

**【表紙】**

**【提出書類】** 半期報告書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成30年10月11日

**【計算期間】** 第12期中（自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日）

**【ファンド名】** マネックス資産設計ファンド<育成型>

**【発行者名】** アセットマネジメントOne株式会社

**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 菅野 暁

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

**【事務連絡者氏名】** 三木谷 正直

**【連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

**【電話番号】** 03-6774-5100

**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 1【ファンドの運用状況】

### (1)【投資状況】

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	11,266,710,974	98.71
内 日本	11,266,710,974	98.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	147,347,757	1.29
純資産総額	11,414,058,731	100.00

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

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

(参考)

#### 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	290,442,666,020	96.36
内 日本	290,442,666,020	96.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,963,109,662	3.64
純資産総額	301,405,775,682	100.00

#### その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	10,767,680,000	3.57
内 日本	10,767,680,000	3.57

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

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	284,473,597,300	82.87
内 日本	284,473,597,300	82.87
地方債証券	22,407,273,145	6.53
内 日本	22,407,273,145	6.53
特殊債券	16,808,892,217	4.90
内 日本	16,808,892,217	4.90
社債券	15,482,006,470	4.51
内 日本	15,281,148,470	4.45
内 オランダ	200,858,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,100,823,474	1.19
純資産総額	343,272,592,606	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。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	36,703,968,650	97.90
内 日本	36,703,968,650	97.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	788,977,385	2.10
純資産総額	37,492,946,035	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	617,058,000	1.65
内 日本	617,058,000	1.65

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	302,012,547,573	95.38
内 アメリカ	191,517,411,682	60.48
内 イギリス	20,142,770,666	6.36
内 フランス	11,960,117,691	3.78
内 カナダ	11,740,119,075	3.71
内 ドイツ	11,716,700,729	3.70
内 スイス	10,733,398,636	3.39
内 オーストラリア	7,609,895,896	2.40
内 オランダ	5,997,575,826	1.89
内 アイルランド	4,492,778,951	1.42

内	スペイン	3,728,316,042	1.18
内	スウェーデン	3,154,966,969	1.00
内	香港	2,939,024,255	0.93
内	イタリア	2,371,642,425	0.75
内	デンマーク	2,087,550,692	0.66
内	ジャージー	1,589,400,324	0.50
内	シンガポール	1,429,354,300	0.45
内	バミューダ	1,418,762,002	0.45
内	ベルギー	1,299,944,397	0.41
内	フィンランド	1,238,398,426	0.39
内	ノルウェー	890,319,699	0.28
内	ケイマン諸島	779,153,406	0.25
内	オランダ領キュラソー	773,454,450	0.24
内	イスラエル	645,154,978	0.20
内	ルクセンブルグ	411,436,749	0.13
内	オーストリア	289,151,141	0.09
内	ニュージーランド	258,433,379	0.08
内	パナマ	206,776,182	0.07
内	ポルトガル	204,985,775	0.06
内	リベリア	151,516,637	0.05
内	イギリス領バージン諸島	89,160,063	0.03
内	パプアニューギニア	68,260,187	0.02
内	マン島	60,525,453	0.02
内	モーリシャス	16,090,490	0.01
投資信託受益証券		739,566,117	0.23
内	オーストラリア	600,869,665	0.19
内	シンガポール	138,696,452	0.04
投資証券		6,597,126,346	2.08
内	アメリカ	5,652,526,952	1.79
内	イギリス	273,393,121	0.09
内	オランダ	254,405,174	0.08
内	フランス	191,594,860	0.06
内	香港	179,749,447	0.06
内	カナダ	45,456,792	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,304,494,041	2.31
純資産総額		316,653,734,077	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	26,399,600	0.01
-	26,399,600	0.01
為替予約取引(売建)	68,685,380	0.02
-	68,685,380	0.02
株価指数先物取引(買建)	7,138,544,354	2.25
内 アメリカ	4,901,223,324	1.55
内 ドイツ	1,290,633,669	0.41
内 イギリス	489,943,814	0.15
内 カナダ	264,803,750	0.08
内 オーストラリア	191,939,797	0.06

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

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

(注3) 為替予約取引の時価は、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で評価しています。

(注4) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	207,679,997,437	97.38
内 アメリカ	92,172,535,401	43.22
内 フランス	22,104,893,376	10.36
内 イタリア	18,918,093,133	8.87
内 イギリス	14,298,363,571	6.70
内 ドイツ	14,158,597,967	6.64
内 スペイン	12,812,339,403	6.01
内 ベルギー	5,514,839,960	2.59
内 オーストラリア	4,458,911,593	2.09
内 オランダ	4,445,794,673	2.08
内 カナダ	3,937,518,609	1.85
内 オーストリア	3,448,650,513	1.62
内 メキシコ	1,803,144,008	0.85
内 アイルランド	1,701,305,946	0.80
内 ポーランド	1,333,839,251	0.63
内 フィンランド	1,275,829,721	0.60
内 デンマーク	1,265,411,646	0.59
内 南アフリカ	1,233,817,873	0.58
内 マレーシア	910,470,556	0.43
内 シンガポール	809,504,069	0.38
内 スウェーデン	692,326,470	0.32
内 ノルウェー	383,809,698	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,585,380,147	2.62
純資産総額	213,265,377,584	100.00

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	5,427,852,894	10.19
内 オーストラリア	3,630,924,227	6.82
内 シンガポール	1,777,204,940	3.34
内 カナダ	19,723,727	0.04
投資証券	47,561,505,903	89.31
内 アメリカ	37,801,547,393	70.99
内 イギリス	2,948,264,980	5.54
内 オランダ	1,626,983,727	3.06
内 フランス	1,292,668,999	2.43
内 香港	1,163,740,040	2.19
内 カナダ	950,326,775	1.78
内 スペイン	552,947,120	1.04
内 ベルギー	429,749,755	0.81
内 ニュージーランド	231,383,237	0.43
内 ドイツ	144,802,336	0.27
内 アイルランド	137,405,994	0.26
内 シンガポール	127,631,202	0.24
内 イタリア	60,576,424	0.11
内 ガーンジィ	36,317,125	0.07
内 イスラエル	30,115,308	0.06
内 マン島	27,045,488	0.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	263,167,870	0.49
純資産総額	53,252,526,667	100.00

その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	42,349,680	0.08
-	42,349,680	0.08
為替予約取引(売建)	22,200,000	0.04
-	22,200,000	0.04

(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) 為替予約取引の時価は、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で評価しています。

