【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成27年９月16日
【発行者名】	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　桑畑 卓
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目５番１号
【事務連絡者氏名】	藤田 剛志
【電話番号】	03-5219-5700
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし） ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンド　１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

Ⅰ【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成27年３月16日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部に訂正すべき事項がありこれを訂正するため、本訂正届出書を提出いたします。

Ⅱ【訂正の内容】

下線部＿＿＿＿は訂正箇所を表します。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

（訂正前）

（前略）

②委託会社の概況（平成27年１月末現在）

（以下略）

（訂正後）

（前略）

②委託会社の概況（平成27年７月末現在）

（以下略）

２【投資方針】

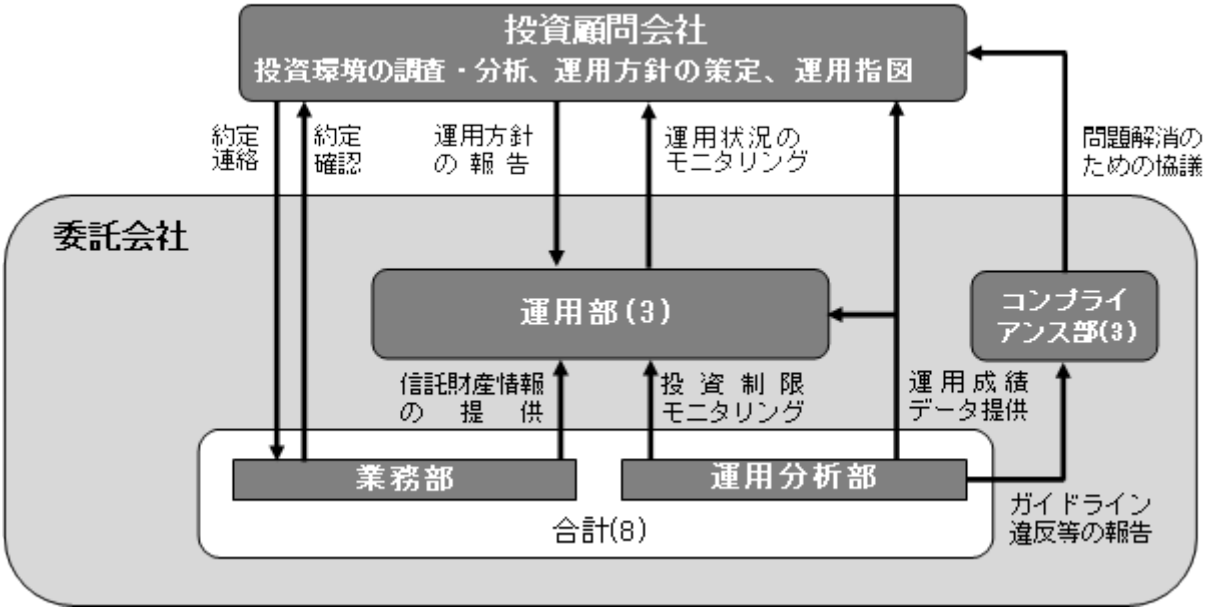
(3)【運用体制】

原届出書の第二部　ファンド情報　第１　ファンドの状況　２　投資方針　(3)運用体制につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

