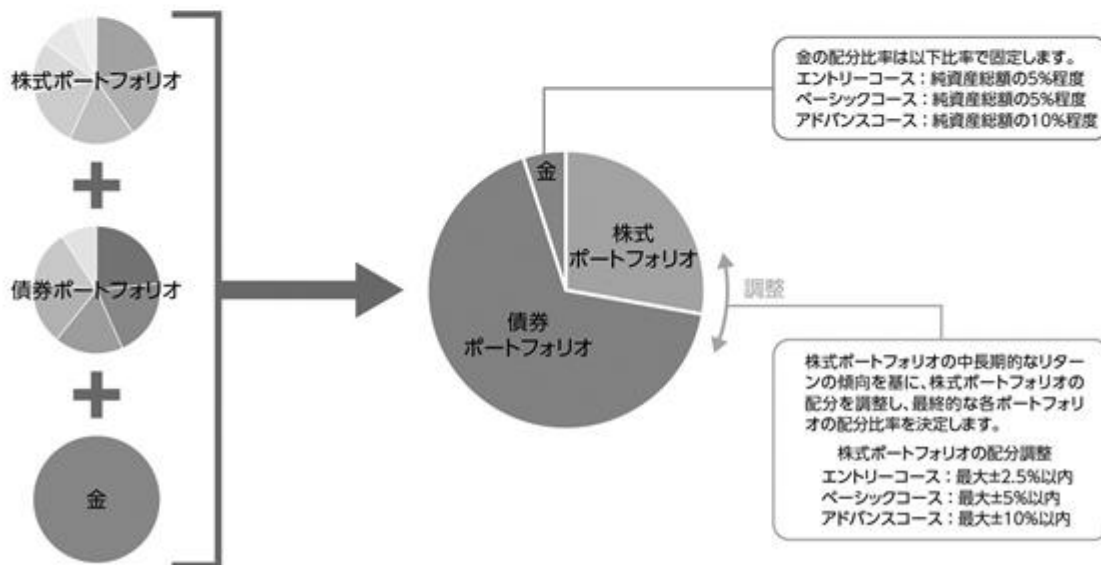
債券ポートフォリオ



## ステップ2

投資対象のリスクや相関係数等を用いて、各ファンドの目標リスクに近づくよう株式ポートフォリオ、債券ポートフォリオの配分比率を決定します。

そのうえで、株式ポートフォリオの中長期的なリターン傾向を基に、株式ポートフォリオの配分を調整し、最終的な各ポートフォリオの配分比率を決定します。

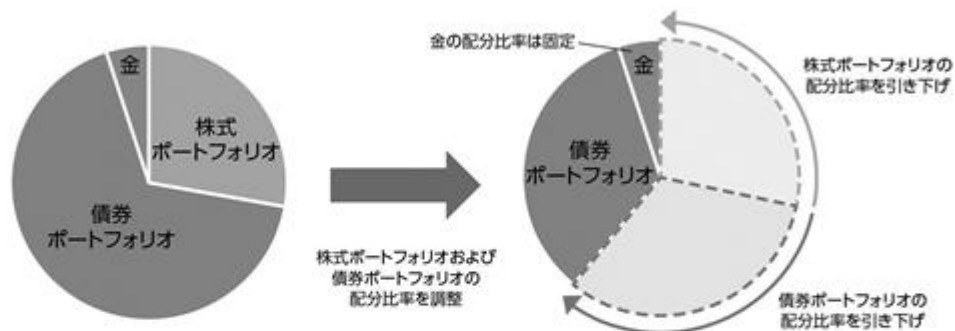


※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

## 機動的配分戦略 (日次戦略)

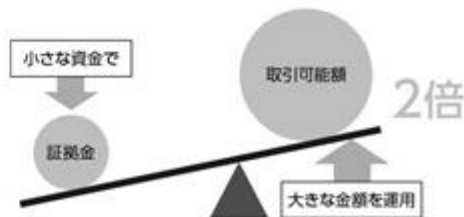
相場環境を日々判定し、下落の可能性が高まったと判定した場合は、株式ポートフォリオ、債券ポートフォリオの配分比率を調整することで基準価額の下落の抑制をめざします。

### 価格下落局面における配分比率変更のイメージ



### 先物取引の活用

先物取引を活用することで、少ない元手でも大きな投資効果を得ることができます。  
アドバンスコースでは、先物取引を活用することで買建金額の合計が信託財産の純資産総額の2倍程度まで運用することができます。



※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

## ■ 分配方針

年12回の決算時(毎月15日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 収益分配金に関する留意事項

◆投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



◆分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

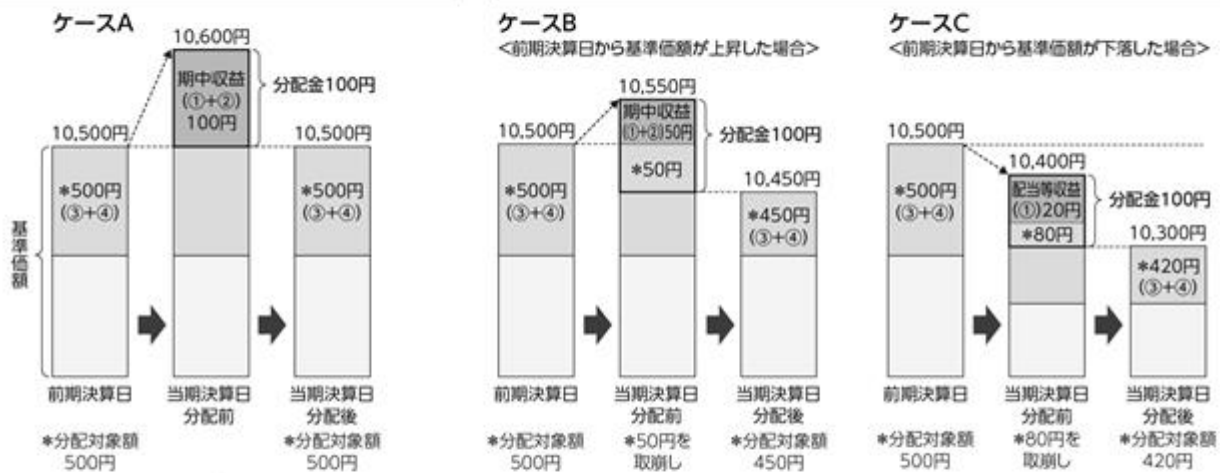
### 分配金額と基準価額の関係(イメージ)

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益(経費控除後)、②有価証券売買益・評価益(経費控除後)、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

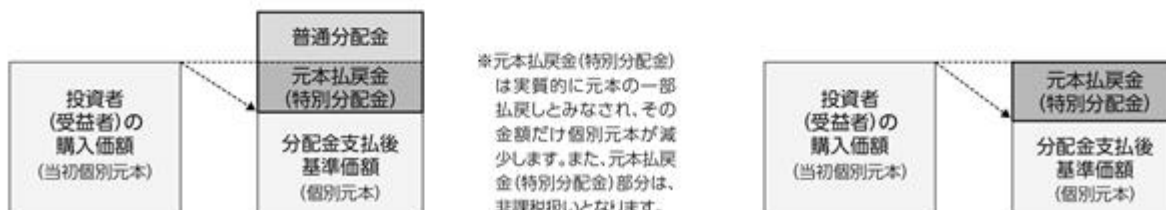
ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円  
 ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円  
 ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。  
 ※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご留意ください。

◆投資者(受益者)のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金: 個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金): 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

## &lt;商品分類&gt;

## ・商品分類表

## 各ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型	国内	株式
	海外	債券
追加型	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## ・商品分類定義

追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」および「その他資産」のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。



## &lt;属性区分&gt;

・属性区分表

各ファンド

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (日本を含む)		
大型株 中小型株	年2回	日本		
債券 一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (部分ヘッジ)
公債 社債	年6回 (隔月)	欧州		
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア オセアニア		
不動産投信	日々	中南米		なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株価指数先物取 引、債券先物取引、E TF)資産配分変更 型))	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オ ブ・ファンズ	
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注1)「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注2)各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株価 指数先物取引、債 券先物取引、E T F） 資産配分変更 型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株価指数先物取引、債券先物取引、E T F）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年12回 （毎月）	目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり （部分ヘッジ）	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

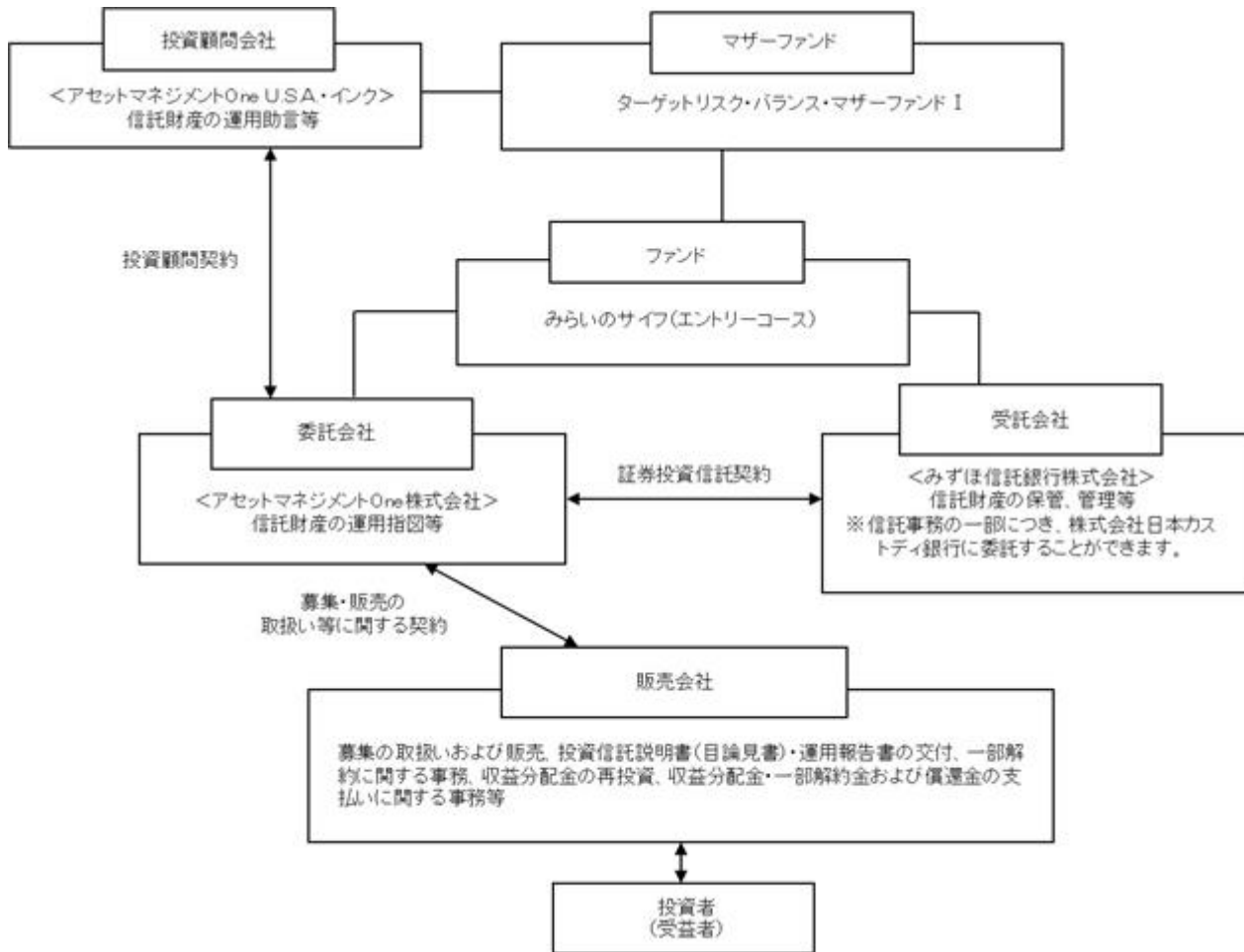
（注3）各ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株価指数先物取引、債券先物取引、E T Fを主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## （2）【ファンドの沿革】