## (2) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成30年7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2計算期間末 (平成21年1月13日)	5,934	5,934	0.6383	0.6383
第3計算期間末 (平成22年1月12日)	7,473	7,473	0.7361	0.7361
第4計算期間末 (平成23年1月11日)	7,727	7,727	0.7224	0.7224
第5計算期間末 (平成24年1月11日)	7,492	7,492	0.6688	0.6688
第6計算期間末 (平成25年1月11日)	8,892	8,892	0.8003	0.8003
第7計算期間末 (平成26年1月14日)	9,193	9,193	0.9817	0.9817
第8計算期間末 (平成27年1月13日)	9,794	9,794	1.1261	1.1261
第9計算期間末 (平成28年1月12日)	10,062	10,062	1.0954	1.0954
第10計算期間末 (平成29年1月11日)	11,012	11,012	1.1844	1.1844
第11計算期間末 (平成30年1月11日)	11,528	11,528	1.3017	1.3017
平成29年7月末日	11,028	-	1.2112	-
8月末日	11,009	-	1.2112	-
9月末日	11,150	-	1.2387	-
10月末日	11,257	-	1.2619	-
11月末日	11,317	-	1.2725	-
12月末日	11,462	-	1.2902	-
平成30年1月末日	11,444	-	1.2906	-
2月末日	11,059	-	1.2533	-
3月末日	10,933	-	1.2328	-
4月末日	11,210	-	1.2617	-
5月末日	11,203	-	1.2577	-
6月末日	11,282	-	1.2631	-
7月末日	11,414	-	1.2792	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
平成30年1月12日～ 平成30年7月11日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第2計算期間	30.0
第3計算期間	15.3
第4計算期間	1.9
第5計算期間	7.4
第6計算期間	19.7
第7計算期間	22.7
第8計算期間	14.7
第9計算期間	2.7
第10計算期間	8.1
第11計算期間	9.9
平成30年1月12日～ 平成30年7月11日	2.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## 2【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第2計算期間	2,271,286,181	1,714,151,191
第3計算期間	1,780,961,356	925,938,640
第4計算期間	1,561,559,539	1,016,414,248
第5計算期間	1,553,939,256	1,049,226,063
第6計算期間	1,341,335,454	1,433,126,499
第7計算期間	1,753,311,968	3,498,697,249
第8計算期間	1,496,503,368	2,163,948,960
第9計算期間	1,823,323,622	1,334,995,256
第10計算期間	1,257,703,399	1,145,956,042
第11計算期間	1,031,255,707	1,472,513,113
平成30年1月12日～ 平成30年7月11日	468,305,879	387,228,476

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

### 3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成30年1月12日から平成30年7月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 中間財務諸表

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;育成型&gt;】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 平成30年1月11日現在	第12期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	217,117,373	238,531,080
親投資信託受益証券	11,431,424,578	11,191,520,149
流動資産合計	11,648,541,951	11,430,051,229
資産合計	11,648,541,951	11,430,051,229
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	61,836,443	8,070,338
未払受託者報酬	4,268,395	4,196,514
未払委託者報酬	53,660,033	52,756,388
その他未払費用	274,299	239,902
流動負債合計	120,039,170	65,263,142
負債合計	120,039,170	65,263,142
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 8,856,683,318	1 8,937,760,721
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,671,819,463	2,427,027,366
(分配準備積立金)	2,804,639,719	2,684,777,584
元本等合計	11,528,502,781	11,364,788,087
純資産合計	11,528,502,781	11,364,788,087
負債純資産合計	11,648,541,951	11,430,051,229

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期中間計算期間		第12期中間計算期間	
	自	平成29年1月12日 至 平成29年7月11日	自	平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
<b>営業収益</b>				
受取利息		16		-
有価証券売買等損益		332,682,637		210,617,429
その他収益		88,491		40,257
<b>営業収益合計</b>		<b>332,771,144</b>		<b>210,577,172</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		56,542		70,075
受託者報酬		4,084,490		4,196,514
委託者報酬		51,348,136		52,756,388
その他費用		262,486		239,902
<b>営業費用合計</b>		<b>55,751,654</b>		<b>57,262,879</b>
営業利益又は営業損失( )		277,019,490		267,840,051
経常利益又は経常損失( )		277,019,490		267,840,051
中間純利益又は中間純損失( )		277,019,490		267,840,051
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )		806,289		16,592,117
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,714,567,688		2,671,819,463
剰余金増加額又は欠損金減少額		99,051,280		122,979,795
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		99,051,280		122,979,795
剰余金減少額又は欠損金増加額		137,009,464		116,523,958
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		137,009,464		116,523,958
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		1,954,435,283		2,427,027,366

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
--------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 平成30年1月11日現在	第12期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	9,297,940,724円 1,031,255,707円 1,472,513,113円	8,856,683,318円 468,305,879円 387,228,476円
2. 受益権の総数	8,856,683,318口	8,937,760,721口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 平成30年1月11日現在	第12期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	第11期 平成30年1月11日現在	第12期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,3017円	1,2715円
(1万口当たり純資産額)	(13,017円)	(12,715円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,174,734,961	10,665,436,367
株式	2	312,504,179,760	282,144,702,720
派生商品評価勘定		176,588,080	8,365,980
未収入金		131,159,280	100,920
未収配当金		394,538,223	366,832,129
前払金		-	174,520,000
流動資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116
資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		706,480	289,828,244
前受金		349,245,000	-
未払解約金		262,677,000	259,340,000
その他未払費用		-	6,516
流動負債合計		612,628,480	549,174,760
負債合計		612,628,480	549,174,760
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,835,531,288	112,611,312,358
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		208,933,040,536	180,199,470,998
元本等合計		321,768,571,824	292,810,783,356
純資産合計		321,768,571,824	292,810,783,356
負債純資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1 . 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	131,210,790,341円	112,835,531,288円
同期中追加設定元本額	20,348,712,984円	15,428,145,401円
同期中一部解約元本額	38,723,972,037円	15,652,364,331円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	8,226,196,501円	10,490,531,830円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,839,482,555円	1,713,154,194円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,123,447円	3,224,211円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,291,815円	7,430,828円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,267,567円	12,062,772円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	17,474,561円	20,617,488円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,210,945円	16,876,583円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,886,882円	13,636,876円
たわらノーロード TOPIX	105,629,384円	225,832,229円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	9,120,978円	36,972,701円
たわらノーロード バランス（堅実型）	62,731円	937,272円
たわらノーロード バランス（標準型）	457,256円	6,377,820円

たわらノーロード バランス(積極型)	1,941,760円	19,376,137円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	14,568円	76,147円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	18,634円	3,799,772円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	22,365円	9,844,007円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	33,208円	8,202,675円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	44,401円	20,496,624円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	37,020円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	57,120円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	424,614円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	494,006円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,469,719円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,033,477,757円	37,556,666,205円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	755,786,995円	816,478,301円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,674,104,581円	2,799,587,690円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,772,861,201円	2,935,668,071円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	328,683,164円	339,960,129円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,127,448,779円	1,137,824,023円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,054,085,428円	1,071,695,738円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	47,522,960円	42,726,996円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,171,577,546円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	24,024,004円	25,558,900円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	37,610,795円	265,421,853円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	93,210,788円	162,872,234円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	185,672,845円	289,200,624円
投資のソムリエ	2,476,860,905円	2,778,985,406円
クルーズコントロール	2,066,117,052円	748,682,483円
投資のソムリエ<DC年金>	157,129,259円	238,954,842円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	145,551,548円	180,201,550円