（前略）

■当ファンドの運用体制



（注）括弧内は平成27年７月末現在の各部署に属する人数（業務部及び運用分析部は、上記業務に従事する人数の合計）を示します。

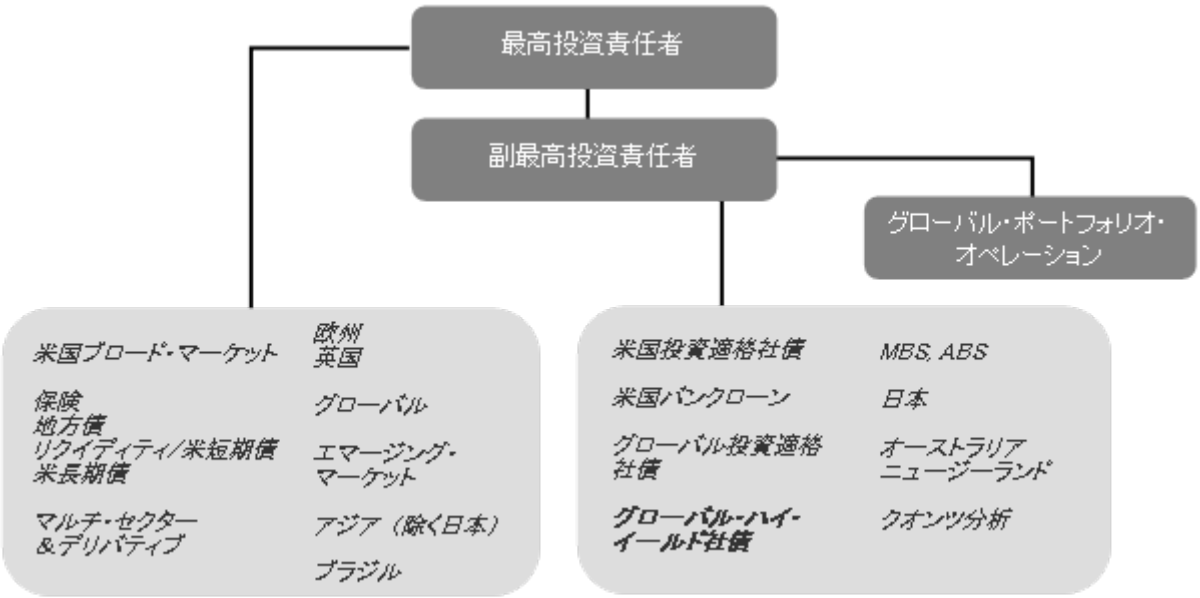
（中略）

（参考）投資顧問会社の運用体制

①運用体制

（中略）

ウエスタン・アセットのグループ全体の運用体制



上記は、投資顧問会社２社を含めたウエスタン・アセットのグループ全体の運用体制を示したものです。

②リスク管理体制

ポートフォリオの運用に関しては、運用部門とは独立したリスク管理部門によってリスク指標等のモニタリングが行われ、その内容が運用部門に提供されます。問題が発生した場合には、運用チーム及び関連部門にその旨が連絡されます。連絡を受けた運用チームが問題解消の責任を負い、問題が解消されたかどうかをリスク管理部門が検証します。これとは別に、運用ガイドラインに関しては、コンプライアンス部門が順守状況をモニターしています。

■委託会社によるファンドの関係法人に対する管理体制

委託会社は、投資顧問会社への当ファンドの運用指図に関する権限の委託が適切であるかどうかについてモニタリングを継続的に実施します。具体的には、社内規程に基づき、定期的に投資顧問会社の実

績、組織、人材、法令等の遵守状況に関する調査を実施するとともに、必要のある場合には関係部署に対する投資顧問会社の業務遂行状況に関するヒアリングを行います。調査結果は、委託会社の商品会議に提出され、外部委託の継続について議論されます。委託会社は、受託会社に対して、内部統制に関する外部監査人による報告書の提出を求めるほか、担当部署による委託会社独自の確認作業を実施し、受託会社等の業務状況についてモニタリングを行っています。

（注）ファンドの運用体制及び管理体制は、平成27年７月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

３【投資リスク】

原届出書の第二部　ファンド情報　第１　ファンドの状況　３　投資リスクにつきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

（前略）

(3)投資リスクに対する管理体制

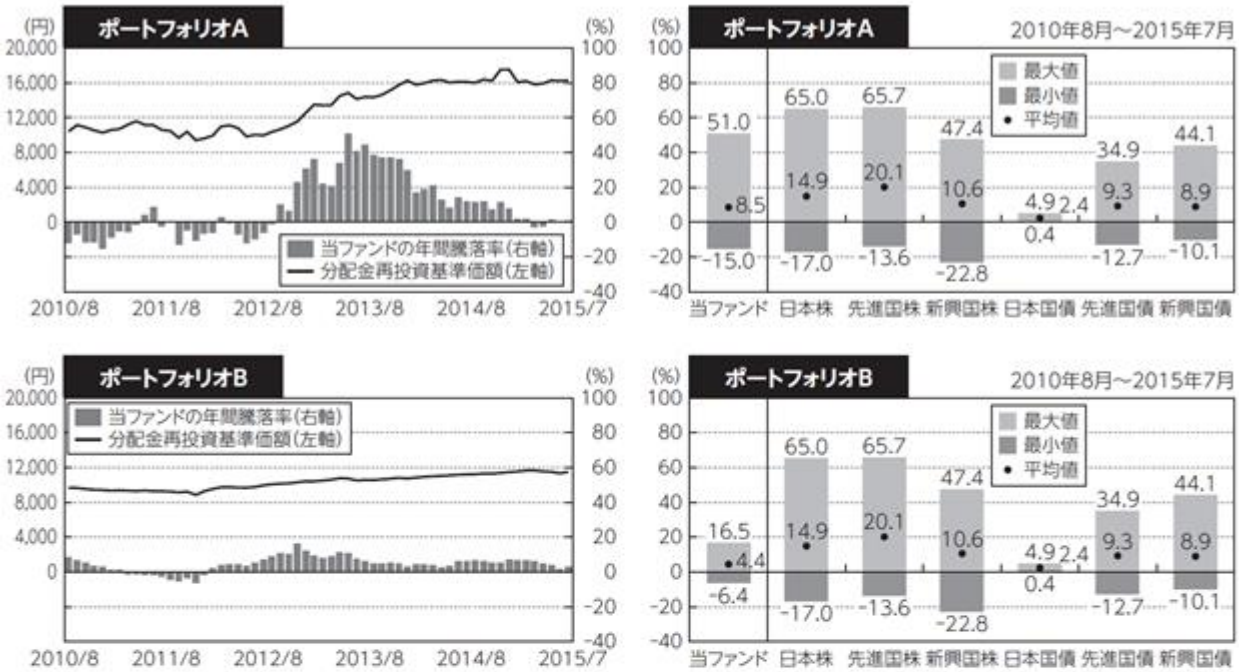
（中略）

（注）リスク管理体制は、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及び分配金再投資基準価額の推移

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



「ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移」の留意点

※1 当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ものであり、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。

※2 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騰落率の比較」の留意点

※1 上記グラフは、当ファンドと代表的な資産クラスの値動きを定量的に比較することを目的として作成したもので、全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※2 2010年8月～2015年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しております。

※3 当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ものであり、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。