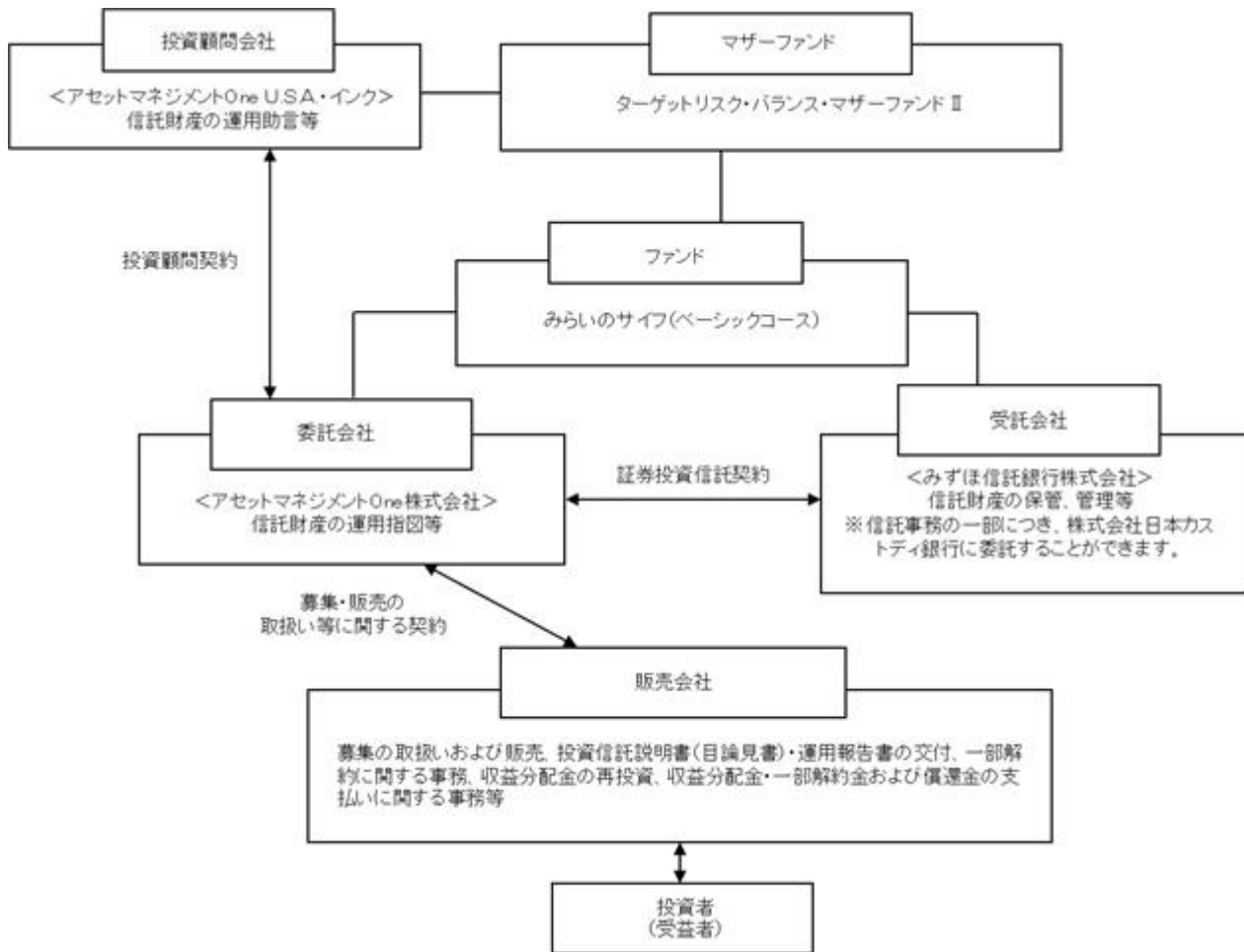
2021年12月29日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

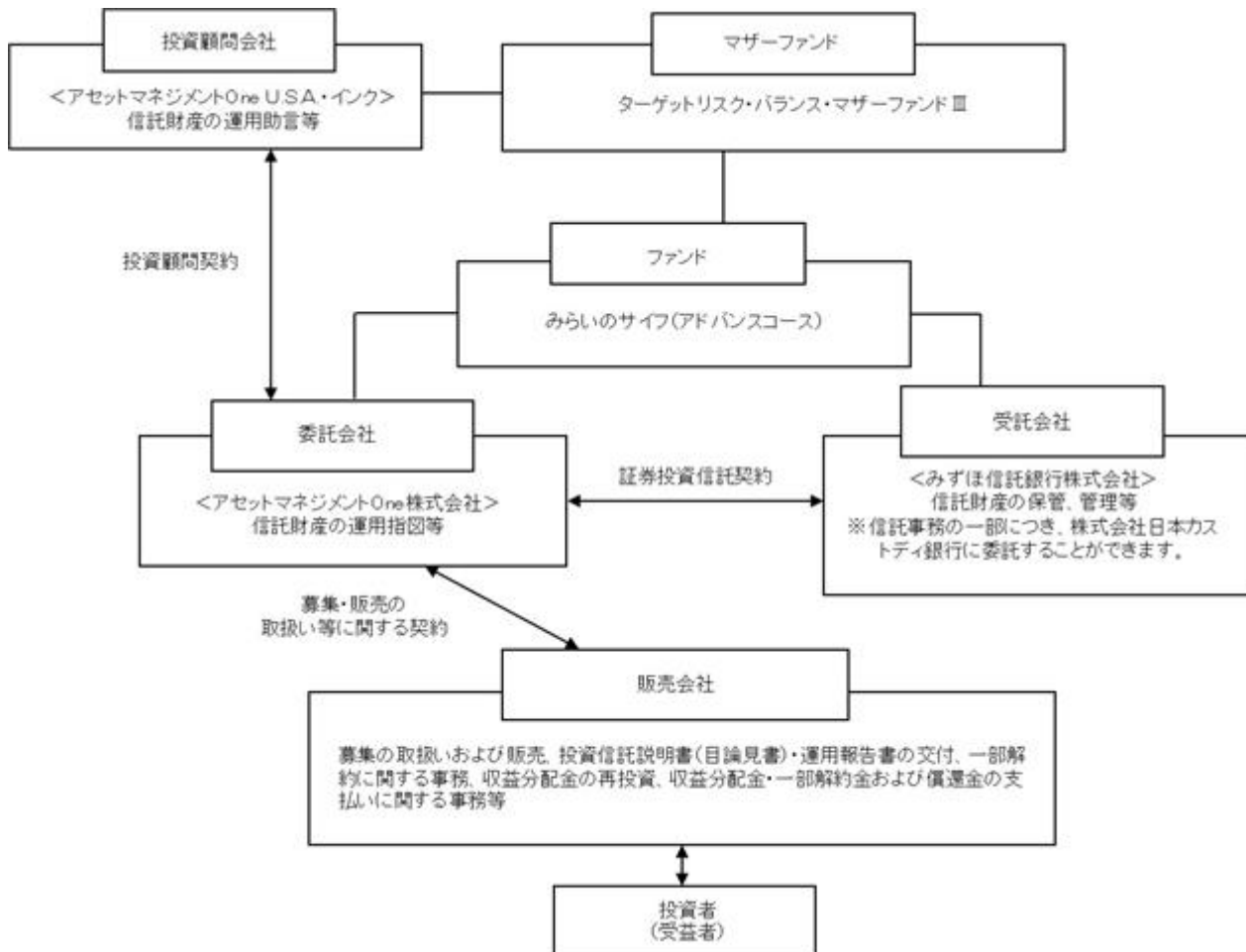
## みらいのサイフ(エントリーコース)



## みらいのサイフ（ベーシックコース）



## みらいのサイフ（アドバンスコース）



### ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、各ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

### ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

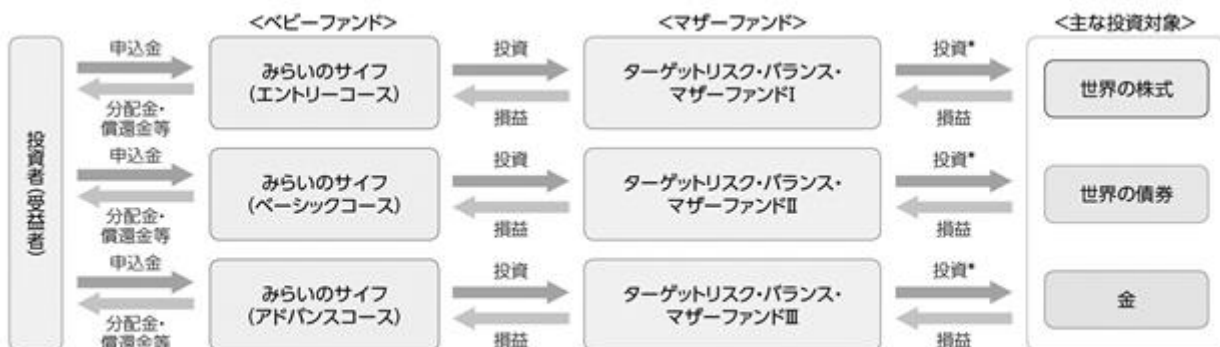
### ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）の間においては、各マザーファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

## ファミリーファンド方式とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（各ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



\*マザーファンドからの投資にあたっては、株価指数先物取引、債券先物取引およびETFを活用します。

## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

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

## 資本金の額

20億円（2024年6月28日現在）

## 委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

（2024年6月28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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>

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% <sup>2</sup>
------------------	--------------------	---------	--------------------

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

#### <投資対象>

マザーファンド<sup>(\*1)</sup> 受益証券を主要投資対象とします。

(\*1)は、下記の表より各々あてはめてご覧ください。

みらいのサイフ（エントリーコース）	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド
みらいのサイフ（ベーシックコース）	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド
みらいのサイフ（アドバンスコース）	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

#### <投資態度>

マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として、世界（日本を含む）の株価指数先物取引、債券先物取引および上場している投資信託証券（ETF）に実質的に投資します。

基準価額の変動リスクを（\*2）に抑えるように努めつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれをも約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの中長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが（\*2）の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

上記（\*2）は、下記の表より各々あてはめてご覧ください。

みらいのサイフ（エントリーコース）	年率2%程度
みらいのサイフ（ベーシックコース）	年率4%程度
みらいのサイフ（アドバンスコース）	年率8%程度

実質的に保有している外貨建ての証拠金については、原則として対円での為替ヘッジを行います。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (2) 【投資対象】

## 投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ.有価証券
  - ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)
  - ハ.金銭債権
  - ニ.約束手形
- 2.次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ.為替手形

## 運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託であるマザーファンド<sup>(\*)</sup>の受益証券を含む次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)  
および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~11.の証券または証書の性質を有するもの



13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、次の15.で定めるものを除きます。)
  15. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
  18. 預託証券または預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

上記(＊)は、下記の表より各々あてはめてご覧ください。

みらいのサイフ(エントリーコース)	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド
みらいのサイフ(ベーシックコース)	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド
みらいのサイフ(アドバンスコース)	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することの指図をすることができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

(参考)各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	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。		
主な投資対象	世界(日本を含む)の株価指数先物、債券先物および上場している投資信託証券(ETF)を主要投資対象とします。		

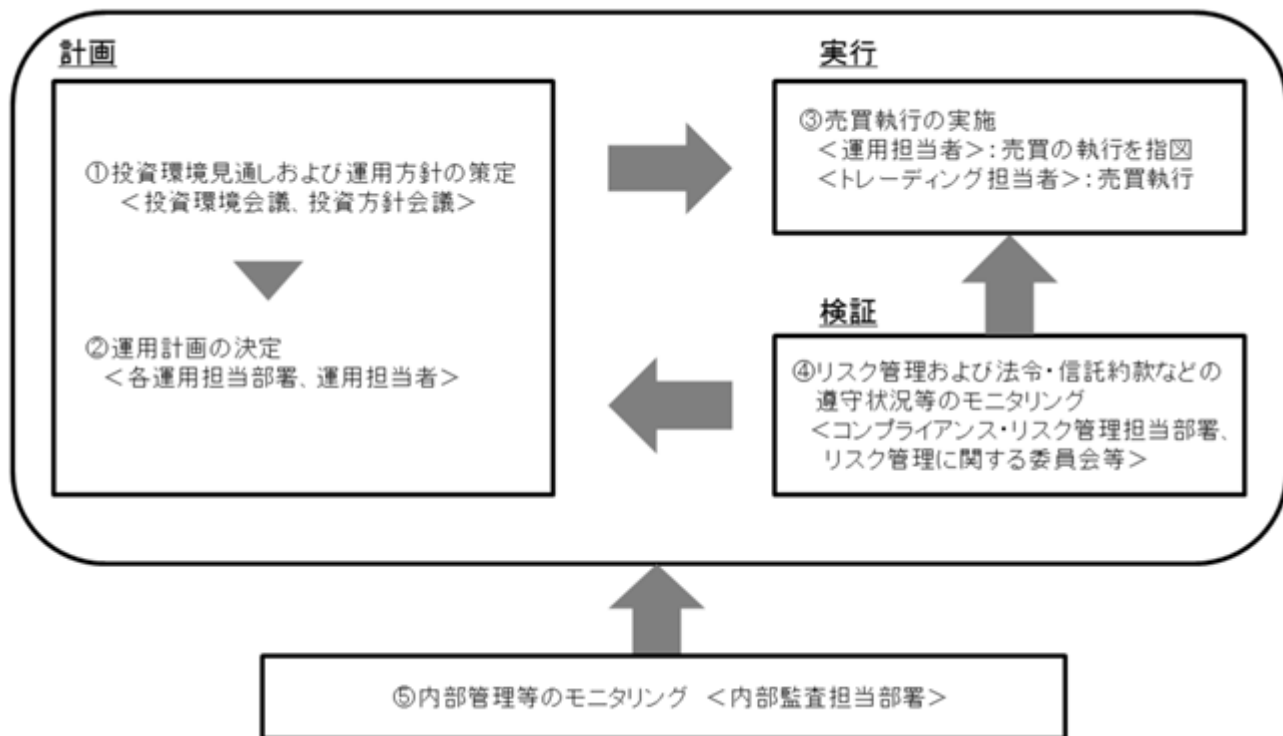
投資態度	世界(日本を含む)の株価指数先物、債券先物および上場している投資信託証券(ETF)への投資を通じて、実質的に世界(日本を含む)の株式、債券および金に投資します。		
<p>基準価額の変動リスクを年率2%程度に抑えるように努めつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。</p> <p>上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれをも約束するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。</p>	<p>基準価額の変動リスクを年率4%程度に抑えるように努めつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。</p> <p>上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれをも約束するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。</p>	<p>基準価額の変動リスクを年率8%程度に抑えるように努めつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。</p> <p>上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれをも約束するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。</p>	
<p>基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率を決定します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>基本配分戦略では、統計的手法を用い、目標リスク水準に近づくように配分比率を決定します。そのうえで、株式の中長期的なリターンを基に、株式の配分比率を調整し、最終的な基本配分比率を決定します。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>金への配分比率はポートフォリオの5%程度とします。</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>金への配分比率はポートフォリオの10%程度とします。</li> </ul>	
<ul style="list-style-type: none"> <li>基本配分戦略は月次で行います。</li> </ul> <p>機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、機動的に株式・債券への投資比率の引き下げを行います。</li> <li>機動的配分戦略は日次で行います。</li> </ul>	<p>株価指数先物および債券先物の買建金額は、信託財産の純資産総額以内<sup>*</sup>を基本とします。</p> <p><sup>*</sup>純資産総額が僅少な場合等には、上記買建金額が信託財産の純資産総額をやむを得ず超える場合があります。</p>	<p>株価指数先物および債券先物の買建金額の合計は、信託財産の純資産総額に対し、最大200%程度を基本とします。</p>	
<p>外貨建ての証拠金については、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p>			