D I A M D C バランス・F (成長型)	190,593,286円	235,254,342円
クルーズコントロール< D C 年金 >	721,180円	322,728円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	11,905,936円	3,389,986円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	27,115,492円	11,950,050円
投資のソムリエ< D C 年金>リス ク抑制型	41,009,745円	61,660,132円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	2,126,231円 566,776,687円	1,327,768円 1,115,244,286円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	507,000円	860,331円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	507,000円	558,617円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(D C)	194,381円	298,341円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	467,415円	1,391,944円
4資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	- 円	9,596,986円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	- 円	90,755,943円
D I A M ワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	71,627,508円	71,166,805円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	- 円	49,226,969円
D I A M グローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	139,026,202円	123,348,352円
D I A M グローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資 家限定)	305,156,483円	287,819,155円
D I A M 国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	16,481,224円	15,695,993円
D I A M 国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	73,774,906円	65,253,990円
D I A M 国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	20,065,167円	17,155,486円
D I A M 国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	24,943,302円	16,665,826円
D I A M 世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	33,391,434円	30,178,653円
D I A M 世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	59,453,532円	53,846,130円

D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,110,380,656円	1,046,472,592円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,056,123,054円	983,224,632円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,858,693,114円	2,714,455,678円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	203,597,030円	198,321,837円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	103,572,859円	65,450,833円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	614,329,833円	567,866,288円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	1,931,779,617円	825,365,195円
D I A Mグローバル 私募ファンド (適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	50,384,094円	10,377,565円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	1,341,418,363円	216,564,142円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	15,452,034,881円	13,917,581,515円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	551,734,251円	537,147,427円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,768,841,652円	1,729,869,171円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	10,058,436,721円	9,902,704,806円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	523,029円	3,950,183円
D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	9,153,617円	1,486,405円
D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	3,719,126円	3,718,648円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	8,946,206,418円	8,852,811,603円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	72,553,517円	70,212,939円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	27,930,610円	27,957,494円
D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	23,981,894円	25,126,872円
D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	5,401,067円	98,256円

	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	109,957円	111,158円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212)(適 格機関投資家限定)	477,777,807円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303)(適 格機関投資家限定)	1,323,021,834円	1,311,785,878円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	1,764,382,103円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	76,281,237円	73,956,736円
	計	112,835,531,288円	112,611,312,358円
2 .	受益権の総数	112,835,531,288口	112,611,312,358口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,814,500,000円	株式 3,566,000,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	11,943,240,000	-	11,662,000,000	281,240,000
合計	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	11,943,240,000	-	11,662,000,000	281,240,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.8517円	2.6002円
(1万口当たり純資産額)	(28,517円)	(26,002円)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,225,455,365	966,723,779
国債証券		303,128,208,700	287,019,186,400
地方債証券		22,902,738,657	22,636,622,741
特殊債券		15,780,383,842	16,939,931,173
社債券		16,879,127,400	15,597,661,260
未収入金		1,447,832,100	-
未収利息		770,154,466	677,408,888
前払費用		8,463,736	37,503,723
流動資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964
資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964
負債の部			
流動負債			
未払解約金		315,300,000	594,780,000
その他未払費用		-	18,879
流動負債合計		315,300,000	594,798,879
負債合計		315,300,000	594,798,879
純資産の部			
元本等			
元本	1	282,148,441,520	265,317,226,510
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		79,678,622,746	77,963,012,575
元本等合計		361,827,064,266	343,280,239,085
純資産合計		361,827,064,266	343,280,239,085
負債純資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	302,351,149,022円 60,393,037,069円 80,595,744,571円	282,148,441,520円 41,959,884,341円 58,791,099,351円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	14,044,050,293円	16,224,206,425円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	137,430,777円	119,440,378円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	112,114,796円	99,280,528円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	34,436,660円	28,462,744円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	583,451,400円	763,832,586円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	159,609,573円	225,487,668円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,188,228円	32,175,332円
たわらノーロード 国内債券	2,792,034,873円	4,001,571,429円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	19,455,389円	71,690,226円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,243,754円	16,608,904円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,399,845円	30,151,049円
たわらノーロード バランス（積極型）	826,692円	7,497,259円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	440,066円	2,091,676円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	234,451円	47,434,738円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	164,351円	51,623,317円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	90,351円	17,549,563円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	19,472円	6,990,884円
たわらノーロード 最適化バラン ス(保守型)	- 円	1,095,674円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定型)	- 円	499,774円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定成長型)	- 円	1,901,101円
たわらノーロード 最適化バラン ス(成長型)	- 円	583,204円
たわらノーロード 最適化バラン ス(積極型)	- 円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド<DC年金>	12,427,315,535円	12,684,931,274円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 1 安定型	5,528,653,854円	5,690,893,884円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 2 安定・成長型	7,985,672,600円	8,205,370,620円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 3 成長型	3,263,681,041円	3,314,885,808円
D I A M DC バランス30イ ンデックスファンド	1,826,494,969円	1,809,651,883円
D I A M DC バランス50イ ンデックスファンド	2,010,449,233円	1,998,122,354円
D I A M DC バランス70イ ンデックスファンド	309,647,783円	306,027,282円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	89,820,576円	91,445,749円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	2,234,726,830円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	2,224,336円	1,190,857円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	470,102,235円	3,055,951,673円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	421,003,073円	678,388,474円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	99,634,072円	144,557,730円
投資のソムリエ	5,412,751,268円	3,987,876,892円
クルーズコントロール	4,127,957,852円	1,525,094,843円
投資のソムリエ<DC年金>	343,120,269円	342,717,792円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	1,785,743,778円	2,082,220,286円
D I A M DC バランス・F (成長型)	228,300,610円	261,874,420円
クルーズコントロール<DC年金 >	1,441,246円	657,425円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	9,543,074円	2,750,846円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	21,666,572円	9,712,567円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	296,996,808円	330,393,586円
ダイナミック・ナビゲーション	559,152円	499,073円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,119,995,045円	5,976,301,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	721,386円	790,930円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	721,391円	511,048円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,382,114円	1,593,754円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	708,794円	1,215,365円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	49,940,747円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	688,041,623円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	22,732,301,633円	22,720,102,763円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	502,918,166円	478,855,501円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	356,392,042円	302,954,413円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	260,572,513円	235,425,892円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	82,170,787円	75,007,625円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	236,417,399円	200,309,903円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	107,172,904円	87,815,729円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,047,134円	45,459,172円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	107,073,029円	92,633,774円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	190,740,120円	165,279,639円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,327,385,858円	5,712,289,546円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,384,413,398円	3,018,178,605円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,106,252,901円	5,554,071,577円