*各資産クラスの騰落率を計算するために使用した指数
日本株　…東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、ヘッジなし・円ベース)
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、ヘッジなし・円ベース)
日本国債…シティ日本国債インデックス(円ベース)
先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債…シティ新興国市場国債インデックス(ヘッジなし・円ベース)
(注1)海外の指数は、各資産クラスに為替ヘッジなしによる投資を行うことを想定して、円ベースの指数を採用しております。
(注2)上記各指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はその指数を算出、公表しているそれぞれの主体に帰属します(TOPIX:株式会社東京証券取引所、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックス:MSCI Inc.、シティ日本国債インデックス、シティ世界国債インデックス、シティ新興国市場国債インデックス:Citigroup Index LLC)。また、それぞれの主体は当ファンドの運用に関して一切の責任を負うものではありません。

上記の分配金再投資基準価額および年間騰落率はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

（訂正前）

（前略）

①個人の受益者に対する課税

（中略）

c.少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合
公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。
少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が５年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

（注）上記は、平成27年１月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
買取請求時における課税上の取扱いについては、販売会社へお問合せください。

（訂正後）

（前略）

①個人の受益者に対する課税

（中略）

c.少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合
公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。
少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円（平成28年１月１日以降、120万円）の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が５年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。
平成28年４月１日以降、０歳から19歳までの未成年者の方を対象とした「ジュニアＮＩＳＡ（ニーサ）」が開始され、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が５年間、原則非課税となります。
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

（注）上記は、平成27年７月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容、税率等が変更される場合があります。
買取請求時における課税上の取扱いについては、販売会社へお問合せください。

５【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報　第１ ファンドの状況　５ 運用状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）
以下は、平成27年 7月31日現在の運用状況であります。また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】
ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

資産の種類	国名/地域名	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券	アメリカ	99,114,464	21.87
	メキシコ	28,981,456	6.39
	ドイツ	3,497,598	0.77
	イタリア	104,187,819	23.00
	フランス	12,791,777	2.82
	スペイン	46,667,117	10.30
	イギリス	55,674,391	12.28
	ハンガリー	1,102,795	0.24
	ポーランド	20,186,712	4.45
	小計	372,204,129	82.12
特殊債券	アメリカ	13,429,267	2.96
社債券	アメリカ	46,023,343	10.16
	ルクセンブルク	467,847	0.10
	オーストラリア	5,566,221	1.23
	小計	52,057,411	11.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	15,547,211	3.43
合計(純資産総額)		453,238,018	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	39,413,710	8.69
	買建	ドイツ	230,017,515	50.74
	売建	アメリカ	187,742,292	△41.40
	売建	ドイツ	104,778,637	△23.11
	売建	イギリス	22,524,153	△4.96

（注）その他の資産として、先物取引を利用しております。評価においては、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。

LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオB（為替ヘッジあり）

資産の種類	国名/地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	256,154,797	20.42
	カナダ	14,795,405	1.18
	メキシコ	82,199,045	6.55
	ドイツ	15,739,194	1.25
	イタリア	321,105,900	25.60
	フランス	78,349,633	6.24
	スペイン	98,018,369	7.81
	イギリス	128,479,366	10.24
	ハンガリー	3,032,686	0.24
	ポーランド	56,522,793	4.50
	小計	1,054,397,188	84.03
特殊債券	アメリカ	118,985,278	9.48
社債券	アメリカ	109,255,929	8.71
	ルクセンブルク	1,177,348	0.09
	アイルランド	2,087,817	0.17
	オーストラリア	14,797,872	1.18
	小計	127,318,966	10.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	△45,919,030	△3.66
合計(純資産総額)		1,254,782,402	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	ドイツ	725,439,855	57.81
	売建	アメリカ	367,546,025	△29.29
	売建	ドイツ	393,284,040	△31.33
	売建	イギリス	45,048,307	△3.59
債券オプション取引	売建	アメリカ	19,382	△0.00

（注）その他の資産として、先物取引及びオプション取引を利用しております。評価においては、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）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

a.上位３０銘柄

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	帳簿価額単価(円)	帳簿価額金額(円)	評価額単価(円)	評価額金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	470,000	15,183.76	71,363,680	15,601.88	73,328,851	3.750	2021/5/1	16.18
2	イギリス	国債証券	UK TREASURY	260,000	21,516.33	55,942,460	21,413.22	55,674,391	5.000	2018/3/7	12.28
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	190,000	12,495.57	23,741,594	12,544.51	23,834,576	2.375	2024/8/15	5.26
4	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	150,000	14,895.98	22,343,975	15,026.71	22,540,066	3.750	2018/10/31	4.97
5	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	135,000	15,018.02	20,274,330	15,023.45	20,281,661	5.500	2017/7/30	4.47
6	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	600,000	3,253.28	19,519,705	3,364.45	20,186,712	3.250	2025/7/25	4.45
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	150,000	12,155.92	18,233,880	12,226.17	18,339,264	1.750	2022/3/31	4.05
8	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	85,000	17,283.68	14,691,136	18,882.96	16,050,516	5.000	2040/9/1	3.54
9	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	1,771,300	847.66	15,014,701	862.41	15,275,883	7.750	2042/11/13	3.37
10	アメリカ	特殊債券	FNMA 30YR AUG FWD	100,000	13,371.12	13,371,124	13,429.26	13,429,267	4.500	2045/8/1	2.96
11	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	80,000	15,796.14	12,636,913	15,989.72	12,791,777	3.250	2021/10/25	2.82
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	100,000	12,404.00	12,404,000	12,416.59	12,416,597	1.500	2019/10/31	2.74
13	アメリカ	国債証券	T-NOTE INFLATION INDEX	100,000	12,234.06	12,209,697	12,089.53	12,134,148	0.250	2025/1/15	2.68
14	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	70,000	17,168.57	12,018,002	17,137.48	11,996,241	7.375	2019/9/4	2.65
15	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	1,197,000	788.40	9,437,174	792.98	9,492,044	6.500	2022/6/9	2.09
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	70,000	12,447.12	8,712,986	12,462.62	8,723,839	1.625	2019/12/31	1.92
17	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP	50,000	15,956.05	7,978,027	15,905.01	7,952,506	5.125	2019/10/23	1.75
18	アメリカ	社債券	WACHOVIA CAP TRUST FRN	60,000	12,202.43	7,321,461	12,279.96	7,367,976	5.570	2049/12/31	1.63
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	40,000	15,902.70	6,361,082	16,573.58	6,629,433	4.500	2024/3/1	1.46
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	40,000	15,176.85	6,070,740	15,797.77	6,319,108	3.750	2024/9/1	1.39
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	50,000	12,346.82	6,173,412	12,403.03	6,201,515	2.250	2024/11/15	1.37
22	オーストラリア	社債券	RIO TINTO FIN USA LTD	40,000	14,074.20	5,629,680	13,915.55	5,566,221	6.500	2018/7/15	1.23