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
---------------	--

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### （3）【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書

を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

#### 売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

#### モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署(人数60~70人程度)は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的に行われるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

#### 内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署(人数10~20人程度)が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

#### c. 運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は2024年6月28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。

#### (4)【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時(原則として毎月15日(休業日の場合は翌営業日。))に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1)分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
- (2)分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3)留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

##### 収益の分配方式

- (1)信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
  - 1)信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  - 2)売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2)上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

##### 収益分配金の支払い

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5)【投資制限】

マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図範囲(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図（約款第23条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、または価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、または価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図（約款第24条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、または価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、または価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。



#### 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第27条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 公社債の空売りの指図および範囲(約款第28条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 上記1)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 公社債の借入れの指図および範囲(約款第29条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第30条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約取引の指図(約款第31条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のう

ち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- 3)上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- 5)委託会社は、外国為替の売買の予約取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### 資金の借入れ(約款第37条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

### 3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

各ファンドは、デリバティブ取引等を通じて、世界(日本を含む)の株式、債券、金等の値動きのある資産等(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 市場(価格変動)リスク

投資する資産の価格変動は、基準価額に影響をおよぼす場合があります。

各ファンドは実質的にデリバティブ取引等を通じて、世界(日本を含む)の株式、債券、金等の値動きのある資産等に投資を行います。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。

債券の価格は、金利変動等の影響を受けます。また金利変動は、債券・株式・金等の各資産への投資の相対的魅力度を変化させるため、金利変動により各資産の市場の間で資金移動が起こる場合があります。

金価格は、金の需給関係の変化、為替、金利の変化等様々な要因で変動します。なお、金への投資はETFを通じて行います。

これらの資産は、上記などの影響を受け価格が変動するため、各ファンドの基準価額はその影響を受け、下落することがあります。

#### デリバティブ取引等に関するリスク

[ エントリーコース ] [ ベーシックコース ]

デリバティブ取引等は、基準価額に影響をおよぼす場合があります。

[ アドバンスコース ]

デリバティブ取引等は、基準価額に大きな影響をおよぼす場合があります。

各ファンドでは、デリバティブ取引を行います。取引の内容によっては、価格変動の基礎となる資産(原資産)以上の値動きをすることがあります。各ファンドは、実質的に株価指数先物取引、債券先物取引を使用するため、株価指数先物取引、債券先物取引の価格変動により基準価額が上下します。先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。実質的に先物を買って建っている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します。また、株価指数先物取引、債券先物取引の値動きと市場全体の値動きは一致しない場合があります。

アドバンスコースでは、買建ポジションの合計が、信託財産の純資産総額の200%程度の範囲内で運用を行うため、基準価額は株式市況、債券市況の変動の影響を大きく受ける場合があります。

#### 資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値の変動等は、基準価額に影響をおよぼす場合があります。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。各ファンドは、基準価額の変動リスクが一定程度となるよう統計的手法を用い、実質的に株式、債券、金等に資産配分を行いますが、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合等には、目標とする変動リスク以上に基準価額が変動する場合があります。また、各ファンドは

基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行います。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追従できない場合があります。

#### 為替変動リスク

為替ヘッジを行っても、円高による影響を完全には排除できません。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。各ファンドは外貨建ての証拠金について、対円での為替ヘッジを行います。ETFについては為替ヘッジを行わないため、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、実質保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジには、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

#### 金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

金利の変動は、債券等の価格に影響をおよぼします。金利の上昇は、一般に債券の価格を下落させ、基準価額が下落する要因となります。

#### 流動性リスク

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

有価証券等を売却または取得する際や、デリバティブ取引等を行う際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格に影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

#### 信用リスク

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。各ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したり、その価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

#### カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。各ファンドは実質的に新興国の株式にも投資を行います。新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税

制、海外への送金規制等の種々の規制の導入や政策の変更等の要因も株式市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

各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。

各ファンドは、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。

各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、各ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、各ファンドの基準価額や運用に影響を受ける場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付または解約の受付を取り消すことができますものとしてします。

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

「みらいのサイフ」を構成する3つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

各ファンドは予想分配金額を設定しており、予想分配金額に応じて分配金をお支払いすることをめざしますが、あらかじめ一定の額の分配を約束するものではなく、分配金が支払われない場合もあります。

#### 注意事項

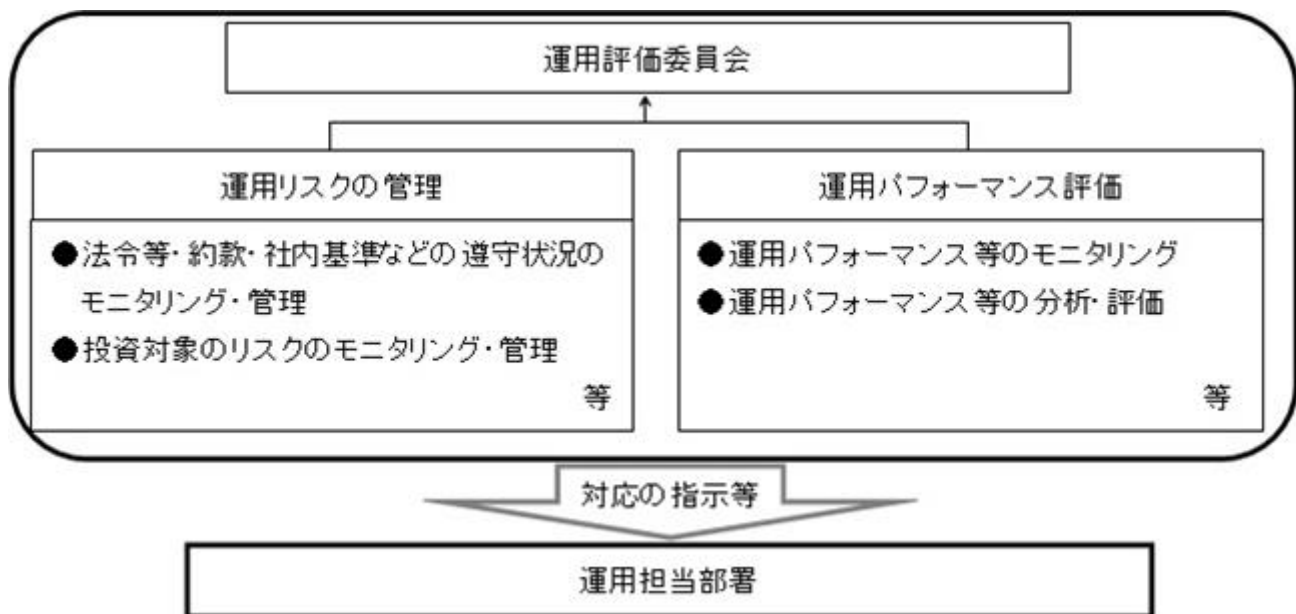
- 各ファンドは、デリバティブ取引等を通じて、世界(日本を含む)の株式、債券、金等の値動きのある資産等(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。
- 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

委託会社におけるファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・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2024年6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

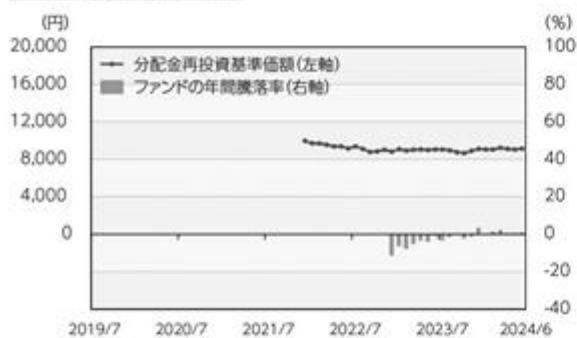
## <参考情報>

### 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

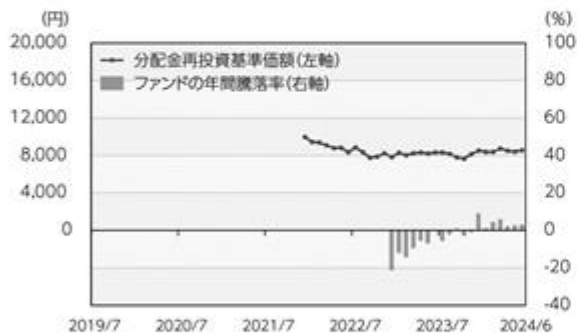
#### エントリーコース



#### ベーシックコース

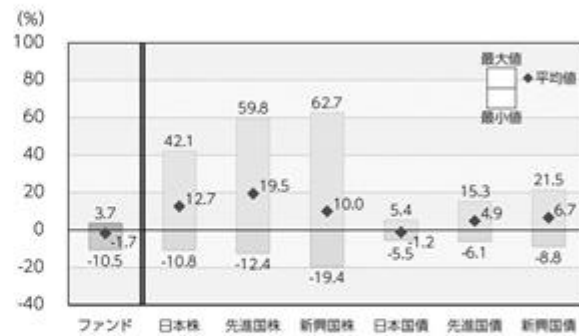


#### アドバンスコース

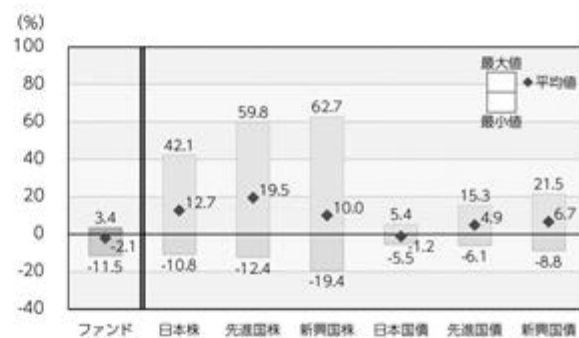


- \*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- \*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

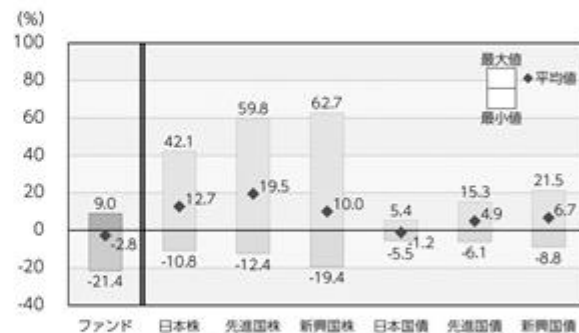
### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2022年12月~2024年6月  
代表的な資産クラス:2019年7月~2024年6月



ファンド:2022年12月~2024年6月  
代表的な資産クラス:2019年7月~2024年6月



ファンド:2022年12月~2024年6月  
代表的な資産クラス:2019年7月~2024年6月

- \*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範に網羅し、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JPX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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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】

## (1)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

各ファンドの信託報酬およびその配分は、以下の通りとします。

[ エントリーコース ]

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.759%～0.979%（税抜0.69%～0.89%）

純資産総額	信託報酬の配分（税抜）（年率）		
	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬 税込（税抜）			
300億円以下の部分 ----- 年率0.979%（0.89%）	0.43%	0.43%	0.03%
300億円超500億円以下の部分 ----- 年率0.869%（0.79%）	0.38%	0.38%	0.03%
500億円超の部分 ----- 年率0.759%（0.69%）	0.33%	0.33%	0.03%
主な役務	信託財産の運用、 目論見書等各種書 類の作成、基準価 額の算出等の対価	購入後の情報提 供、交付運用報告 書等各種書類の送 付、口座内での ファンドの管理等 の対価	運用財産の保管・ 管理、委託会社か らの運用指図の実 行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