D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A (適格機関投資家限 定)	652,541,797円	608,905,631円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A 2 (適格機関投資家 限定)	553,747,291円	335,834,392円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格 機関投資家限定)	3,945,456,574円	3,493,068,225円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家向 け)	4,127,295,962円	1,688,402,829円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	194,752,933円
D I A M世界バランスファンド5 5V A (適格機関投資家限定)	322,047,228円	63,734,156円
D I A M世界バランスファンド3 5V A (適格機関投資家限定)	2,383,950,442円	349,979,409円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資家 限定)	88,035,522,422円	75,947,212,793円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投資 家限定)	1,178,525,546円	1,099,071,813円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投資 家限定)	7,559,824,166円	7,081,932,609円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資家 限定)	28,649,485,500円	27,020,064,564円
D I A Mバランス30V A (適格 機関投資家限定)	8,960,230円	65,311,006円
D I A Mバランス50V A (適格 機関投資家限定)	48,915,437円	7,670,416円
D I A Mバランス70V A (適格 機関投資家限定)	7,941,011円	7,651,356円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資家 限定)	31,857,319,666円	30,198,164,977円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	509,422,227円	472,394,738円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	139,681,767円	133,504,178円
D I A Mバランス20V A (適格 機関投資家限定)	513,354,007円	522,054,954円
D I A Mバランス40V A (適格 機関投資家限定)	40,409,042円	711,766円
D I A Mバランス60V A (適格 機関投資家限定)	390,500円	383,533円
計	282,148,441,520円	265,317,226,510円
2 . 受益権の総数	282,148,441,520口	265,317,226,510口

--	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11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)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,2824円	1,2938円
(1万口当たり純資産額)	(12,824円)	(12,938円)

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		957,714,377	916,946,623
投資証券		33,647,153,300	36,133,137,650
派生商品評価勘定		14,948,352	14,914,692
未収配当金		323,661,804	274,456,379
差入委託証拠金		6,500,352	13,300,092
流動資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436
資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436
負債の部			
流動負債			
前受金		13,412,352	14,388,192
未払金		673,826,209	434,571,807
未払解約金		28,461,800	14,400
その他未払費用		-	922
流動負債合計		715,700,361	448,975,321
負債合計		715,700,361	448,975,321
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,626,564,592	19,870,219,702
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		14,607,713,232	17,033,560,413
元本等合計		34,234,277,824	36,903,780,115
純資産合計		34,234,277,824	36,903,780,115
負債純資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 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	16,468,770,229円	19,626,564,592円
同期中追加設定元本額	13,353,736,969円	8,047,686,881円
同期中一部解約元本額	10,195,942,606円	7,804,031,771円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	361,083円	291,165円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	912,903円	1,177,517円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,407,898円	2,133,850円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,532,660円	1,861,536円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,298,870円	2,675,656円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,761,249円	2,412,687円
たわらノーロード 国内リート	1,064,897,610円	1,326,980,470円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	292,610,032円	543,464,524円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	14,983,358円	51,810,705円
たわらノーロード バランス（堅実型）	51,544円	648,759円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,073,973円	12,675,912円
たわらノーロード バランス（積極型）	3,189,831円	27,046,487円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	35,677円	6,509,363円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長型)	53,803円	17,569,696円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	64,927円	13,840,858円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	77,218円	27,313,897円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定型)	- 円	122,931円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定成長型)	- 円	909,269円
たわらノーロード 最適化バラン ス(成長型)	- 円	813,819円
たわらノーロード 最適化バラン ス(積極型)	- 円	2,221,234円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	13,914,114円	14,493,488円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	343,011,189円	368,359,319円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	3,270,978円	3,505,986円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	18,476,325円	112,321,672円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	60,982,941円	91,483,915円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	134,732,676円	181,623,980円
投資のソムリエ	1,515,538,797円	2,503,597,271円
投資のソムリエ<DC年金>	96,091,039円	215,305,365円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	70,215,123円	76,468,506円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	55,236,473円	72,005,293円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	207,978円	515,717円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	764,041,600円	1,303,583,907円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	237,910円	551,661円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	237,910円	355,076円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	256,978円	347,948円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	234,001円	852,031円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	- 円	149,965,158円
Jリートインデックスファンド (DC)	6,728,716円	7,942,356円
D I A M J - R E I Tインデッ クス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定)	94,383,939円	92,393,600円

D I A M J - R E I Tインデックス 私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	1,819,511,382円	829,830,093円
D I A M J - R E I Tインデックス ファンド(適格機関投資家向け)	9,605,103,606円	9,215,244,946円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	- 円	65,219,763円
D I A Mグローバル 私募ファンド (適格機関投資家向け)	14,402,370円	14,402,370円
D I A Mグローバル・リスクファクター・ パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,779,304,967円	1,410,548,883円
D I A Mグローバル・リスクファクター・ パリティ戦略ファンドI I(適格機関投資家限定)	1,845,130,944円	1,096,821,063円
計	19,626,564,592円	19,870,219,702円
2 . 受益権の総数	19,626,564,592口	19,870,219,702口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11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	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（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。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数 先物取引								
買建	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	600,525,900	-	615,478,500	14,952,600
合計	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	600,525,900	-	615,478,500	14,952,600

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7443円	1.8572円
(1万口当たり純資産額)	(17,443円)	(18,572円)

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,822,987,447	5,489,104,287
コール・ローン		726,764,720	171,476,639
株式		292,877,407,767	300,454,985,072
投資信託受益証券		801,364,202	739,626,667
投資証券		6,273,413,009	6,712,692,366
派生商品評価勘定		175,170,660	100,811,148
未収入金		2,663,502	36,167,920
未収配当金		323,899,180	345,526,103
差入委託証拠金		2,025,207,755	2,635,621,046
流動資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248
資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,689,542	1,589,537
未払解約金		331,777,000	213,332,000
その他未払費用		-	1,578
流動負債合計		335,466,542	214,923,115
負債合計		335,466,542	214,923,115
純資産の部			
元本等			
元本	1	87,104,816,912	88,975,107,871
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		221,588,594,788	227,495,980,262
元本等合計		308,693,411,700	316,471,088,133
純資産合計		308,693,411,700	316,471,088,133
負債純資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<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期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決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	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 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	92,727,414,724円	87,104,816,912円
同期中追加設定元本額	20,058,442,109円	14,038,234,344円
同期中一部解約元本額	25,681,039,921円	12,167,943,385円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,822,423,973円	1,906,729,848円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,191,830円	2,423,710円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,279,030円	7,682,928円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,898,552円	14,007,544円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	13,544,215円	15,500,550円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	10,359,460円	17,451,481円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,818,783円	15,792,642円
たわらノーロード 先進国株式	5,502,154,955円	6,928,447,314円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	424,744円	424,449円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	463,445,507円	799,442,282円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	7,231,042円	27,581,489円
たわらノーロード バランス(堅実型)	150,198円	2,000,495円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,404,580円	17,911,257円
たわらノーロード バランス(積極型)	4,751,015円	43,580,554円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	14,227円	71,283円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	57,189円	9,209,178円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	80,559円	21,668,159円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	103,944円	17,376,355円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	127,326円	41,908,829円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	14,099円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	51,366円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	449,195円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	526,371円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,728,931円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	36,937,428,806円	38,861,551,807円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	157,435,724円	164,512,028円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	857,026,223円	860,798,975円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,043,554,352円	1,073,184,906円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	130,707,011円	130,817,408円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	385,930,973円	375,234,201円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	330,441,705円	332,100,058円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	33,185,995円	31,471,673円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	817,871,261円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	187,072,304円	206,676,091円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	29,811,822円	200,171,509円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	73,885,125円	123,404,993円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	145,725,386円	218,118,529円
投資のソムリエ	970,425,131円	750,874,606円
クルーズコントロール	790,811,166円	297,563,297円
投資のソムリエ<DC年金>	61,679,304円	64,456,556円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	114,876,755円	138,048,807円
DIAM DC バランス・F(成長型)	70,873,790円	85,069,990円
クルーズコントロール<DC年金>	275,806円	128,297円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,642,956円	1,072,569円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	8,318,622円	3,761,847円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	27,153,058円	38,658,184円
ダイナミック・ナビゲーション	1,144,316円	1,495,747円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	373,981,024円	698,390,564円
ワールドアセットバランス(基本コース)	588,185,085円	696,288,960円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,227,897,121円	2,732,686,672円