23	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	40,000	12,422.89	4,969,157	12,466.50	4,986,601	2.000	2021/10/31	1.10
24	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	30,000	13,361.96	4,008,588	13,300.31	3,990,094	4.500	2022/1/24	0.88
25	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	20,000	18,045.65	3,609,131	19,226.95	3,845,390	5.150	2044/10/31	0.85
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	30,000	12,642.39	3,792,717	12,687.93	3,806,380	2.500	2024/5/15	0.84
27	アメリカ	国債証券	T-NOTE INFLATION INDEX	30,000	12,498.27	3,808,450	12,358.93	3,787,471	0.375	2023/7/15	0.84
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	30,000	12,196.69	3,659,008	12,526.09	3,757,829	3.000	2045/5/15	0.83
29	ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	20,000	16,883.09	3,376,618	17,487.99	3,497,598	2.500	2046/8/15	0.77
30	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,000	14,768.32	2,953,665	14,874.25	2,974,851	6.250	2041/2/1	0.66

（注１）変動利付債券は平成27年7月末現在の利率です。
（注２）平成27年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

b.種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	82.12
特殊債券	2.96
社債券	11.49
合計	96.57

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）

a.上位３０銘柄

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
1	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	1,250,000	15,183.76	189,797,070	15,601.88	195,023,540	3.750	2021/5/1	15.54
2	イギリス	国債証券	UK TREASURY	600,000	21,517.49	129,104,951	21,413.22	128,479,366	5.000	2018/3/7	10.24
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	700,000	12,155.92	85,091,440	12,226.17	85,583,239	1.750	2022/3/31	6.82
4	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	490,000	15,795.87	77,399,763	15,989.72	78,349,633	3.250	2021/10/25	6.24
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	510,000	12,441.30	63,450,675	12,433.07	63,408,666	0.625	2016/7/15	5.05
6	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	370,000	15,180.51	56,167,920	15,797.77	58,451,751	3.750	2024/9/1	4.66
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	1,680,000	3,253.31	54,655,722	3,364.45	56,522,793	3.250	2025/7/25	4.50
8	アメリカ	特殊債券	FNMA 30YR AUG FWD	400,000	13,371.12	53,484,497	13,429.26	53,717,070	4.500	2045/8/1	4.28
9	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	310,000	15,018.02	46,555,870	15,023.45	46,572,703	5.500	2017/7/30	3.71
10	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	4,895,500	847.66	41,497,471	862.41	42,219,322	7.750	2042/11/13	3.36
11	アメリカ	特殊債券	FNMA 15YR AUG FWD	300,000	12,791.62	38,374,875	12,835.72	38,507,160	3.000	2030/8/1	3.07
12	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	240,000	14,895.98	35,750,359	15,026.71	36,064,105	3.750	2018/10/31	2.87
13	アメリカ	国債証券	T-NOTE INFLATION INDEX	280,000	12,234.06	34,187,158	12,089.53	33,975,618	0.250	2025/1/15	2.71
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	170,000	15,902.70	27,034,599	16,573.58	28,175,089	4.500	2024/3/1	2.25
15	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	3,518,000	788.40	27,735,988	792.98	27,897,253	6.500	2022/6/9	2.22
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	140,000	17,283.69	24,197,166	18,882.96	26,436,145	5.000	2040/9/1	2.11