委託会社の信託報酬には、以下のとおり、ターゲットリスク・バランス・マザーファンドの投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）に対する投資顧問報酬（ファンドの信託財産に属する当該マザーファンドの時価総額に対して、以下の料率を乗じた額）が含まれます。

組入時価総額	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド
300億円以下の部分	年率0.1935%
300億円超500億円以下の部分	年率0.1710%
500億円超の部分	年率0.1485%

## [ベーシックコース][アドバンスコース]

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.089%～1.309%(税抜0.99%～1.19%)

純資産総額	信託報酬の配分(税抜)(年率)		
	委託会社	販売会社	受託会社
信託報酬 税込(税抜)			
300億円以下の部分 年率1.309%(1.19%)	0.58%	0.58%	0.03%
300億円超500億円以下の部分 年率1.199%(1.09%)	0.53%	0.53%	0.03%
500億円超の部分 年率1.089%(0.99%)	0.48%	0.48%	0.03%
主な役務	信託財産の運用、 目論見書等各種書 類の作成、基準価 額の算出等の対価	購入後の情報提 供、交付運用報告 書等各種書類の送 付、口座内での ファンドの管理等 の対価	運用財産の保管・ 管理、委託会社か らの運用指図の実 行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

委託会社の信託報酬には、以下のとおり、ターゲットリスク・バランス・マザーファンド / ターゲットリスク・バランス・マザーファンド の投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)に対する投資顧問報酬(各ファンドの信託財産に属する当該マザーファンドの時価総額に対して、以下の料率を乗じた額)が含まれます。

組入時価総額	ターゲットリスク・バラ ンス・マザーファンド	ターゲットリスク・バラ ンス・マザーファンド
300億円以下の部分	年率0.2610%	
300億円超500億円以下の部分	年率0.2385%	
500億円超の部分	年率0.2160%	

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (4) 【その他の手数料等】

##### ・信託財産留保額

ありません。

##### ・その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、間接的に各ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

上場投資信託(ETF)は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託(ETF)の費用は表示しておりません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用なし)のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 解約時および償還時

解約時および償還時の差益(譲渡益)については、譲渡所得として、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座(源泉徴収口座)を利用する場合、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。)を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象となります。各ファンドは、NISAの対象ではありません。

#### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2024年6月末現在のもので、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。

#### 個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

##### < 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金(特別分配金)が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となりま

す。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の<収益分配金の課税について>を参照。)

#### <収益分配金の課税について>

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、収益分配金に元本払戻金(特別分配金)が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

#### …(参考情報)ファンドの総経費率…

ファンド名	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
エントリーコース	1.05%	0.98%	0.07%
ベーシックコース	1.38%	1.31%	0.07%
アドバンスコース	1.33%	1.31%	0.03%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年12月16日～2024年6月17日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、各ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## みらいのサイフ（エントリーコース）

2024年6月28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	1,092,331,135	99.06
内 日本	1,092,331,135	99.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,400,670	0.94
純資産総額	1,102,731,805	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。

## みらいのサイフ（ベーシックコース）

2024年6月28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	1,169,345,935	99.10
内 日本	1,169,345,935	99.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,668,136	0.90
純資産総額	1,180,014,071	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。

## みらいのサイフ（アドバンスコース）

2024年6月28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	819,526,443	99.10
内 日本	819,526,443	99.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,445,641	0.90
純資産総額	826,972,084	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）

## ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	459,846,800	42.10
内 日本	459,846,800	42.10
投資信託受益証券	55,228,970	5.06
内 アメリカ	55,228,970	5.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	577,202,529	52.84
純資産総額	1,092,278,299	100.00

## その他資産の投資状況

2024年6月28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）	192,903,735	17.66
内 アメリカ	70,907,846	6.49
内 カナダ	30,907,292	2.83
内 日本	28,105,000	2.57
内 ドイツ	25,528,966	2.34

	内 オーストラリア	20,728,575	1.90
	内 イギリス	16,726,056	1.53
債券先物取引(買建)		730,246,982	66.86
	内 アメリカ	230,853,577	21.14
	内 日本	142,860,000	13.08
	内 オーストラリア	120,591,921	11.04
	内 ドイツ	113,772,266	10.42
	内 イギリス	79,764,160	7.30
	内 カナダ	42,405,058	3.88

(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。

#### ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	499,846,000	42.74
内 日本	499,846,000	42.74
投資信託受益証券	59,477,352	5.09
内 アメリカ	59,477,352	5.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	610,069,631	52.17
純資産総額	1,169,392,983	100.00

#### その他資産の投資状況

2024年6月28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)	292,978,100	25.05
内 アメリカ	88,403,269	7.56
内 日本	56,210,000	4.81
内 ドイツ	42,548,277	3.64
内 オーストラリア	41,457,150	3.55
内 イギリス	33,452,112	2.86
内 カナダ	30,907,292	2.64
債券先物取引(買建)	770,759,403	65.91
内 アメリカ	248,611,545	21.26
内 日本	142,860,000	12.22
内 ドイツ	136,526,719	11.68
内 オーストラリア	120,591,921	10.31
内 イギリス	79,764,160	6.82
内 カナダ	42,405,058	3.63

(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。

#### ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	249,861,800	30.49
内 日本	249,861,800	30.49

投資信託受益証券		81,272,377	9.92
	内 アメリカ	81,272,377	9.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		488,370,291	59.59
純資産総額		819,504,468	100.00

その他資産の投資状況

2024年6月28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）		376,326,408	45.92
	内 アメリカ	105,898,692	12.92
	内 日本	84,315,000	10.29
	内 オーストラリア	62,185,725	7.59
	内 ドイツ	59,567,587	7.27
	内 イギリス	33,452,112	4.08
	内 カナダ	30,907,292	3.77
債券先物取引（買建）		1,037,129,174	126.56
	内 アメリカ	355,159,350	43.34
	内 ドイツ	182,035,625	22.21
	内 オーストラリア	180,887,881	22.07
	内 日本	142,860,000	17.43
	内 イギリス	119,646,240	14.60
	内 カナダ	56,540,078	6.90

（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。

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

みらいのサイフ（エントリーコース）

2024年6月28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	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,152,856,080	0.9508 1,096,250,846	0.9475 1,092,331,135	- -	99.06

（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

2024年6月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.06
合計	99.06

（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。

みらいのサイフ（ベーシックコース）

2024年6月28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	ターゲットリスク・バ ランス・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,238,845,148	0.9460 1,172,071,394	0.9439 1,169,345,935	- -	99.10

(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

2024年6月28日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.10
合計	99.10

(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。

#### みらいのサイフ（アドバンスコース）

2024年6月28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	ターゲットリスク・バ ランス・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	927,275,904	0.8877 823,142,841	0.8838 819,526,443	- -	99.10

(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

2024年6月28日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.10
合計	99.10

(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)

#### ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28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	1202回 国庫短期証券 日本	国債証 券	400,000,000	100.05 400,200,000	99.96 399,848,000	- 2024/12/20	36.61
2	1170回 国庫短期証券 日本	国債証 券	60,000,000	100.05 60,030,600	99.99 59,998,800	- 2024/7/22	5.49
3	ISHARES GOLD TRUST アメリカ	投資信 託受益 証券	7,800	6,228.79 48,584,581	7,080.63 55,228,970	- -	5.06

(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

2024年6月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	42.10
投資信託受益証券	5.06
合計	47.16

（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。

## ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28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	1202回 国庫短期証券 日本	国債証券	400,000,000	100.05 400,200,000	99.96 399,848,000	- 2024/12/20	34.19
2	1170回 国庫短期証券 日本	国債証券	100,000,000	100.05 100,051,000	99.99 99,998,000	- 2024/7/22	8.55
3	ISHARES GOLD TRUST アメリカ	投資信託受益証券	8,400	6,236.46 52,386,326	7,080.63 59,477,352	- -	5.09

（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

2024年6月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	42.74
投資信託受益証券	5.09
合計	47.83

（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。

## ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28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	1231回 国庫短期証券 日本	国債証券	120,000,000	99.80 119,765,160	99.90 119,882,400	- 2025/5/20	14.63
2	1170回 国庫短期証券 日本	国債証券	80,000,000	100.05 80,040,800	99.99 79,998,400	- 2024/7/22	9.76
3	ISHARES GOLD TRUST アメリカ	投資信託受益証券	10,500	6,223.69 65,348,758	7,080.63 74,346,690	- -	9.07
4	1202回 国庫短期証券 日本	国債証券	50,000,000	100.05 50,025,000	99.96 49,981,000	- 2024/12/20	6.10

5	SPDR GOLD SHARES ETF アメリカ	投資信託受益証券	200	31,733.23 6,346,646	34,628.43 6,925,687	- -	0.85
---	------------------------------	----------	-----	------------------------	------------------------	--------	------

(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

2024年6月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	30.49
投資信託受益証券	9.92
合計	40.41

(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】

みらいのサイフ(エントリーコース)

該当事項はありません。

みらいのサイフ(ベーシックコース)

該当事項はありません。

みらいのサイフ(アドバンスコース)

該当事項はありません。

(参考)

ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

該当事項はありません。

ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

該当事項はありません。

ターゲットリスク・バランス・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】

みらいのサイフ(エントリーコース)

該当事項はありません。

みらいのサイフ(ベーシックコース)

該当事項はありません。

みらいのサイフ(アドバンスコース)

該当事項はありません。

(参考)

ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28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 Sep24	買建	1	44,667,127	44,664,711	4.09
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	1	30,418,120	30,907,292	2.83
	大阪取引所	TOPIX 先物 0609月	買建	1	27,965,330	28,105,000	2.57
	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	3	26,303,536	26,243,135	2.40
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	3	25,548,353	25,528,966	2.34
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep24	買建	1	20,782,075	20,728,575	1.90
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	1	16,723,003	16,726,056	1.53
債券先物取引	シカゴ証券取引所	US 10YR NOTE FUT Sep24	買建	13	228,888,030	230,853,577	21.14
	大阪取引所	長国先 0609月	買建	1	142,940,550	142,860,000	13.08
	シドニー先物取引所	AUST 10Y BOND FUT Sep24	買建	10	122,623,765	120,591,921	11.04
	EUREX取引所	EURO-BUND FUTURE Sep24	買建	5	112,560,786	113,772,266	10.42
	ICE-EU	LONG GILT FUTURE Sep24	買建	4	79,119,128	79,764,160	7.30
	モントリオール取引所	CAN 10YR BOND FUT Sep24	買建	3	42,131,470	42,405,058	3.88

(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。

#### ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28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 0609月	買建	2	55,930,660	56,210,000	4.81
	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep24	買建	1	44,667,127	44,664,711	3.82
	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	5	43,839,227	43,738,558	3.74
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	5	42,580,588	42,548,277	3.64
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep24	買建	2	41,564,150	41,457,150	3.55
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	2	33,443,972	33,452,112	2.86
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	1	30,418,120	30,907,292	2.64

債券先物取引	シカゴ証券取引所	US 10YR NOTE FUT Sep24	買建	14	246,462,278	248,611,545	21.26
	大阪取引所	長国 先 0 6 0 9月	買建	1	142,940,550	142,860,000	12.22
	E U R E X 取引所	EURO-BUND FUTURE Sep24	買建	6	135,151,525	136,526,719	11.68
	シドニー先物取引所	AUST 10Y BOND FUT Sep24	買建	10	122,633,181	120,591,921	10.31
	I C E - E U	LONG GILT FUTURE Sep24	買建	4	79,119,128	79,764,160	6.82
	モントリオール取引所	CAN 10YR BOND FUT Sep24	買建	3	42,131,470	42,405,058	3.63

(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。

#### ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28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	T O P I X 先 物 0 6 0 9月	買建	3	83,895,990	84,315,000	10.29
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep24	買建	3	62,346,225	62,185,725	7.59
	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	7	61,369,280	61,233,981	7.47
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	7	59,612,824	59,567,587	7.27
	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep24	買建	1	44,667,127	44,664,711	5.45
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	2	33,443,972	33,452,112	4.08
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	1	30,417,885	30,907,292	3.77
債券先物取引	シカゴ証券取引所	US 10YR NOTE FUT Sep24	買建	20	352,151,875	355,159,350	43.34
	E U R E X 取引所	EURO-BUND FUTURE Sep24	買建	8	180,136,549	182,035,625	22.21
	シドニー先物取引所	AUST 10Y BOND FUT Sep24	買建	15	183,949,772	180,887,881	22.07
	大阪取引所	長国 先 0 6 0 9月	買建	1	142,940,550	142,860,000	17.43
	I C E - E U	LONG GILT FUTURE Sep24	買建	6	118,710,232	119,646,240	14.60
	モントリオール取引所	CAN 10YR BOND FUT Sep24	買建	4	56,118,540	56,540,078	6.90