投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	517,823円	822,489円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	517,846円	534,290円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	126,045円	184,512円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	365,458円	1,088,499円
4資産分散投資・スタンダード< DC年金>	-円	3,568,737円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	-円	80,898,377円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家専 用)	95,685,592円	91,764,770円
DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向け)	2,953,403,840円	2,879,034,337円
DIAM先進国株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	161,207,978円	158,419,668円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	208,789,234円	208,685,890円
DIAMワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	23,987,145円	23,469,497円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	108,709,025円	94,957,427円
DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資 家限定)	238,629,259円	221,387,243円
DIAM国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	12,888,459円	12,087,592円
DIAM国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	86,550,378円	75,185,426円
DIAM国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	7,842,084円	6,601,997円
DIAM国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	13,001,598円	8,545,004円
DIAM世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	26,103,100円	23,213,482円
DIAM世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	69,758,648円	62,137,695円
DIAMバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	578,673,845円	536,449,917円
DIAMバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	722,585,419円	661,713,592円
DIAMバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	2,235,486,581円	2,087,932,927円

D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A (適格機関投資家限 定)	794,469,102円	759,101,003円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A 2 (適格機関投資家 限定)	242,322,969円	149,974,052円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格 機関投資家限定)	962,367,378円	874,971,079円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家向 け)	499,820,780円	211,701,890円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド5 5V A (適格機関投資家限定)	176,485,295円	35,747,427円
D I A M世界バランスファンド3 5V A (適格機関投資家限定)	424,964,949円	64,609,302円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資家 限定)	8,054,309,887円	7,135,559,831円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投資 家限定)	431,455,488円	413,163,240円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投資 家限定)	1,383,217,436円	1,330,611,491円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資家 限定)	5,242,924,377円	5,080,681,959円
D I A Mバランス30V A (適格 機関投資家限定)	2,048,915円	15,441,869円
D I A Mバランス50V A (適格 機関投資家限定)	28,490,332円	4,637,511円
D I A Mバランス70V A (適格 機関投資家限定)	10,665,941円	10,592,510円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資家 限定)	6,995,839,213円	6,809,630,311円
D I A Mバランス20V A (適格 機関投資家限定)	56,125,154円	59,204,056円
D I A Mバランス40V A (適格 機関投資家限定)	12,665,761円	230,745円
D I A Mバランス60V A (適格 機関投資家限定)	257,653円	260,170円
計	87,104,816,912円	88,975,107,871円
2 . 受益権の総数	87,104,816,912口	88,975,107,871口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,026,890,881	-	1,026,860,650	30,231	66,848,488	-	66,773,840	74,648
アメリカ・ドル	723,398,115	-	723,375,400	22,715	66,848,488	-	66,773,840	74,648
イギリス・ポンド	74,535,466	-	74,532,150	3,316	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	29,758,776	-	29,757,420	1,356	-	-	-	-
カナダ・ドル	44,107,048	-	44,104,320	2,728	-	-	-	-
ユーロ	155,091,476	-	155,091,360	116	-	-	-	-
買 建	368,878,305	-	365,713,490	3,164,815	466,776,268	-	466,760,440	15,828
アメリカ・ドル	250,403,880	-	248,221,420	2,182,460	316,797,801	-	316,787,520	10,281
イギリス・ポンド	28,149,045	-	27,855,450	293,595	32,339,714	-	32,337,800	1,914
オーストラリア・ドル	11,862,585	-	11,850,300	12,285	15,634,416	-	15,633,200	1,216
カナダ・ドル	17,942,835	-	17,695,080	247,755	14,089,456	-	14,088,120	1,336
ユーロ	60,519,960	-	60,091,240	428,720	87,914,881	-	87,913,800	1,081
合計	1,395,769,186	-	1,392,574,140	3,134,584	533,624,756	-	533,534,280	58,820

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
  - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
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ではありません。

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	8,823,316,081	-	8,922,478,872	99,162,791
合計	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	8,823,316,081	-	8,922,478,872	99,162,791

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として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ではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	3.5439円	3.5568円
(1万口当たり純資産額)	(35,439円)	(35,568円)

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,717,332,670	1,716,618,741
コール・ローン		254,275,738	345,599,720
国債証券		222,177,369,816	210,268,205,338
派生商品評価勘定		2,180,614	926,554
未収入金		3,113,657,238	-
未収利息		2,011,358,256	1,757,456,486
前払費用		47,148,515	39,941,377
流動資産合計		231,323,322,847	214,128,748,216
資産合計		231,323,322,847	214,128,748,216
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,998	60,269
未払金		-	373,074,254
未払解約金		366,282,000	310,381,000
その他未払費用		-	3,048
流動負債合計		366,294,998	683,518,571
負債合計		366,294,998	683,518,571
純資産の部			
元本等			
元本	1	125,530,104,029	117,601,828,446
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		105,426,923,820	95,843,401,199
元本等合計		230,957,027,849	213,445,229,645
純資産合計		230,957,027,849	213,445,229,645
負債純資産合計		231,323,322,847	214,128,748,216