17	ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	90,000	16,883.09	15,194,782	17,487.99	15,739,194	2.500	2046/8/15	1.25
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	110,000	13,659.90	15,025,895	14,056.25	15,461,876	3.625	2044/2/15	1.23
19	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	90,000	17,168.57	15,451,716	17,137.48	15,423,738	7.375	2019/9/4	1.23
20	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	80,000	18,045.65	14,436,524	19,226.95	15,381,561	5.150	2044/10/31	1.23
21	カナダ	国債証券	CANADIAN GOVT	140,000	10,559.17	14,782,841	10,568.14	14,795,405	4.250	2018/6/1	1.18
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	110,000	12,516.87	13,768,564	12,513.50	13,764,854	1.500	2018/12/31	1.10
23	アメリカ	特殊債券	FNMA 30YR AUG FWD	100,000	13,671.53	13,671,534	13,713.59	13,713,591	5.000	2045/8/1	1.09
24	アメリカ	特殊債券	FHLMC GOLD 15YR AUG FWD	100,000	13,012.57	13,012,571	13,047.45	13,047,457	3.500	2030/8/1	1.04
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000	16,937.72	11,856,405	18,599.10	13,019,375	4.750	2044/9/1	1.04
26	アメリカ	国債証券	US T STRIP PRINC	230,000	5,006.55	11,515,071	5,261.56	12,101,602	—	2043/5/15	0.96
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	90,000	12,455.84	11,210,260	12,809.55	11,528,596	3.125	2044/8/15	0.92
28	アメリカ	社債券	WACHOVIA CAP TRUST FRN	90,000	12,202.43	10,982,191	12,279.96	11,051,964	5.570	2049/12/31	0.88
29	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	80,000	13,361.96	10,689,568	13,300.31	10,640,250	4.500	2022/1/24	0.85
30	オーストラリア	社債券	WESTPAC BANKING	100,000	10,602.00	10,602,004	10,623.20	10,623,207	7.250	2020/2/11	0.85

（注１）変動利付債券は平成27年7月末現在の利率です。
（注２）平成27年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

b.種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.03
特殊債券	9.48
社債券	10.15
合計	103.66

②【投資不動産物件】

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（%）

債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR 1509	売建	5	米ドル	595,546.9	73,871,638	597,343.75	74,094,519	△16.34
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR 1509	売建	6	米ドル	756,871.78	93,882,375	761,062.5	94,402,192	△20.82
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 20YR 1509	売建	1	米ドル	151,093.75	18,741,668	155,156.25	19,245,581	△4.24
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US UL 1509	買建	2	米ドル	309,687.5	38,413,637	317,750	39,413,710	8.69
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 5YR 1509	買建	13	ユーロ	1,680,380	228,111,585	1,694,420	230,017,515	50.74
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 10YR 1509	売建	5	ユーロ	757,608.35	102,845,333	771,850	104,778,637	△23.11
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	UK 10YR 1509	売建	1	英ポンド	115,410	22,324,910	116,440	22,524,153	△4.96

（注１）評価においては、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。
（注２）評価額は、平成27年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR 1509	売建	11	米ドル	1,310,203.18	162,517,602	1,314,156.25	163,007,941	△12.99
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR 1509	売建	13	米ドル	1,637,392.69	203,102,190	1,648,968.75	204,538,084	△16.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BTP10YR 1509	売建	2	ユーロ	259,360	35,208,120	272,140	36,943,005	△2.94
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 5YR 1509	買建	41	ユーロ	5,299,660	719,428,845	5,343,940	725,439,855	57.81
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 10YR 1509	売建	16	ユーロ	2,425,111.75	329,208,920	2,469,920	335,291,640	△26.72
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 30YR 1509	売建	1	ユーロ	150,300	20,403,225	155,060	21,049,395	△1.67
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	UK 10YR 1509	売建	2	英ポンド	230,820	44,649,821	232,880	45,048,307	△3.59
債券オプション	アメリカ	シカゴ商品取引所	TYU5 C 0821	売建	2	米ドル	593.76	73,648	156.26	19,382	△0.00

（注１）評価においては、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。
（注２）評価額は、平成27年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

期間末	純資産総額（円）		基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第14特定期間末　（平成17年12月19日）	1,389,956,065	1,412,420,318	10,183	10,343
第15特定期間末　（平成18年 6月19日）	1,289,310,930	1,309,924,636	10,330	10,490
第16特定期間末　（平成18年12月18日）	1,300,892,494	1,320,117,868	10,986	11,146

第17特定期間末　(平成19年 6月18日)	1,248,111,780	1,265,880,208	11,308	11,468
第18特定期間末　(平成19年12月18日)	1,146,895,802	1,163,652,969	11,184	11,344
第19特定期間末　(平成20年 6月18日)	1,100,550,196	1,116,681,095	10,948	11,108
第20特定期間末　(平成20年12月18日)	765,788,814	780,955,655	8,263	8,423
第21特定期間末　(平成21年 6月18日)	767,998,939	782,075,125	8,784	8,944
第22特定期間末　(平成21年12月18日)	730,883,387	744,279,075	8,904	9,064
第23特定期間末　(平成22年 6月18日)	613,737,515	626,237,806	7,940	8,100
第24特定期間末　(平成22年12月20日)	538,557,437	549,948,676	7,630	7,790
第25特定期間末　(平成23年 6月20日)	528,393,531	539,282,305	7,792	7,952
第26特定期間末　(平成23年12月19日)	416,795,642	427,102,099	6,671	6,831
第27特定期間末　(平成24年 6月18日)	409,270,555	418,816,041	6,953	7,113
第28特定期間末　(平成24年12月18日)	444,047,668	453,055,526	8,021	8,181
第29特定期間末　(平成25年 6月18日)	467,159,992	475,463,267	9,225	9,385
第30特定期間末　(平成25年12月18日)	492,829,340	500,619,322	10,282	10,442
第31特定期間末　(平成26年 6月18日)	482,847,590	490,433,011	10,258	10,418
第32特定期間末　(平成26年12月18日)	500,854,869	508,264,107	10,905	11,065
第33特定期間末　(平成27年 6月18日)	462,936,675	470,216,406	10,218	10,378
平成26年 7月末日	481,869,366	—	10,228	—
8月末日	475,105,360	—	10,160	—
9月末日	482,611,955	—	10,323	—
10月末日	478,290,535	—	10,230	—
11月末日	507,701,631	—	11,036	—
12月末日	504,401,936	—	10,963	—
平成27年 1月末日	463,220,808	—	10,059	—
2月末日	464,582,264	—	10,136	—
3月末日	450,592,726	—	9,807	—
4月末日	452,936,477	—	9,874	—
5月末日	459,434,785	—	10,101	—
6月末日	452,942,311	—	9,984	—
7月末日	453,238,018	—	10,026	—