(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。

## （３）【運用実績】

## 【純資産の推移】

みらいのサイフ（エントリーコース）

直近日（2024年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1特定期間末 (2022年6月15日)	1,074	1,074	0.9087	0.9087
第2特定期間末 (2022年12月15日)	1,112	1,112	0.9166	0.9166
第3特定期間末 (2023年6月15日)	1,120	1,120	0.9187	0.9187
第4特定期間末 (2023年12月15日)	1,112	1,112	0.9177	0.9177
第5特定期間末 (2024年6月17日)	1,106	1,106	0.9286	0.9286
2023年6月末日	1,116	-	0.9163	-
7月末日	1,107	-	0.9156	-
8月末日	1,096	-	0.9081	-
9月末日	1,076	-	0.8897	-
10月末日	1,068	-	0.8837	-
11月末日	1,098	-	0.9075	-
12月末日	1,122	-	0.9259	-
2024年1月末日	1,108	-	0.9188	-
2月末日	1,100	-	0.9173	-
3月末日	1,110	-	0.9330	-
4月末日	1,097	-	0.9215	-
5月末日	1,092	-	0.9175	-
6月末日	1,102	-	0.9250	-

みらいのサイフ（ベーシックコース）

直近日（2024年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1特定期間末 (2022年6月15日)	1,204	1,204	0.9005	0.9005
第2特定期間末 (2022年12月15日)	1,235	1,235	0.9075	0.9075
第3特定期間末 (2023年6月15日)	1,244	1,244	0.9089	0.9089
第4特定期間末 (2023年12月15日)	1,220	1,220	0.9040	0.9040
第5特定期間末 (2024年6月17日)	1,183	1,183	0.9164	0.9164
2023年6月末日	1,240	-	0.9060	-
7月末日	1,242	-	0.9062	-
8月末日	1,225	-	0.8973	-

9月末日	1,196	-	0.8754	-
10月末日	1,185	-	0.8660	-
11月末日	1,206	-	0.8921	-
12月末日	1,231	-	0.9127	-
2024年1月末日	1,215	-	0.9060	-
2月末日	1,201	-	0.9051	-
3月末日	1,219	-	0.9232	-
4月末日	1,188	-	0.9107	-
5月末日	1,173	-	0.9065	-
6月末日	1,180	-	0.9139	-

### みらいのサイフ（アドバンスコース）

直近日（2024年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1特定期間末 (2022年6月15日)	914	914	0.8110	0.8110
第2特定期間末 (2022年12月15日)	934	934	0.8295	0.8295
第3特定期間末 (2023年6月15日)	929	929	0.8363	0.8363
第4特定期間末 (2023年12月15日)	869	869	0.8369	0.8369
第5特定期間末 (2024年6月17日)	837	837	0.8605	0.8605
2023年6月末日	922	-	0.8318	-
7月末日	924	-	0.8327	-
8月末日	901	-	0.8182	-
9月末日	858	-	0.7799	-
10月末日	837	-	0.7655	-
11月末日	847	-	0.8140	-
12月末日	876	-	0.8528	-
2024年1月末日	853	-	0.8391	-
2月末日	851	-	0.8389	-
3月末日	861	-	0.8720	-
4月末日	828	-	0.8481	-
5月末日	818	-	0.8412	-
6月末日	826	-	0.8564	-

### 【分配の推移】

#### みらいのサイフ（エントリーコース）

	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第3特定期間	0.0000
第4特定期間	0.0000
第5特定期間	0.0000

#### みらいのサイフ（ベーシックコース）

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第3特定期間	0.0000
第4特定期間	0.0000
第5特定期間	0.0000

## みらいのサイフ(アドバンスコース)

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第3特定期間	0.0000
第4特定期間	0.0000
第5特定期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## みらいのサイフ(エントリーコース)

	収益率(%)
第1特定期間	9.1
第2特定期間	0.9
第3特定期間	0.2
第4特定期間	0.1
第5特定期間	1.2

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

## みらいのサイフ(ベーシックコース)

	収益率(%)
第1特定期間	10.0
第2特定期間	0.8
第3特定期間	0.2
第4特定期間	0.5
第5特定期間	1.4

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

## みらいのサイフ(アドバンスコース)

	収益率(%)
第1特定期間	18.9
第2特定期間	2.3
第3特定期間	0.8
第4特定期間	0.1
第5特定期間	2.8

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

## (4) 【設定及び解約の実績】

## みらいのサイフ(エントリーコース)

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,189,877,593	7,738,712



第2特定期間	48,601,396	16,930,015
第3特定期間	11,000,122	5,580,061
第4特定期間	10,708,457	17,550,026
第5特定期間	8,399,156	28,660,520

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

みらいのサイフ(ベーシックコース)

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,350,297,642	12,286,356
第2特定期間	52,525,068	28,835,476
第3特定期間	32,948,119	25,001,711
第4特定期間	25,543,589	45,541,116
第5特定期間	16,973,683	75,521,189

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

みらいのサイフ(アドバンスコース)

	設定口数	解約口数
第1特定期間	1,299,341,402	172,045,781
第2特定期間	35,953,304	36,498,241
第3特定期間	23,647,429	38,969,010
第4特定期間	23,502,300	96,043,167
第5特定期間	18,945,575	84,392,401

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

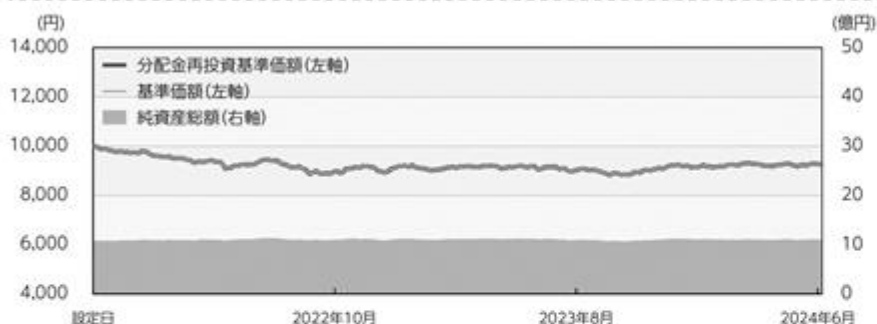
(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2024年6月28日

## エントリーコース

## 基準価額・純資産の推移 (2021年12月29日～2024年6月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2021年12月29日)

## 分配の推移(税引前)

2024年 2月	0円
2024年 3月	0円
2024年 4月	0円
2024年 5月	0円
2024年 6月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	ターゲットリスク・バランス・マザーファンドI	99.06

■ターゲットリスク・バランス・マザーファンドI

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

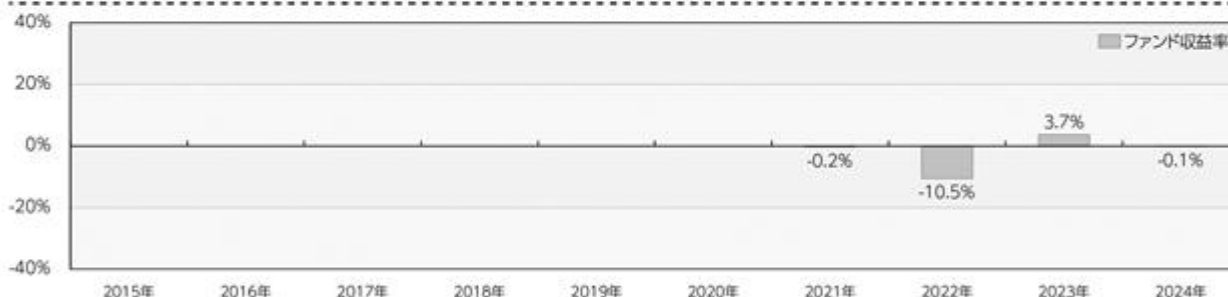
## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
国債証券	42.10
内 日本	42.10
投資信託受益証券	5.06
内 アメリカ	5.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	52.84
合計(純資産総額)	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	17.66
内 アメリカ	6.49
内 カナダ	2.83
内 日本	2.57
内 ドイツ	2.34
内 オーストラリア	1.90
内 イギリス	1.53
債券先物取引(買建)	66.86
内 アメリカ	21.14
内 日本	13.08
内 オーストラリア	11.04
内 ドイツ	10.42
内 イギリス	7.30
内 カナダ	3.88

## 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2024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。

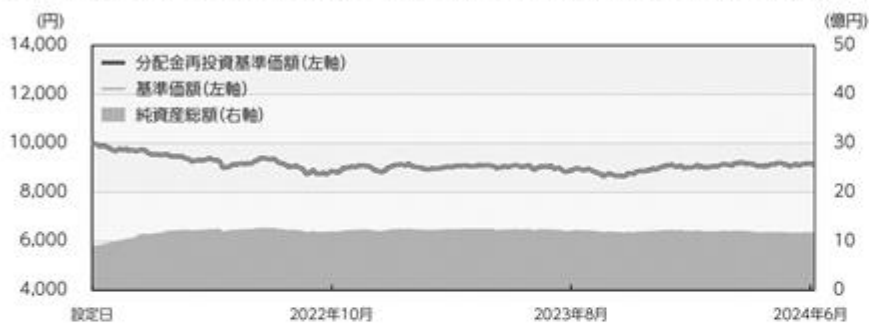
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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:2024年6月28日

## ベーシックコース

## 基準価額・純資産の推移 (2021年12月29日～2024年6月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2021年12月29日)

## 分配の推移(税引前)

2024年 2月	0円
2024年 3月	0円
2024年 4月	0円
2024年 5月	0円
2024年 6月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	ターゲットリスク・バランス・マザーファンドⅡ	99.10

## ■ターゲットリスク・バランス・マザーファンドⅡ

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

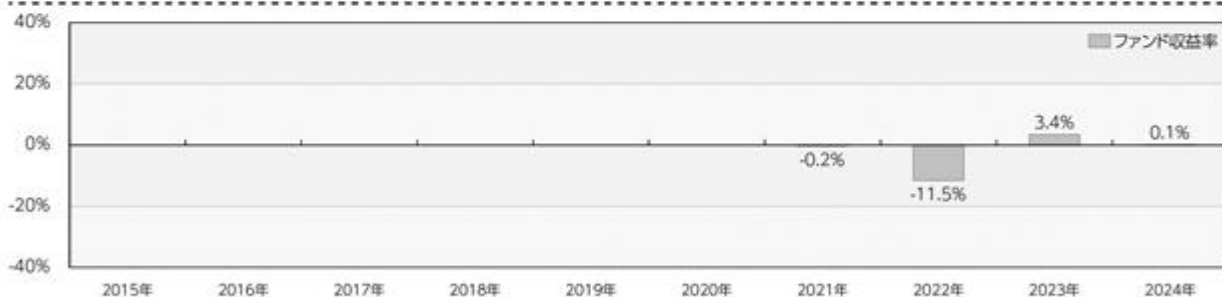
## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
国債証券	42.74
内 日本	42.74
投資信託受益証券	5.09
内 アメリカ	5.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	52.17
合計(純資産総額)	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	25.05
内 アメリカ	7.56
内 日本	4.81
内 ドイツ	3.64
内 オーストラリア	3.55
内 イギリス	2.86
内 カナダ	2.64
債券先物取引(買建)	65.91
内 アメリカ	21.26
内 日本	12.22
内 ドイツ	11.68
内 オーストラリア	10.31
内 イギリス	6.82
内 カナダ	3.63

## 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2024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。

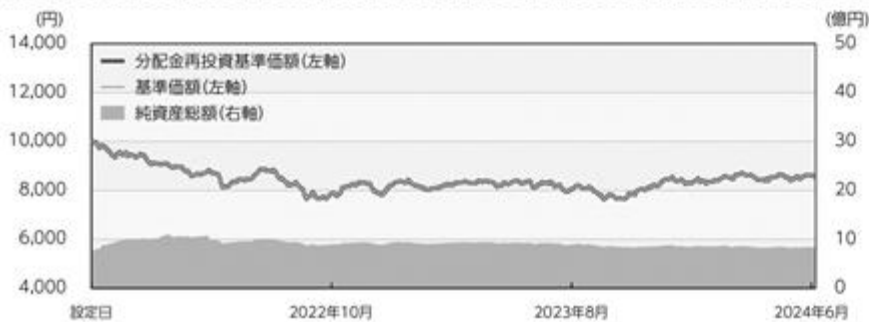
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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:2024年6月28日

## アドバンスコース

## 基準価額・純資産の推移 (2021年12月29日~2024年6月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2021年12月29日)

## 分配の推移(税引前)

2024年 2月	0円
2024年 3月	0円
2024年 4月	0円
2024年 5月	0円
2024年 6月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	ターゲットリスク・バランス・マザーファンドⅢ	99.10