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準  外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 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	146,373,971,356円	125,530,104,029円
同期中追加設定元本額	23,047,727,819円	17,781,160,633円
同期中一部解約元本額	43,891,595,146円	25,709,436,216円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,132,425,010円	7,370,471,447円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	17,026,383円	12,728,976円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	43,780,396円	36,346,946円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	49,388,910円	41,646,430円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	72,275,459円	80,998,408円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	62,320,881円	82,639,195円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	36,122,260円	47,071,012円
たわらノーロード 先進国債券	1,355,092,120円	2,120,491,637円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	13,868,205円	53,361,033円
たわらノーロード バランス(堅実型)	71,706円	1,002,765円
たわらノーロード バランス(標準型)	397,672円	5,222,705円
たわらノーロード バランス(積極型)	224,963円	2,142,626円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	21,628円	140,593円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	38,388円	8,972,914円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	21,628円	9,079,160円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	-円	2,200,512円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	-円	98,460円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	-円	626,518円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	-円	392,605円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	-円	637,620円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,000,335,109円	5,081,097,229円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	465,467,784円	505,957,556円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,493,783,080円	1,659,201,042円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,625,017,909円	1,737,417,498円
D I A M D C バランス3 0 イ ンデックスファンド	358,729,368円	375,880,904円
D I A M D C バランス5 0 イ ンデックスファンド	770,825,404円	818,524,847円
D I A M D C バランス7 0 イ ンデックスファンド	615,670,534円	637,961,618円
マネックス資産設計ファンド< 隔 月分配型>	23,857,963円	23,582,221円
マネックス資産設計ファンド< 育 成型>	590,083,690円	599,670,192円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	8,124,972円	17,303,931円
D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国1 0)	16,890,765円	116,343,233円
D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国2 0)	37,165,229円	63,100,649円
D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国3 0)	68,111,461円	104,367,523円
クルーズコントロール	4,310,597,545円	1,636,314,396円
D I A M 8 資産バランスファン ドN< D C年金>	64,088,822円	79,179,510円
D I A M D C バランス・F (成長型)	113,195,260円	137,529,305円
クルーズコントロール< D C年金 >	1,504,754円	705,473円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	13,258,543円	3,917,751円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	30,164,786円	13,925,116円
ダイナミック・ナビゲーション	387,823円	362,192円
4 資産分散投資・スタンダード< D C年金>	- 円	10,290,126円
D I A Mパッシブ資産分散ファン ド	1,427,367,462円	1,370,643,849円
D I A M為替フルヘッジ型外国債 券パッシブ私募ファンド(適格機 関投資家向け)	6,914,807,354円	6,985,443,158円
D I A M外国債券パッシブファン ド(適格機関投資家向け)	4,015,164,258円	4,065,671,104円
外国債券パッシブファンド(適格 機関投資家限定)	3,769,097,133円	3,312,147,806円
先進国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	576,382,992円	6,090,533,213円
D I A Mワールドバランス2 5 V A(適格機関投資家限定)	105,167,751円	105,203,775円

D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	980,291,866円	875,467,726円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資 家限定)	716,967,111円	679,773,131円
D I A M国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	56,481,829円	54,163,606円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	108,319,378円	96,169,004円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	29,458,898円	25,359,586円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	12,199,263円	8,193,529円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	73,537,596円	66,817,243円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	87,294,718円	79,464,966円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	3,805,445,836円	3,605,201,925円
D I A Mバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	2,520,252,961円	2,358,564,937円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	4,197,266,896円	4,006,261,030円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA(適格機関投資家限 定)	747,764,373円	732,217,804円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA2(適格機関投資家 限定)	532,270,006円	339,039,492円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格 機関投資家限定)	3,622,086,116円	3,356,615,841円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	10,441,980,855円	4,430,116,595円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド5 5VA(適格機関投資家限定)	110,717,358円	22,980,591円
D I A M世界バランスファンド3 5VA(適格機関投資家限定)	3,669,493,348円	562,888,132円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	15,122,513,442円	13,690,978,145円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資家 限定)	19,692,761,593円	19,497,803,365円

D I A Mバランス30 V A ( 適格 機関投資家限定 )	2,307,939円	17,634,980円
D I A Mバランス50 V A ( 適格 機関投資家限定 )	33,620,094円	5,550,982円
D I A Mバランス70 V A ( 適格 機関投資家限定 )	5,459,009円	5,518,264円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資家 限定 )	17,516,462,651円	17,424,449,927円
D I A M世界バランス25 V A ( 適格機関投資家限定 )	106,474,190円	103,731,458円
D I A Mバランス20 V A ( 適格 機関投資家限定 )	105,797,212円	113,204,188円
D I A Mバランス40 V A ( 適格 機関投資家限定 )	19,813,336円	367,428円
D I A Mバランス60 V A ( 適格 機関投資家限定 )	160,854円	165,851円
計	125,530,104,029円	117,601,828,446円
2 . 受益権の総数	125,530,104,029口	117,601,828,446口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	3,566,821,676	-	3,564,654,060	2,167,616	177,940,000	-	177,013,446	926,554
アメリカ・ドル	1,585,098,722	-	1,583,921,020	1,177,702	-	-	-	-
イギリス・ポンド	263,487,000	-	263,480,000	7,000	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	99,168,800	-	99,168,800	-	22,970,000	-	22,758,403	211,597
カナダ・ドル	65,971,220	-	65,971,220	-	154,970,000	-	154,255,043	714,957
スウェーデン・クローナ	65,954,060	-	65,954,060	-	-	-	-	-
ユーロ	1,487,141,874	-	1,486,158,960	982,914	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,507,900,000	-	1,507,839,731	60,269
アメリカ・ドル	-	-	-	-	656,300,000	-	656,259,763	40,237
イギリス・ポンド	-	-	-	-	169,150,000	-	169,143,095	6,905
カナダ・ドル	-	-	-	-	18,380,000	-	18,379,128	872
ユーロ	-	-	-	-	664,070,000	-	664,057,745	12,255
合計	3,566,821,676	-	3,564,654,060	2,167,616	1,685,840,000	-	1,684,853,177	866,285

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
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ではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.8399円	1.8150円
(1万口当たり純資産額)	(18,399円)	(18,150円)

## 「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		409,027,141	124,946,716
コール・ローン		81,777,811	92,805,011
投資信託受益証券		6,493,687,842	5,393,315,131
投資証券		48,340,326,547	48,157,425,564
派生商品評価勘定		-	33,672
未収入金		28,955	84,591
未収配当金		276,841,525	226,329,480
流動資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165
資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		167,021	-
未払金		392,565,351	-
未払解約金		6,842,000	82,839,000
その他未払費用		-	510
流動負債合計		399,574,372	82,839,510
負債合計		399,574,372	82,839,510
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,402,765,697	43,633,295,638
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		8,799,349,752	10,278,805,017
元本等合計		55,202,115,449	53,912,100,655
純資産合計		55,202,115,449	53,912,100,655
負債純資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決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	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 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 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	30,797,163,241円  32,142,557,355円 16,536,954,899円	46,402,765,697円  21,142,191,108円 23,911,661,167円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	274,804,177円	249,613,727円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	67,370,416円	88,143,324円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	5,909,943円	4,670,633円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	15,182,713円	18,688,067円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	39,369,153円	34,131,064円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	25,105,584円	29,869,389円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,627,261円	42,445,575円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,808,725円	38,483,563円
たわらノーロード 先進国リート	1,721,168,125円	2,624,670,911円
たわらノーロード 先進国リート <ラップ向け>	400,970,948円	423,148,632円
たわらノーロード 先進国リート <為替ヘッジあり>	125,946,635円	132,514,847円
たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	21,115,226円	78,215,071円
たわらノーロード バランス(堅 実型)	35,727円	492,806円
たわらノーロード バランス(標 準型)	758,305円	9,618,471円
たわらノーロード バランス(積 極型)	4,154,380円	37,694,667円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	3,317,352円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長型)	50,006円	18,801,373円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	90,164円	19,531,977円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	122,951円	47,722,952円
たわらノーロード 最適化 balan ス(安定型)	- 円	83,168円
たわらノーロード 最適化 balan ス(安定成長型)	- 円	927,094円
たわらノーロード 最適化 balan ス(成長型)	- 円	1,078,234円
たわらノーロード 最適化 balan ス(積極型)	- 円	3,584,707円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	22,174,404円	23,851,883円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	539,811,573円	605,308,573円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	78,019,353円	64,548,816円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	25,595,252円	172,886,995円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	84,478,084円	140,494,274円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	189,120,828円	279,034,664円
投資のソムリエ	6,351,242,412円	7,653,588,468円
投資のソムリエ<DC年金>	402,574,454円	658,457,526円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	96,943,349円	119,024,804円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	186,280,072円	176,208,238円