（注１）分配付純資産総額は、各特定期間末の純資産総額に、各特定期間中に支払われた分配金の総額を加算しております。
（注２）基準価額は1万口当たりの純資産額です。

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）

期間末	純資産総額（円）		基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第14特定期間末　(平成17年12月19日)	3,096,011,867	3,117,659,229	8,763	8,823
第15特定期間末　(平成18年 6月19日)	2,594,786,877	2,613,917,314	8,452	8,512
第16特定期間末　(平成18年12月18日)	2,503,753,522	2,521,752,173	8,420	8,480
第17特定期間末　(平成19年 6月18日)	2,315,948,362	2,333,445,124	8,017	8,077
第18特定期間末　(平成19年12月18日)	2,226,461,216	2,243,246,741	7,965	8,025
第19特定期間末　(平成20年 6月18日)	1,915,063,755	1,930,415,102	7,494	7,554
第20特定期間末　(平成20年12月18日)	1,586,927,553	1,600,401,346	7,331	7,391
第21特定期間末　(平成21年 6月18日)	1,574,808,615	1,587,620,346	7,398	7,458
第22特定期間末　(平成21年12月18日)	1,628,145,916	1,640,544,773	7,905	7,965
第23特定期間末　(平成22年 6月18日)	1,512,789,574	1,524,074,970	8,079	8,139
第24特定期間末　(平成22年12月20日)	1,472,917,378	1,484,053,648	7,965	8,025
第25特定期間末　(平成23年 6月20日)	1,428,516,376	1,439,515,848	7,838	7,898
第26特定期間末　(平成23年12月19日)	1,289,359,132	1,299,842,720	7,673	7,733

第27特定期間末　（平成24年 6月18日）	1,334,932,451	1,344,916,841	8,054	8,114
第28特定期間末　（平成24年12月18日）	1,396,211,916	1,406,066,089	8,527	8,587
第29特定期間末　（平成25年 6月18日）	1,352,401,341	1,361,815,006	8,662	8,722
第30特定期間末　（平成25年12月18日）	1,352,540,877	1,361,848,333	8,752	8,812
第31特定期間末　（平成26年 6月18日）	1,263,953,266	1,272,375,901	9,010	9,070
第32特定期間末　（平成26年12月18日）	1,268,642,039	1,277,009,251	9,142	9,202
第33特定期間末　（平成27年 6月18日）	1,236,677,924	1,245,005,356	9,004	9,064
平成26年 7月末日	1,265,349,435	―	9,028	―
8月末日	1,267,320,739	―	9,044	―
9月末日	1,274,932,646	―	9,080	―
10月末日	1,270,236,494	―	9,062	―
11月末日	1,270,421,025	―	9,152	―
12月末日	1,276,057,523	―	9,184	―
平成27年 1月末日	1,284,889,950	―	9,240	―
2月末日	1,303,103,722	―	9,328	―
3月末日	1,304,666,758	―	9,305	―
4月末日	1,283,395,037	―	9,219	―
5月末日	1,261,276,808	―	9,184	―
6月末日	1,239,324,221	―	9,013	―
7月末日	1,254,782,402	―	9,155	―

（注１）分配付純資産総額は、各特定期間末の純資産総額に、各特定期間中に支払われた分配金の総額を加算しております。
（注２）基準価額は1万口当たりの純資産額です。

②【分配の推移】

LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオA（為替ヘッジなし）

期	期間	1万口当たりの分配金（円）
第14特定期間	平成17年 6月21日～平成17年12月19日	160
第15特定期間	平成17年12月20日～平成18年 6月19日	160
第16特定期間	平成18年 6月20日～平成18年12月18日	160
第17特定期間	平成18年12月19日～平成19年 6月18日	160
第18特定期間	平成19年 6月19日～平成19年12月18日	160
第19特定期間	平成19年12月19日～平成20年 6月18日	160
第20特定期間	平成20年 6月19日～平成20年12月18日	160
第21特定期間	平成20年12月19日～平成21年 6月18日	160
第22特定期間	平成21年 6月19日～平成21年12月18日	160
第23特定期間	平成21年12月19日～平成22年 6月18日	160
第24特定期間	平成22年 6月19日～平成22年12月20日	160
第25特定期間	平成22年12月21日～平成23年 6月20日	160
第26特定期間	平成23年 6月21日～平成23年12月19日	160
第27特定期間	平成23年12月20日～平成24年 6月18日	160
第28特定期間	平成24年 6月19日～平成24年12月18日	160
第29特定期間	平成24年12月19日～平成25年 6月18日	160
第30特定期間	平成25年 6月19日～平成25年12月18日	160
第31特定期間	平成25年12月19日～平成26年 6月18日	160
第32特定期間	平成26年 6月19日～平成26年12月18日	160
第33特定期間	平成26年12月19日～平成27年 6月18日	160

LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオB（為替ヘッジあり）

期	期間	1万口当たりの分配金（円）

第14特定期間	平成17年 6月21日～平成17年12月19日	60
第15特定期間	平成17年12月20日～平成18年 6月19日	60
第16特定期間	平成18年 6月20日～平成18年12月18日	60
第17特定期間	平成18年12月19日～平成19年 6月18日	60
第18特定期間	平成19年 6月19日～平成19年12月18日	60
第19特定期間	平成19年12月19日～平成20年 6月18日	60
第20特定期間	平成20年 6月19日～平成20年12月18日	60
第21特定期間	平成20年12月19日～平成21年 6月18日	60
第22特定期間	平成21年 6月19日～平成21年12月18日	60
第23特定期間	平成21年12月19日～平成22年 6月18日	60
第24特定期間	平成22年 6月19日～平成22年12月20日	60
第25特定期間	平成22年12月21日～平成23年 6月20日	60
第26特定期間	平成23年 6月21日～平成23年12月19日	60
第27特定期間	平成23年12月20日～平成24年 6月18日	60
第28特定期間	平成24年 6月19日～平成24年12月18日	60
第29特定期間	平成24年12月19日～平成25年 6月18日	60
第30特定期間	平成25年 6月19日～平成25年12月18日	60
第31特定期間	平成25年12月19日～平成26年 6月18日	60
第32特定期間	平成26年 6月19日～平成26年12月18日	60
第33特定期間	平成26年12月19日～平成27年 6月18日	60

③【収益率の推移】

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

期	期間	収益率（％）
第14特定期間	平成17年 6月21日～平成17年12月19日	4.64
第15特定期間	平成17年12月20日～平成18年 6月19日	3.01
第16特定期間	平成18年 6月20日～平成18年12月18日	7.90
第17特定期間	平成18年12月19日～平成19年 6月18日	4.39
第18特定期間	平成19年 6月19日～平成19年12月18日	0.32
第19特定期間	平成19年12月19日～平成20年 6月18日	△0.68
第20特定期間	平成20年 6月19日～平成20年12月18日	△23.06
第21特定期間	平成20年12月19日～平成21年 6月18日	8.24
第22特定期間	平成21年 6月19日～平成21年12月18日	3.19
第23特定期間	平成21年12月19日～平成22年 6月18日	△9.03
第24特定期間	平成22年 6月19日～平成22年12月20日	△1.89
第25特定期間	平成22年12月21日～平成23年 6月20日	4.22
第26特定期間	平成23年 6月21日～平成23年12月19日	△12.33
第27特定期間	平成23年12月20日～平成24年 6月18日	6.63
第28特定期間	平成24年 6月19日～平成24年12月18日	17.66
第29特定期間	平成24年12月19日～平成25年 6月18日	17.01
第30特定期間	平成25年 6月19日～平成25年12月18日	13.19
第31特定期間	平成25年12月19日～平成26年 6月18日	1.32
第32特定期間	平成26年 6月19日～平成26年12月18日	7.87
第33特定期間	平成26年12月19日～平成27年 6月18日	△4.83

（注）収益率は、特定期間末の基準価額（分配付きの額。）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）

期	期間	収益率（％）

第14特定期間	平成17年 6月21日～平成17年12月19日	△1.15
第15特定期間	平成17年12月20日～平成18年 6月19日	△2.86
第16特定期間	平成18年 6月20日～平成18年12月18日	0.33
第17特定期間	平成18年12月19日～平成19年 6月18日	△4.07
第18特定期間	平成19年 6月19日～平成19年12月18日	0.10
第19特定期間	平成19年12月19日～平成20年 6月18日	△5.16
第20特定期間	平成20年 6月19日～平成20年12月18日	△1.37
第21特定期間	平成20年12月19日～平成21年 6月18日	1.73
第22特定期間	平成21年 6月19日～平成21年12月18日	7.66
第23特定期間	平成21年12月19日～平成22年 6月18日	2.96
第24特定期間	平成22年 6月19日～平成22年12月20日	△0.67
第25特定期間	平成22年12月21日～平成23年 6月20日	△0.84
第26特定期間	平成23年 6月21日～平成23年12月19日	△1.34
第27特定期間	平成23年12月20日～平成24年 6月18日	5.75
第28特定期間	平成24年 6月19日～平成24年12月18日	6.62
第29特定期間	平成24年12月19日～平成25年 6月18日	2.29
第30特定期間	平成25年 6月19日～平成25年12月18日	1.73
第31特定期間	平成25年12月19日～平成26年 6月18日	3.63
第32特定期間	平成26年 6月19日～平成26年12月18日	2.13
第33特定期間	平成26年12月19日～平成27年 6月18日	△0.85

（注）収益率は、特定期間末の基準価額（分配付きの額。）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前特定期間末基準価額」といいます。）を控除した額を前特定期間末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。