## ■ターゲットリスク・バランス・マザーファンドⅢ

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

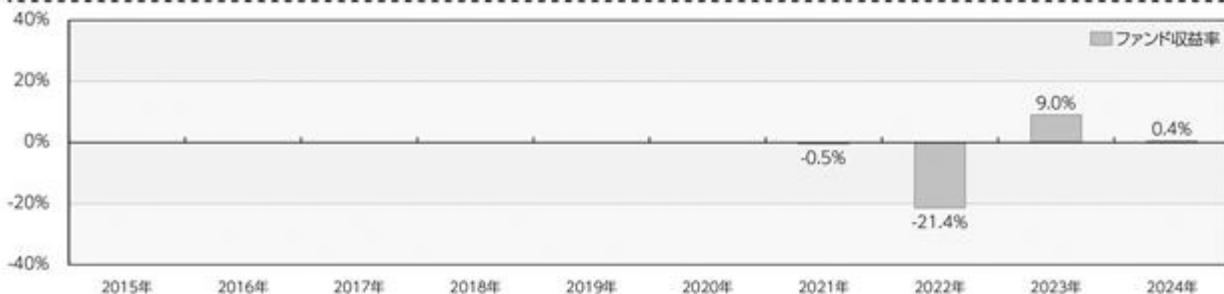
## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
国債証券	30.49
内 日本	30.49
投資信託受益証券	9.92
内 アメリカ	9.92
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	59.59
合計(純資産総額)	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株債指数先物取引(買建)	45.92
内 アメリカ	12.92
内 日本	10.29
内 オーストラリア	7.59
内 ドイツ	7.27
内 イギリス	4.08
内 カナダ	3.77
債券先物取引(買建)	126.56
内 アメリカ	43.34
内 ドイツ	22.21
内 オーストラリア	22.07
内 日本	17.43
内 イギリス	14.60
内 カナダ	6.90

## 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2024年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

※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:2024年6月28日

## 主要な資産の状況

## ■ターゲットリスク・バランス・マザーファンドI

※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。

## 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	1202回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/12/20	36.61
2	1170回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/7/22	5.49
3	ISHARES GOLD TRUST	投資信託受益証券	アメリカ	-	-	5.06

## 株価指数先物取引 組入銘柄

資産の名称	買建/売建	比率(%)
S&P500 EMINI FUT Sep24	買建	4.09
S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	2.83
TOPIX 先物 0609月	買建	2.57
MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	2.40
DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	2.34
SPI 200 FUTURES Sep24	買建	1.90
FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	1.53

## 債券先物取引 組入銘柄

資産の名称	買建/売建	比率(%)
US 10YR NOTE FUT Sep24	買建	21.14
長国 先物 0609月	買建	13.08
AUST 10Y BOND FUT Sep24	買建	11.04
EURO-BUND FUTURE Sep24	買建	10.42
LONG GILT FUTURE Sep24	買建	7.30
CAN 10YR BOND FUT Sep24	買建	3.88

## ■ターゲットリスク・バランス・マザーファンドII

※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。

## 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	1202回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/12/20	34.19
2	1170回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/7/22	8.55
3	ISHARES GOLD TRUST	投資信託受益証券	アメリカ	-	-	5.09

## 株価指数先物取引 組入銘柄

資産の名称	買建/売建	比率(%)
TOPIX 先物 0609月	買建	4.81
S&P500 EMINI FUT Sep24	買建	3.82
MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	3.74
DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	3.64
SPI 200 FUTURES Sep24	買建	3.55
FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	2.86
S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	2.64

## 債券先物取引 組入銘柄

資産の名称	買建/売建	比率(%)
US 10YR NOTE FUT Sep24	買建	21.26
長国 先物 0609月	買建	12.22
EURO-BUND FUTURE Sep24	買建	11.68
AUST 10Y BOND FUT Sep24	買建	10.31
LONG GILT FUTURE Sep24	買建	6.82
CAN 10YR BOND FUT Sep24	買建	3.63

## ■ターゲットリスク・バランス・マザーファンドIII

※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。

## 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	1231回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2025/5/20	14.63
2	1170回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/7/22	9.76
3	ISHARES GOLD TRUST	投資信託受益証券	アメリカ	-	-	9.07
4	1202回 国庫短期証券	国債証券	日本	-	2024/12/20	6.10
5	SPDR GOLD SHARES ETF	投資信託受益証券	アメリカ	-	-	0.85

## 株価指数先物取引 組入銘柄

資産の名称	買建/売建	比率(%)
TOPIX 先物 0609月	買建	10.29
SPI 200 FUTURES Sep24	買建	7.59
MINI MSCI EMG MKT Sep24	買建	7.47
DJ EURO STOXX 50 Sep24	買建	7.27
S&P500 EMINI FUT Sep24	買建	5.45
FTSE 100 INDEX FUTURE Sep24	買建	4.08
S&P/TSE 60 IX FUT Sep24	買建	3.77

## 債券先物取引 組入銘柄

資産の名称	買建/売建	比率(%)
US 10YR NOTE FUT Sep24	買建	43.34
EURO-BUND FUTURE Sep24	買建	22.21
AUST 10Y BOND FUT Sep24	買建	22.07
長国 先物 0609月	買建	17.43
LONG GILT FUTURE Sep24	買建	14.60
CAN 10YR BOND FUT Sep24	買建	6.90

○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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）にお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

ただし、取得またはスイッチングの申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、法兰克福証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を中止することおよびすでに受付けた取得のお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、委託会社または販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

#### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

#### ・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

#### ・ 払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、買付代金を販売会社に支払うものとなります。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時まで（2024年11月5日より午後3時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）に行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口

数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

なお、受益者が解約の請求をするときは、委託会社または販売会社に対し振替受益権をもって行うものとし、

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
上場先物取引等	計算日 における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	計算日 における金融商品取引所等の最終相場



公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額(売り気配相場を除きます。) ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額(1万口当たり)は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま  
 す。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694(受付時間:営業日の午前9時から午後5時まで)

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2021年12月29日(設定日)から原則として2031年12月12日までです。

下記(5)その他イ.償還規定の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させる  
 ことがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると  
 認めたとときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎月16日から翌月15日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当  
 日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ  
 り次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了  
 日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認  
 める場合、各ファンドにおいて信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、ま  
 たはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を  
 終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする  
 旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行  
 います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事

項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下「信託約款の変更等c.において同じ。’)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

## 八. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

また、マザーファンドの投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)の間の当該契約は、原則として期間満了の90日前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、マザーファンドの信託終了まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 二. 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <https://www.am-one.co.jp/>)

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

#### ホ.運用報告書

- ・委託会社は、毎年6月15日、12月15日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。  
(URL <https://www.am-one.co.jp/>)

## 4【受益者の権利等】

### (1)収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### (2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

### (3)一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

### (4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。



### 第3【ファンドの経理状況】

みらいのサイフ(エントリーコース)

みらいのサイフ(ベーシックコース)

みらいのサイフ(アドバンスコース)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2023年12月16日から2024年6月17日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【みらいのサイフ(エントリーコース)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,625,250	11,684,129
親投資信託受益証券	1,100,918,935	1,096,250,846
流動資産合計	1,113,544,185	1,107,934,975
資産合計	1,113,544,185	1,107,934,975
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	29,653	32,859
未払委託者報酬	850,354	942,244
その他未払費用	3,505	3,883
流動負債合計	883,512	978,986
負債合計	883,512	978,986
純資産の部		
元本等		
元本	1,212,388,754	1,192,127,390
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	99,728,081	85,171,401
(分配準備積立金)	1,617,311	2,887,777
元本等合計	1,112,660,673	1,106,955,989
純資産合計	1,112,660,673	1,106,955,989
負債純資産合計	1,113,544,185	1,107,934,975

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	当期 自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
<b>営業収益</b>		
受取利息	82	1,952
有価証券売買等損益	4,281,972	18,331,911
<b>営業収益合計</b>	<b>4,282,054</b>	<b>18,333,863</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,639	302
受託者報酬	180,567	184,594
委託者報酬	5,177,551	5,293,147
その他費用	21,344	21,823
<b>営業費用合計</b>	<b>5,382,101</b>	<b>5,499,866</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>1,100,047</b>	<b>12,833,997</b>
経常利益又は経常損失( )	1,100,047	12,833,997
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>1,100,047</b>	<b>12,833,997</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	22,850	14,822
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>99,154,807</b>	<b>99,728,081</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,579,959	2,371,923
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,579,959	2,371,923
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,030,336	664,062
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,030,336	664,062
分配金	-	-
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>99,728,081</b>	<b>85,171,401</b>



## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2023年12月16日	至 2024年6月17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。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月15日及び12月15日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を2024年6月17日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2023年12月15日現在	2024年6月17日現在
1. 期首元本額	1,219,230,323円	1,212,388,754円
期中追加設定元本額	10,708,457円	8,399,156円
期中一部解約元本額	17,550,026円	28,660,520円
2. 受益権の総数	1,212,388,754口	1,192,127,390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99,728,081円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は85,171,401円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 分配金の計算過程	(自2023年6月16日 至2023年7月18日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(16,244円)及び分配準備積立金(933,269円)より分配対象収益は949,513円(1万口当たり7.78円)ですが、分配を行っておりません。	(自2023年12月16日 至2024年1月15日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(287,725円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(28,505円)及び分配準備積立金(1,616,992円)より分配対象収益は1,933,222円(1万口当たり15.92円)ですが、分配を行っておりません。

<p>(自2023年7月19日 至2023年8月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(17,875円)及び分配準備積立金(925,089円)より分配対象収益は942,964円(1万口当たり7.78円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年1月16日 至2024年2月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(31,015円)及び分配準備積立金(1,891,991円)より分配対象収益は1,923,006円(1万口当たり15.93円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(自2023年8月16日 至2023年9月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(202,676円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(19,584円)及び分配準備積立金(922,647円)より分配対象収益は1,144,907円(1万口当たり9.46円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年2月16日 至2024年3月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(296,646円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(33,221円)及び分配準備積立金(1,863,597円)より分配対象収益は2,193,464円(1万口当たり18.42円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(自2023年9月16日 至2023年10月16日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(21,610円)及び分配準備積立金(1,123,293円)より分配対象収益は1,144,903円(1万口当たり9.46円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年3月16日 至2024年4月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(318,239円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(36,126円)及び分配準備積立金(2,159,267円)より分配対象収益は2,513,632円(1万口当たり21.10円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(自2023年10月17日 至2023年11月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(242,841円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(23,675円)及び分配準備積立金(1,123,091円)より分配対象収益は1,389,607円(1万口当たり11.47円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年4月16日 至2024年5月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(140,440円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(39,417円)及び分配準備積立金(2,477,014円)より分配対象収益は2,656,871円(1万口当たり22.28円)であります。分配を行っておりません。</p>

	(自2023年11月16日 至2023年12月15日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(251,502円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(26,023円)及び分配準備積立金(1,365,809円)より分配対象収益は1,643,334円(1万口当たり13.55円)であります。分配を行っておりません。	(自2024年5月16日 至2024年6月17日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(273,440円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(42,510円)及び分配準備積立金(2,614,337円)より分配対象収益は2,930,287円(1万口当たり24.58円)であります。分配を行っておりません。
--	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	2023年12月15日現在	2024年6月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載していません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	22,724,851	4,726,710
合計	22,724,851	4,726,710

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9177円 (9,177円)	0.9286円 (9,286円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年6月17日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド	1,152,856,080	1,096,250,846	

親投資信託受益証券 合計	1,152,856,080	1,096,250,846	
合計		1,096,250,846	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【みらいのサイフ(ベーシックコース)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	13,096,310	12,491,534
親投資信託受益証券	1,208,533,533	1,172,071,394
流動資産合計	1,221,629,843	1,184,562,928
資産合計	1,221,629,843	1,184,562,928
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	290,927	-
未払受託者報酬	32,541	35,251
未払委託者報酬	1,258,451	1,363,589
その他未払費用	3,848	4,164
流動負債合計	1,585,767	1,403,004
負債合計	1,585,767	1,403,004
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,349,649,759	1,291,102,253
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	129,605,683	107,942,329
(分配準備積立金)	1,786,796	3,087,528
元本等合計	1,220,044,076	1,183,159,924
純資産合計	1,220,044,076	1,183,159,924
負債純資産合計	1,221,629,843	1,184,562,928

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	当期 自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
<b>営業収益</b>		
受取利息	104	1,949
有価証券売買等損益	610,555	24,517,861
<b>営業収益合計</b>	<b>610,659</b>	<b>24,519,810</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,220	304
受託者報酬	200,324	200,942
委託者報酬	7,747,644	7,771,897
その他費用	23,696	23,751
<b>営業費用合計</b>	<b>7,974,884</b>	<b>7,996,894</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>7,364,225</b>	<b>16,522,916</b>
経常利益又は経常損失( )	7,364,225	16,522,916
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>7,364,225</b>	<b>16,522,916</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	142,086	158,046
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>124,750,886</b>	<b>129,605,683</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,138,220	6,857,837
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,138,220	6,857,837
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>2,770,878</b>	<b>1,559,353</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,770,878	1,559,353
分配金	-	-
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>129,605,683</b>	<b>107,942,329</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期	
	自 2023年12月16日	至 2024年6月17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。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月15日及び12月15日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を2024年6月17日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	2023年12月15日現在	2024年6月17日現在
1. 期首元本額	1,369,647,286円	1,349,649,759円
期中追加設定元本額	25,543,589円	16,973,683円
期中一部解約元本額	45,541,116円	75,521,189円
2. 受益権の総数	1,349,649,759口	1,291,102,253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129,605,683円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は107,942,329円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 分配金の計算過程	(自2023年6月16日 至2023年7月18日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(35,551円)及び分配準備積立金(1,086,259円)より分配対象収益は1,121,810円(1万口当たり8.18円)であります。分配を行っておりません。	(自2023年12月16日 至2024年1月15日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(309,102円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(61,804円)及び分配準備積立金(1,784,177円)より分配対象収益は2,155,083円(1万口当たり15.95円)であります。分配を行っておりません。