ダイナミック・ナビゲーション	286,863円	800,409円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	2,578,280,510円	3,190,006,461円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	1,100,032,739円	1,316,609,921円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	4,194,614,874円	5,166,081,673円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	840,948円	1,679,621円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	840,948円	1,086,889円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	865,578円	832,318円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	820,132円	2,592,506円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	-円	365,824,903円
DIAMパッシブ資産分散ファン ド	1,113,784,191円	1,151,911,524円
DIAM外国リートインデックス ファンド<DC年金>	20,739,627円	26,553,198円
DIAM世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	2,834,824,826円	1,201,030,785円
DIAMグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	11,354,337,336円	10,118,289,327円
DIAMグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	4,236,813,769円	1,956,002,974円
DIAMグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンドI I(適格機関投資家限定)	4,407,569,364円	1,521,041,521円
P-Oneマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限定)	3,257,586,698円	3,241,156,712円
DIAM海外リートインデックス ファンド(適格機関投資家限定)	560,116,746円	559,362,723円
計	46,402,765,697円	43,633,295,638円
2. 受益権の総数	46,402,765,697口	43,633,295,638口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	22,829,922	-	22,796,250	33,672
ユーロ	-	-	-	-	5,852,322	-	5,852,250	72
香港・ドル	-	-	-	-	16,977,600	-	16,944,000	33,600
買 建	114,761,091	-	114,594,070	167,021	-	-	-	-
アメリカ・ドル	49,601,257	-	49,599,700	1,557	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	32,503,570	-	32,478,600	24,970	-	-	-	-
カナダ・ドル	1,778,510	-	1,778,400	110	-	-	-	-
シンガポール・ドル	11,768,880	-	11,706,800	62,080	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	2,813,335	-	2,809,450	3,885	-	-	-	-
ユーロ	6,395,524	-	6,395,520	4	-	-	-	-
香港・ドル	9,900,015	-	9,825,600	74,415	-	-	-	-
合計	114,761,091	-	114,594,070	167,021	22,829,922	-	22,796,250	33,672

## (注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1896円	1.2356円
(1万口当たり純資産額)	(11,896円)	(12,356円)

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

(平成30年7月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

平成30年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除く)

基本的性格	本数	純資産総額(単位:円)
追加型公社債投資信託	38	1,264,102,345,784
追加型株式投資信託	850	12,950,854,953,959
単位型公社債投資信託	49	193,796,833,775
単位型株式投資信託	145	955,223,205,407
合計	1,082	15,363,977,338,925

(3)【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成30年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

(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。

## 5【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	27,972,477	49,071,217
金銭の信託	12,366,219	12,083,824
有価証券	297,560	-
未収委託者報酬	10,164,041	11,769,015
未収運用受託報酬	7,250,239	4,574,225
未収投資助言報酬	316,414	341,689
未収収益	52,278	59,526
前払費用	533,411	569,431
繰延税金資産	678,104	842,996
その他	445,717	427,238
流動資産計	60,076,462	79,739,165
固定資産		
有形固定資産	1,900,343	1,643,826
建物	1 1,243,812	1 1,156,953
器具備品	1 656,235	1 476,504
建設仮勘定	295	10,368
無形固定資産	1,614,084	1,934,700
商標権	5	-
ソフトウェア	1,511,558	1,026,319
ソフトウェア仮勘定	98,483	904,389
電話加入権	3,934	3,931
電信電話専用施設利用権	103	60
投資その他の資産	10,055,336	7,427,316
投資有価証券	3,265,786	1,721,433
関係会社株式	3,306,296	3,229,196
長期差入保証金	1,800,827	1,518,725
前払年金費用	686,322	-
繰延税金資産	893,887	856,537
その他	102,215	101,425
固定資産計	13,569,764	11,005,844
資産合計	73,646,227	90,745,010

(単位:千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038
未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911
役員賞与引当金	27,495	49,986
本社移転費用引当金	-	156,587
流動負債計	17,211,706	22,211,034
固定負債		
退職給付引当金	1,305,273	1,637,133
時効後支払損引当金	216,466	199,026
本社移転費用引当金	942,315	-
固定負債計	2,464,055	1,836,160
負債合計	19,675,761	24,047,195
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	31,899,643	44,349,855
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	31,776,350	44,226,562
別途積立金	24,580,000	24,580,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	6,696,350	19,146,562
株主資本計	53,452,601	65,902,812
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,864	795,002
評価・換算差額等計	517,864	795,002
純資産合計	53,970,465	66,697,815
負債・純資産合計	73,646,227	90,745,010

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	56,355,754		84,705,447	
運用受託報酬	12,834,241		19,124,427	
投資助言報酬	1,002,482		1,217,672	
その他営業収益	378,715		117,586	
営業収益計		70,571,194		105,165,133
営業費用				
支払手数料	24,957,038		37,242,284	
広告宣伝費	838,356		379,873	
公告費	991		1,485	
調査費	15,105,578		23,944,438	
調査費	7,780,474		10,677,166	
委託調査費	7,325,104		13,267,272	
委託計算費	891,379		1,073,938	
営業雑経費	1,102,921		1,215,963	
通信費	51,523		48,704	
印刷費	926,453		947,411	
協会費	37,471		64,331	
諸会費	74		22,412	
支払販売手数料	87,399		133,104	
営業費用計		42,896,265		63,857,984
一般管理費				
給料	8,517,089		11,304,873	
役員報酬	220,145		189,022	
給料・手当	7,485,027		9,565,921	
賞与	811,916		1,549,929	
交際費	66,813		58,863	
寄付金	13,467		5,150	
旅費交通費	297,237		395,605	
租税公課	430,779		625,498	
不動産賃借料	1,961,686		1,534,255	
退職給付費用	358,960		595,876	
固定資産減価償却費	825,593		1,226,472	
福利厚生費	39,792		49,797	
修繕費	27,435		4,620	
賞与引当金繰入額	1,432,264		1,393,911	
役員賞与引当金繰入額	27,495		49,986	
役員退職慰労金	63,072		-	
機器リース料	210		148	
事務委託費	1,530,113		3,037,804	
事務用消耗品費	127,265		144,804	
器具備品費	271,658		5,253	
諸経費	129,981		149,850	
一般管理費計		16,120,918		20,582,772
営業利益		11,554,010		20,724,376