(自2023年7月19日 至2023年8月15日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(40,236円)及び分配準備積立金(1,077,661円)より分配対象収益は1,117,897円(1万口当たり8.19円)であります。分配を行っておりません。

(自2023年8月16日 至2023年9月15日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(221,043円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(44,611円)及び分配準備積立金(1,076,591円)より分配対象収益は1,342,245円(1万口当たり9.81円)であります。分配を行っておりません。

(自2023年9月16日 至2023年10月16日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(49,740円)及び分配準備積立金(1,294,384円)より分配対象収益は1,344,124円(1万口当たり9.81円)であります。分配を行っておりません。

(自2023年10月17日 至2023年11月15日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(253,941円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(52,794円)及び分配準備積立金(1,274,201円)より分配対象収益は1,580,936円(1万口当たり11.70円)であります。分配を行っておりません。

(自2024年1月16日 至2024年2月15日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(68,035円)及び分配準備積立金(2,058,175円)より分配対象収益は2,126,210円(1万口当たり15.95円)であります。分配を行っておりません。

(自2024年2月16日 至2024年3月15日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(329,482円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(72,077円)及び分配準備積立金(2,042,504円)より分配対象収益は2,444,063円(1万口当たり18.44円)であります。分配を行っておりません。

(自2024年3月16日 至2024年4月15日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(342,413円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(75,605円)及び分配準備積立金(2,330,822円)より分配対象収益は2,748,840円(1万口当たり21.07円)であります。分配を行っておりません。

(自2024年4月16日 至2024年5月15日)  
計算期間末における費用控除後の配当等収益(244,176円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(80,381円)及び分配準備積立金(2,650,920円)より分配対象収益は2,975,477円(1万口当たり22.96円)であります。分配を行っておりません。

	(自2023年11月16日 至2023年12月15日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(264,057円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(56,841円)及び分配準備積立金(1,522,739円)より分配対象収益は1,843,637円(1万口当たり13.66円)であります、分配を行っておりません。	(自2024年5月16日 至2024年6月17日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(207,535円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(85,433円)及び分配準備積立金(2,879,993円)より分配対象収益は3,172,961円(1万口当たり24.57円)であります、分配を行っておりません。
--	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	2023年12月15日現在	2024年6月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載していません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	28,163,042	2,973,227
合計	28,163,042	2,973,227

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9040円 (9,040円)	0.9164円 (9,164円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年6月17日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド	1,238,845,148	1,172,071,394	

親投資信託受益証券 合計	1,238,845,148	1,172,071,394	
合計		1,172,071,394	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【みらいのサイフ(アドバンスコース)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,356,925	8,306,775
親投資信託受益証券	861,050,636	829,547,240
未収入金	2,730,000	1,720,000
流動資産合計	872,137,561	839,574,015
資産合計	872,137,561	839,574,015
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,774,547	967,417
未払受託者報酬	22,930	24,866
未払委託者報酬	886,982	961,880
その他未払費用	2,708	2,933
流動負債合計	2,687,167	1,957,096
負債合計	2,687,167	1,957,096
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,038,888,236	973,441,410
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	169,437,842	135,824,491
(分配準備積立金)	2,994,330	5,498,413
元本等合計	869,450,394	837,616,919
純資産合計	869,450,394	837,616,919
負債純資産合計	872,137,561	839,574,015

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自	2023年6月16日 至 2023年12月15日	自	2023年12月16日 至 2024年6月17日
<b>営業収益</b>				
受取利息		76		1,267
有価証券売買等損益		2,925,890		29,696,604
<b>営業収益合計</b>		<b>2,925,966</b>		<b>29,697,871</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,226		197
受託者報酬		145,277		141,506
委託者報酬		5,619,140		5,473,179
その他費用		17,144		16,705
<b>営業費用合計</b>		<b>5,783,787</b>		<b>5,631,587</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>		<b>2,857,821</b>		<b>24,066,284</b>
経常利益又は経常損失( )		2,857,821		24,066,284
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>		<b>2,857,821</b>		<b>24,066,284</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		114,723		1,077,060
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>		<b>181,917,389</b>		<b>169,437,842</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		19,745,341		13,615,392
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		19,745,341		13,615,392
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>4,522,696</b>		<b>2,991,265</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,522,696		2,991,265
分配金		-		-
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>169,437,842</b>		<b>135,824,491</b>

## （３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	当期	
	自 2023年12月16日	至 2024年6月17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。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月15日及び12月15日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当特定期間末日を2024年6月17日としております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期	当期
	2023年12月15日現在	2024年6月17日現在
1. 期首元本額	1,111,429,103円	1,038,888,236円
期中追加設定元本額	23,502,300円	18,945,575円
期中一部解約元本額	96,043,167円	84,392,401円
2. 受益権の総数	1,038,888,236口	973,441,410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169,437,842円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は135,824,491円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期	当期
	自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 分配金の計算過程	（自2023年6月16日 至2023年7月18日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（52,591円）及び分配準備積立金（1,821,466円）より分配対象収益は1,874,057円（1万口当たり16.88円）であります。分配を行っておりません。	（自2023年12月16日 至2024年1月15日） 計算期間末における費用控除後の配当等収益（580,533円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（99,418円）及び分配準備積立金（2,930,380円）より分配対象収益は3,610,331円（1万口当たり35.41円）であります。分配を行っておりません。

<p>(自2023年7月19日 至2023年8月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(60,184円)及び分配準備積立金(1,806,395円)より分配対象収益は1,866,579円(1万口当たり16.89円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年1月16日 至2024年2月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(132,659円)及び分配準備積立金(3,489,498円)より分配対象収益は3,622,157円(1万口当たり35.46円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(自2023年8月16日 至2023年9月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(439,792円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(67,934円)及び分配準備積立金(1,795,523円)より分配対象収益は2,303,249円(1万口当たり20.89円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年2月16日 至2024年3月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(590,711円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(136,476円)及び分配準備積立金(3,373,340円)より分配対象収益は4,100,527円(1万口当たり41.44円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(自2023年9月16日 至2023年10月16日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(77,335円)及び分配準備積立金(2,227,310円)より分配対象収益は2,304,645円(1万口当たり20.90円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年3月16日 至2024年4月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(624,797円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(143,849円)及び分配準備積立金(3,910,112円)より分配対象収益は4,678,758円(1万口当たり47.84円)であります。分配を行っておりません。</p>
<p>(自2023年10月17日 至2023年11月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(450,901円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(83,232円)及び分配準備積立金(2,117,495円)より分配対象収益は2,651,628円(1万口当たり25.20円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>(自2024年4月16日 至2024年5月15日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(502,580円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(154,170円)及び分配準備積立金(4,528,276円)より分配対象収益は5,185,026円(1万口当たり52.98円)であります。分配を行っておりません。</p>



	(自2023年11月16日 至2023年12月15日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(466,493円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(91,983円)及び分配準備積立金(2,527,837円)より分配対象収益は3,086,313円(1万口当たり29.70円)ですが、分配を行っておりません。	(自2024年5月16日 至2024年6月17日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(503,428円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(164,204円)及び分配準備積立金(4,994,985円)より分配対象収益は5,662,617円(1万口当たり58.17円)ですが、分配を行っておりません。
--	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前期	当期
	自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期	当期
	2023年12月15日現在	2024年6月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載していません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	40,873,291	4,765,900
合計	40,873,291	4,765,900

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
1口当たり純資産額	0.8369円	0.8605円
(1万口当たり純資産額)	(8,369円)	(8,605円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年6月17日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ターゲットリスク・バランス・マザーファンド	934,490,527	829,547,240	

親投資信託受益証券 合計	934,490,527	829,547,240	
合計		829,547,240	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「みらいのサイフ(エントリーコース)」、「みらいのサイフ(ベーシックコース)」、「みらいのサイフ(アドバンスコース)」は、「ターゲットリスク・バランス・マザーファンド」受益証券、「ターゲットリスク・バランス・マザーファンド」受益証券及び「ターゲットリスク・バランス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同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。

ターゲットリスク・バランス・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年6月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,823,718
コール・ローン	483,301,485
国債証券	459,835,400
投資信託受益証券	54,162,594
派生商品評価勘定	12,671,050
差入委託証拠金	83,974,592
流動資産合計	1,099,768,839
資産合計	1,099,768,839
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,065,938
前受金	505,000
流動負債合計	3,570,938
負債合計	3,570,938
純資産の部	
元本等	
元本	1,152,856,080
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	56,658,179
元本等合計	1,096,197,901
純資産合計	1,096,197,901
負債純資産合計	1,099,768,839

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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 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 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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年6月17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	1,177,453,407円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	24,597,327円
元本の内訳	
ファンド名	
みらいのサイフ（エントリーコース）	1,152,856,080円
計	1,152,856,080円
2. 受益権の総数	1,152,856,080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56,658,179円であります。

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
----	-------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引、債券先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価、市場金利及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年6月17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等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	395,200
投資信託受益証券	6,645,806
合計	6,250,606

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	86,485,180	-	-	86,972,663	487,483
アメリカ・ドル	29,487,340	-	-	29,841,369	354,029
イギリス・ポンド	15,331,173	-	-	15,391,981	60,808
オーストラリア・ドル	14,266,348	-	-	14,322,699	56,351
カナダ・ドル	13,285,808	-	-	13,381,978	96,170
ユーロ	14,114,511	-	-	14,034,636	79,875
合計	86,485,180	-	-	86,972,663	487,483

（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	2024年6月17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	184,951,995	-	-	185,760,588	808,593
合計	184,951,995	-	-	185,760,588	808,593

（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。

## 債券関連

種類	2024年6月17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 先物取引 買建	715,196,020	-	724,480,902	9,284,882
合計	715,196,020	-	724,480,902	9,284,882

(注) 時価の算定方法

債券先物取引

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年6月17日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9509円 (9,509円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年6月17日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	1170回 国庫短期証券	60,000,000	59,999,400	
		1202回 国庫短期証券	400,000,000	399,836,000	
	日本円 小計		460,000,000	459,835,400	
国債証券 合計			460,000,000	459,835,400	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES GOLD TRUST	7,800.000	343,824.000	
	アメリカ・ドル 小計		7,800.000	343,824.000	
投資信託受益証券 合計			7,800	54,162,594	
合計				513,997,994	
				(54,162,594)	

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

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳



通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	4.94	10.54

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(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。

ターゲットリスク・バランス・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年6月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,822,240
コール・ローン	495,300,207
国債証券	499,835,000
投資信託受益証券	58,328,948
派生商品評価勘定	13,293,052
差入委託証拠金	103,249,568
流動資産合計	1,176,829,015
資産合計	1,176,829,015
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,778,265
前受金	30,000
流動負債合計	4,808,265
負債合計	4,808,265
純資産の部	
元本等	
元本	1,238,845,148
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	66,824,398
元本等合計	1,172,020,750
純資産合計	1,172,020,750
負債純資産合計	1,176,829,015

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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 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 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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年6月17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	1,303,844,572円
同期中追加設定元本額	- 円
同期中一部解約元本額	64,999,424円
元本の内訳	
ファンド名	
みらいのサイフ（ベーシックコース）	1,238,845,148円
計	1,238,845,148円
2. 受益権の総数	1,238,845,148口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は66,824,398円であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
----	-------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引、債券先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価、市場金利及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年6月17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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	416,000
投資信託受益証券	7,093,970
合計	6,677,970

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	105,244,308	-	-	105,780,106	535,798
アメリカ・ドル	33,633,998	-	-	34,037,812	403,814
イギリス・ポンド	18,279,475	-	-	18,351,978	72,503
オーストラリア・ドル	20,219,213	-	-	20,299,077	79,864
カナダ・ドル	12,948,034	-	-	13,041,759	93,725
ユーロ	20,163,588	-	-	20,049,480	114,108
合計	105,244,308	-	-	105,780,106	535,798

(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	2024年6月17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	283,245,214	-	-	282,414,175	831,039
合計	283,245,214	-	-	282,414,175	831,039

(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。

## 債券関連

種類	2024年6月17日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	754,500,206	-	764,383,040	9,882,834
合計	754,500,206	-	764,383,040	9,882,834

(注) 時価の算定方法

債券先物取引

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年6月17日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9461円 (9,461円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年6月17日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	1170回 国庫短期証券	100,000,000	99,999,000	
		1202回 国庫短期証券	400,000,000	399,836,000	
	日本円 小計		500,000,000	499,835,000	
国債証券 合計			500,000,000	499,835,000	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES GOLD TRUST	8,400.000	370,272.000	
	アメリカ・ドル 小計		8,400.000	370,272.000	
投資信託受益証券 合計			8,400	58,328,948	(58,328,948)
合計				558,163,948	(58,328,948)

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	4.98	10.45

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(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。

ターゲットリスク・バランス・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2024年6月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,603,118
コール・ローン	336,818,698
国債証券	249,801,100
投資信託受益証券	79,707,974
派生商品評価勘定	17,778,774
前払金	445,000
差入委託証拠金	146,950,667
流動資産合計	838,105,331
資産合計	838,105,331
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,871,118
未払解約金	1,720,000
流動負債合計	8,591,118
負債合計	8,591,118
純資産の部	
元本等	
元本	934,490,527
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	104,976,314
元本等合計	829,514,213
純資産合計	829,514,213
負債純資産合計	838,105,331



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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 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 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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年6月17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	1,004,257,799円
同期中追加設定元本額	5,661,697円
同期中一部解約元本額	75,428,969円
元本の内訳	
ファンド名	
みらいのサイフ（アドバンスコース）	934,490,527円
計	934,490,527円
2. 受益権の総数	934,490,527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104,976,314円であります。

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月16日 至 2024年6月17日
----	-------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引、債券先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価、市場金利及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年6月17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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	45,892
投資信託受益証券	9,588,293
合計	9,542,401

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	149,346,292	-	-	150,148,932	802,640
アメリカ・ドル	52,677,905	-	-	53,310,363	632,458
イギリス・ポンド	26,338,169	-	-	26,442,635	104,466
オーストラリア・ドル	27,403,705	-	-	27,511,947	108,242
カナダ・ドル	15,537,640	-	-	15,650,110	112,470
ユーロ	27,388,873	-	-	27,233,877	154,996
合計	149,346,292	-	-	150,148,932	802,640

(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	2024年6月17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	364,526,478	-	-	362,757,368	1,769,110
合計	364,526,478	-	-	362,757,368	1,769,110

(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。

## 債券関連

種類	2024年6月17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 先物取引 買建	1,014,134,172	-	1,027,615,118	13,480,946
合計	1,014,134,172	-	1,027,615,118	13,480,946

（注）時価の算定方法

債券先物取引

- 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はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年6月17日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8877円 (8,877円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年6月17日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	1 1 7 0 回 国庫短期証券	80,000,000	79,999,200	
		1 2 0 2 回 国庫短期証券	50,000,000	49,979,500	
		1 2 3 1 回 国庫短期証券	120,000,000	119,822,400	
	日本円 小計		250,000,000	249,801,100	
国債証券 合計			250,000,000	249,801,100	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES GOLD TRUST	10,500.000	462,840.000	
		SPDR GOLD SHARES ETF	200.000	43,146.000	
	アメリカ・ドル 小計		10,700.000	505,986.000 (79,707,974)	
投資信託受益証券 合計			10,700	79,707,974 (79,707,974)	
合計				329,509,074 (79,707,974)	

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

（注）

- 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	9.61	24.19

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## みらいのサイフ(エントリーコース)

2024年6月28日現在

資産総額	1,103,059,489円
負債総額	327,684円
純資産総額( - )	1,102,731,805円
発行済数量	1,192,152,194口
1口当たり純資産額( / )	0.9250円

## みらいのサイフ(ベーシックコース)

2024年6月28日現在

資産総額	1,180,482,290円
負債総額	468,219円
純資産総額( - )	1,180,014,071円
発行済数量	1,291,155,217口
1口当たり純資産額( / )	0.9139円

## みらいのサイフ(アドバンスコース)

2024年6月28日現在

資産総額	829,904,345円
負債総額	2,932,261円
純資産総額( - )	826,972,084円
発行済数量	965,651,028口
1口当たり純資産額( / )	0.8564円

(参考)

## ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	1,097,142,241円
負債総額	4,863,942円
純資産総額( - )	1,092,278,299円
発行済数量	1,152,856,080口
1口当たり純資産額( / )	0.9475円

## ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	1,174,886,193円
負債総額	5,493,210円
純資産総額( - )	1,169,392,983円
発行済数量	1,238,845,148口
1口当たり純資産額( / )	0.9439円

## ターゲットリスク・バランス・マザーファンド

2024年6月28日現在

資産総額	829,291,222円
負債総額	9,786,754円
純資産総額( - )	819,504,468円
発行済数量	927,275,904口
1口当たり純資産額( / )	0.8838円



## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

### (6)受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて



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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2024年6月28日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2024年6月28日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

##### 1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書

を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年6月28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	1,533,911,061,012
追加型株式投資信託	766	17,232,840,003,341
単位型公社債投資信託	21	32,630,984,099
単位型株式投資信託	197	1,068,820,876,122
合計	1,010	19,868,202,924,574

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第39期事業年度(自2023年4月1日至2024年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 百万円 )

	第38期 ( 2023年3月31日現在 )	第39期 ( 2024年3月31日現在 )
( 資産の部 )		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,127	1,093
建物	1 1,001	1 918
器具備品	1 118	1 130
リース資産	1 7	1 5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産		
ソフトウェア	5,021	4,495
ソフトウェア仮勘定	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産		
投資有価証券	9,768	8,935
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位:百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：百万円 ）

	第38期 （ 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日 ）		第39期 （ 自 2023年4月1日 至 2024年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	95,739		102,113	
運用受託報酬	16,150		17,155	
投資助言報酬	2,048		2,211	
その他営業収益	23		26	
営業収益計		113,962		121,507
営業費用				
支払手数料	41,073		44,366	
広告宣伝費	216		329	
公告費	0		0	
調査費	33,177		35,468	
調査費	12,294		13,277	
委託調査費	20,882		22,190	
委託計算費	548		558	
営業雑経費	733		823	
通信費	36		36	
印刷費	504		598	
協会費	69		65	
諸会費	29		44	
支払販売手数料	92		78	
営業費用計		75,749		81,545
一般管理費				
給料	10,484		10,763	
役員報酬	168		164	
給料・手当	9,199		9,425	
賞与	1,115		1,173	
交際費	17		34	
寄付金	11		15	
旅費交通費	128		162	
租税公課	330		489	
不動産賃借料	1,006		1,030	
退職給付費用	437		412	
固定資産減価償却費	1,388		1,567	
福利厚生費	47		46	
修繕費	1		1	
賞与引当金繰入額	1,730		1,927	
役員賞与引当金繰入額	48		52	
機器リース料	0		0	
事務委託費	4,074		3,379	
事務用消耗品費	37		46	
器具備品費	1		3	
諸経費	334		240	
一般管理費計		20,078		20,172
営業利益		18,135		19,788

(単位:百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		10		4
受取配当金	1	2,400	1	899
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		10		18
時効後支払損引当金戻入額		24		35
営業外収益計		2,446		959
営業外費用				
為替差損		3		19
金銭の信託運用損		1,003		1,008
早期割増退職金		24		6
雑損失		47		0
営業外費用計		1,079		1,034
経常利益		19,502		19,712
特別利益				
投資有価証券売却益		4		-
特別利益計		4		-
特別損失				
固定資産除却損		12		6
投資有価証券売却損		9		-
関係会社株式評価損		584		1,362
減損損失		-	2	231
特別損失計		606		1,601
税引前当期純利益		18,900		18,111
法人税、住民税及び事業税		4,881		5,769
法人税等調整額		197		510
法人税等合計		5,078		5,258
当期純利益		13,821		12,852



## (3) 【株主資本等変動計算書】

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

	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	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							12,360	12,360	12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	0	0	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			12,360
当期純利益			13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	1,461
当期末残高	0	0	79,034

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

	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	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							11,040	11,040	11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	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	0	0	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			11,040
当期純利益			12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	1,812
当期末残高	0	0	80,846

## 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 市場価格のない株式等以外のもの 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) 市場価格のない株式等 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(リース資産を除く) 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。 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(リース資産を除く) 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> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする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 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 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 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の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 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. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬</p> <p>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2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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</p> <p>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回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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</p> <p>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2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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</p> <p>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>
----------------	---

**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

（百万円）

	第38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
建物	523	630
器具備品	934	769
リース資産	1	3

## （損益計算書関係）

## 1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（百万円）

	第38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）
受取配当金	2,393	895

## 2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

当社は、キャッシュ・フローを生み出す最小単位として、主として事業別に資産をグルーピングしております。当社の資産運用業に係るソフトウェア開発計画の大幅な延期に伴い、当該計画に係るソフトウェア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

## （株主資本等変動計算書関係）

## 第38期（自 2022年4月1日 至 2023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 （百万円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17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 (百万円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生(予定)日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

## 第39期（自 2023年4月1日 至 2024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 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19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

2024年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生(予定)日
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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。

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。

## 第38期(2023年3月31日現在)

	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	29,184	29,184	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,186	29,186	-

## 第39期(2024年3月31日現在)

	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	28,143	28,143	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,145	28,145	-

(注1) 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。

(注2) 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38期(2023年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	33,770	-	-	-
(2) 金銭の信託	29,184	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,279	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,307	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	82,540	1	-	-

## 第39期(2024年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	41,183	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,143	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	19,018	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,577	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	91,923	1	-	-



3. 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。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第38期(2023年3月31日現在)

区分	時価(百万円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	29,184	-	29,184
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

第39期(2024年3月31日現在)

区分	時価(百万円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	28,143	-	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,145	-	28,145

(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(預金・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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

(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、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の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。

(百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
投資有価証券(其他有価証券)		
非上場株式	180	182
関係会社株式		
非上場株式	5,810	4,447

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(第38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

## 2. その他有価証券

第38期(2023年3月31日現在)

(百万円)

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 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 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額180百万円)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。

第39期(2024年3月31日現在)

(百万円)

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 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 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額182百万円)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。

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について584百万円(関係会社株式584百万円)減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について1,362百万円(関係会社株式1,362百万円)減損処理を行っております。

(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

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	191	246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

(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

(百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	44	40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	22	13
過去勤務費用の費用処理額	34	0
その他	4	4
確定給付制度に係る退職給付費用	334	307

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において24百万円、当事業年度において6百万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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.56%	1.00% ~ 3.56%

## 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103百万円、当事業年度104百万円であります。

## (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38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	121	195
未払事業所税	9	9
賞与引当金	529	590
未払法定福利費	94	98
運用受託報酬	390	351
資産除去債務	15	17
減価償却超過額(一括償却資産)	21	12
減価償却超過額	198	91
繰延資産償却超過額(税法上)	297	331
退職給付引当金	812	832
時効後支払損引当金	33	22
ゴルフ会員権評価損	7	6
関係会社株式評価損	345	761
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	-	70
その他	13	8
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	2,895	3,406
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,895	3,406

## 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

	第38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	30.62 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.69 %	1.44 %
その他	0.06 %	0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

## (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	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

## (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

## (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。

## (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

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	68,921百万円	60,761百万円
資産合計	68,921百万円	60,761百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	3,643百万円	1,957百万円
負債合計	3,643百万円	1,957百万円
純資産	65,278百万円	58,804百万円

(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	51,451百万円	47,640百万円
顧客関連資産	20,947百万円	17,109百万円

## (2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,039百万円	7,649百万円
経常利益	8,039百万円	7,649百万円
税引前当期純利益	8,039百万円	7,649百万円
当期純利益	6,744百万円	6,474百万円
1株当たり当期純利益	168,617円97銭	161,850円28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	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,228百万円	3,837百万円



（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。

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
委託者報酬	95,739百万円	102,113百万円
運用受託報酬	14,651百万円	15,156百万円
投資助言報酬	2,048百万円	2,211百万円
成功報酬（注）	1,499百万円	1,999百万円
その他営業収益	23百万円	26百万円
<b>合計</b>	<b>113,962百万円</b>	<b>121,507百万円</b>

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託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. 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）

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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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。

（持分法損益等）

当社はPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	7,474	未払 手数料	1,579
	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	13,932	未払 手数料	2,404

## 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。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	8,140	未払 手数料	1,870
	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	16,655	未払 手数料	3,137

## 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
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当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
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	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2024年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行（ 1）	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。

（注）資本金の額は2024年3月末日現在

（ 1）「みらいのサイフ（ベーシックコース）」の新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。なお、「みらいのサイフ（エントリーコース）」、「みらいのサイフ（アドバンスコース）」の取扱いはありません。

#### (3) 投資顧問会社

名称	Asset Management One USA Inc.
資本金の額	400万米ドル（2023年12月末日現在）
事業の内容	米国において投資顧問業務を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、マザーファンドの信託財産の運用の助言を行います。

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2024年1月4日	臨時報告書
2024年3月15日	有価証券報告書
2024年3月15日	有価証券届出書
2024年4月1日	臨時報告書

## 独立監査人の監査報告書

2024年5月23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 森 重 俊 寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長 谷 川 敬指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲 葉 宏 和

## 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2023年4月1日から2024年3月31日までの第39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2024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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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) 上記の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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の監査報告書

2024年8月15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

## 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」に掲げられているみらいのサイフ(エントリーコース)の2023年12月16日から2024年6月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、みらいのサイフ(エントリーコース)の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書(訂正有価証券届出書を含む。)に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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。

## 独立監査人の監査報告書

2024年8月15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

## 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」に掲げられているみらいのサイフ(ベーシックコース)の2023年12月16日から2024年6月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、みらいのサイフ(ベーシックコース)の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書(訂正有価証券届出書を含む。)に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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。

## 独立監査人の監査報告書

2024年8月15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

## 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」に掲げられているみらいのサイフ（アドバンスコース）の2023年12月16日から2024年6月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、みらいのサイフ（アドバンスコース）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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。