(単位:千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		537		1,430
受取配当金		51,036		74,278
時効成立分配金・償還金		103		256
為替差益		7,025		8,530
投資信託解約益		2		236,398
投資信託償還益		-		93,177
雑収入	1	18,213	1	10,306
時効後支払損引当金戻入額		-		17,429
営業外収益計		76,918		441,807
営業外費用				
投資信託解約損		31,945		4,138
投資信託償還損		47,201		17,065
金銭の信託運用損		552,635		99,303
時効成立後支払分配金・償還金		39		-
時効後支払損引当金繰入額		209,210		-
営業外費用計		841,031		120,507
経常利益		10,789,897		21,045,676
特別利益				
固定資産売却益	2	2,348	2	1
投資有価証券売却益		-		479,323
関係会社株式売却益	1	-	1	1,492,680
貸倒引当金戻入益		8,883		-
訴訟損失引当金戻入益		21,677		-
本社移転費用引当金戻入額		-		138,294
その他特別利益		746		350
特別利益計		33,655		2,110,649
特別損失				
固定資産除却損	3	23,600	3	36,992
固定資産売却損	4	10,323	4	134
投資有価証券評価損		12,085		-
ゴルフ会員権評価損		4,832		-
訴訟和解金		30,000		-
本社移転費用	5	1,511,622	5	-
退職給付制度終了損		-		690,899
システム移行損失		-		76,007
その他特別損失		-		50
特別損失計		1,592,463		804,083
税引前当期純利益		9,231,089		22,352,243
法人税、住民税及び事業税		2,965,061		6,951,863
法人税等調整額		177,275		249,832
法人税等合計		2,787,786		6,702,031
当期純利益		6,443,302		15,650,211

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の積立	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		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	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、当事業年度においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度末の減価償却費が413,260千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ同額減少しております。

## 追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」(企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日)及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第2号 平成19年2月7日)を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。

本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。

## 注記事項

(貸借対照表関係)

### 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
建物	53,098	140,580
器具備品	734,064	847,466

(損益計算書関係)

### 1. 関係会社に対する事項

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
雑収入	8,183	-
関係会社株式売却益	-	1,492,680

### 2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	546	-
車両運搬具	696	-
器具備品	1,104	1

## 3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	-	298
器具備品	4,727	8,217
ソフトウェア	2,821	28,472
電話加入権	16,052	3

## 4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	543	-
器具備品	9,779	134

## 5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	942,315	-
旧本社不動産賃借料	418,583	-
賃貸借契約解約損	150,723	-

## (株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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	24,000	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

(注) 普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式					

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22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  
平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21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（為替予約取引及び株価指数先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

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

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰りを確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

## 第33期(平成30年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

## 負 債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	337,468	272,464
関係会社株式	3,306,296	3,229,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

第33期(平成30年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

(注)非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	717,905	2	79,146

(注)投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

(注)投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

## 4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

第33期において、該当事項はありません。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について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。

なお、当社は平成29年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第32期	第33期
	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,086,550	2,718,372
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
数理計算上の差異の発生額	89,303	61,792
退職給付の支払額	144,062	111,758
合併による増加	1,486,547	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,316,796
退職一時金制度改定に伴う増加額	-	526,345
退職給付債務の期末残高	2,718,372	2,154,607

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第32期	第33期
	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
年金資産の期首残高	-	1,363,437
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の発生額	1,894	-
事業主からの拠出額	37,402	36,672
退職給付の支払額	28,876	-
合併による増加	1,336,984	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,417,152
年金資産の期末残高	1,363,437	-

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第32期	第33期
	(平成29年3月31日現在)	(平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	1,275,346	-
年金資産	1,363,437	-
	88,090	-
非積立型制度の退職給付債務	1,443,026	2,154,607
未積立退職給付債務	1,354,935	2,154,607
未認識数理計算上の差異	430,203	204,636
未認識過去勤務費用	4,852	312,836
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133
退職給付引当金	1,245,019	1,637,133
前払年金費用	325,140	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の費用処理額	78,229	88,417
過去勤務費用の費用処理額	4,852	39,611
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	-	70,560
その他	7,498	1,620
確定給付制度に係る退職給付費用	274,580	456,577
制度移行に伴う損失(注)	-	690,899

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
株式	31.5%	-
債券	29.0%	-
共同運用資産	24.1%	-
生命保険一般勘定	10.5%	-
現金及び預金	4.6%	-
合計	100.0%	-

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.02% ~ 1.09%	0.09%
長期期待運用収益率	2.50%	-
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 4.42%

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	300,927
退職給付費用	22,562	53,156
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	36,177	35,640
合併による増加	287,313	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	391,600
退職一時金制度改定に伴う振替額	-	108,189
退職給付引当金の期末残高	300,927	-

## (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	789,261	-
年金資産	1,150,443	-
	361,181	-
非積立型制度の退職給付債務	60,254	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-
退職給付引当金	60,254	-
前払年金費用	361,181	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 22,562千円 当事業年度53,156千円

## 4. 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61,817千円、当事業年度86,141千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	124,081	290,493
未払事業所税	11,054	11,683
賞与引当金	441,996	426,815
未払法定福利費	84,152	81,186
資産除去債務	86,421	90,524
減価償却超過額(一括償却資産)	10,666	11,331
減価償却超過額	116,920	176,791
繰延資産償却超過額(税法上)	32,949	34,977
退職給付引当金	399,808	501,290
時効後支払損引当金	66,282	60,941
ゴルフ会員権評価損	14,295	13,173
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	69,683	28,976
未払給与	12,344	9,186
本社移転費用引当金	289,865	47,947
その他	14,309	29,193
繰延税金資産小計	1,941,573	1,981,254
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,941,573	1,981,254
繰延税金負債		
前払年金費用	210,151	-
その他有価証券評価差額金	159,429	281,720
繰延税金負債合計	369,581	281,720

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳  
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、平成28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、平成28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

平成28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) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

## (5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,059,836千円
負債合計	13,059,836千円
純資産	101,210,659千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額70,507,975千円及び顧客関連資産の金額45,200,838千円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	9,012,128千円
経常利益	9,012,128千円
税引前当期純利益	9,012,128千円
当期純利益	7,419,617千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額3,811,241千円及び顧客関連資産の償却額5,233,360千円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

## (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32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)及び第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## (1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30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32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500 億円	資産管理 等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000  7,080	金銭の 信託	12,366,219
	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	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473 億円	信託銀行 業	-	-	投資一任契約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	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	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

## 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) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注3) 運用受託報酬は、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4) 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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734株)	(15,510株)

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

## 独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

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株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

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株式会社の平成30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すべ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。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成30年8月31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

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印  
業務執行社員

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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>の平成30年1月12日から平成30年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マネックス資産設計ファンド<育成型>の平成30年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(平成30年1月12日から平成30年7月11日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## その他の事項

ファンドの平成30年1月11日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年8月30日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成30年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