（４）【設定及び解約の実績】

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

期	設定口数（口）	解約口数（口）
第14特定期間	28,712,159	261,997,701
第15特定期間	24,023,108	140,868,299
第16特定期間	21,397,413	85,355,162
第17特定期間	24,433,554	104,851,482
第18特定期間	16,028,569	94,284,088
第19特定期間	13,125,347	33,384,942
第20特定期間	15,162,655	93,617,849
第21特定期間	17,751,175	70,180,118
第22特定期間	14,042,674	67,529,464
第23特定期間	14,918,532	62,837,830
第24特定期間	13,383,388	80,514,050
第25特定期間	15,137,113	42,804,144
第26特定期間	13,417,469	66,757,495
第27特定期間	12,059,973	48,276,156
第28特定期間	11,659,255	46,662,856
第29特定期間	9,714,369	56,867,005
第30特定期間	7,668,267	34,801,460
第31特定期間	7,661,550	16,256,628
第32特定期間	5,610,887	17,022,370
第33特定期間	6,533,594	12,767,780

（注）当該各期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）

期	設定口数（口）	解約口数（口）

第14特定期間	22,278,489	411,697,014
第15特定期間	18,705,096	481,576,984
第16特定期間	17,432,274	113,941,128
第17特定期間	17,651,348	102,295,285
第18特定期間	18,185,299	111,660,998
第19特定期間	16,320,482	256,129,617
第20特定期間	15,062,874	406,031,674
第21特定期間	13,227,090	49,241,833
第22特定期間	12,091,857	81,006,908
第23特定期間	10,528,725	197,696,471
第24特定期間	9,574,384	32,814,945
第25特定期間	9,695,809	36,464,442
第26特定期間	9,720,076	151,819,990
第27特定期間	8,043,121	31,081,298
第28特定期間	7,634,163	27,678,563
第29特定期間	7,087,138	83,219,866
第30特定期間	6,774,092	22,533,630
第31特定期間	5,664,099	148,236,022
第32特定期間	6,653,232	21,800,962
第33特定期間	32,832,265	47,072,534

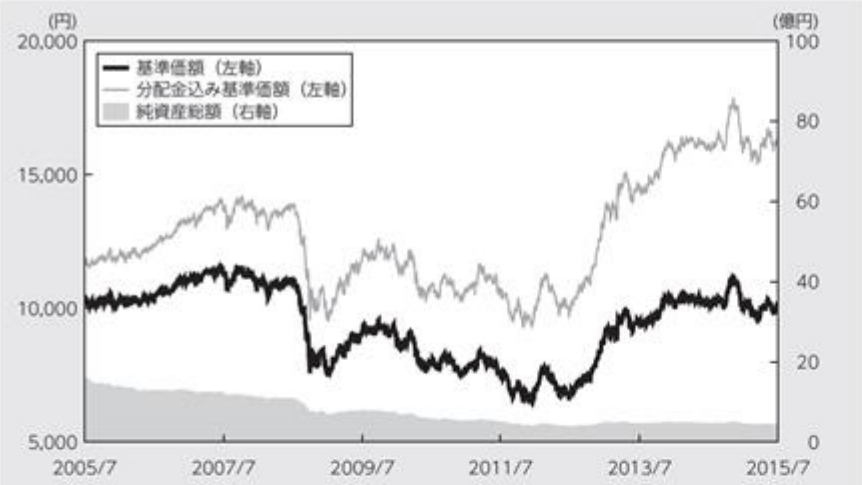
（注）当該各期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

＜参考情報＞

LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオA(為替ヘッジなし)

基準価額・純資産の推移(過去10年間)

(2005年7月末～2015年7月末)



※分配金込み基準価額は、税引前分配金を再投資(複利運用)したと仮定して、委託会社が算出したものです。

基準価額・純資産総額

基準価額	純資産総額
10,026円	5億円

分配の推移

2014年 6 月	80円
2014年 9 月	80円
2014年12月	80円
2015年 3 月	80円
2015年 6 月	80円
直近1年間累計	320円
設定来累計	4,470円

※1万口当たり、税引前
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、または分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

■種類別組入比率

資産	比率(%)
国債証券	82.12
特殊債券	2.96
社債券	11.49
現金・預金・その他の資産	3.43

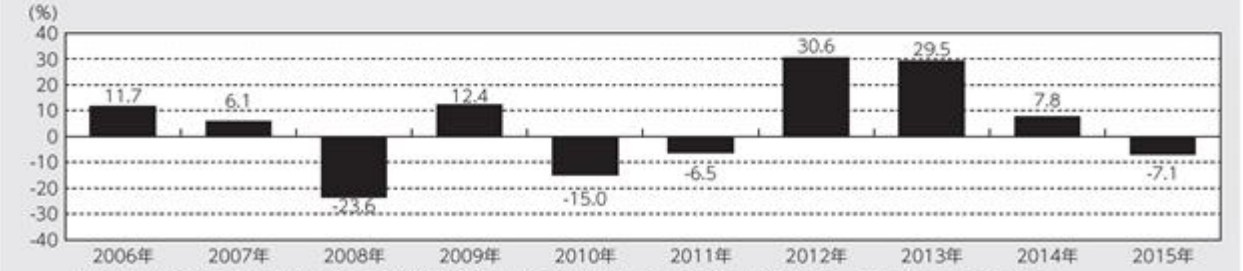
その他投資資産	比率(%)
先物	△10.04

■組入上位銘柄

銘柄	国	種類	利率(%)	償還日	比率(%)
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	3.750	2021年 5 月 1 日	16.18
UK TREASURY	イギリス	国債証券	5.000	2018年 3 月 7 日	12.28
US TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	2.375	2024年 8 月15日	5.26
SPAIN GOVT	スペイン	国債証券	3.750	2018年10月31日	4.97
SPAIN GOVT	スペイン	国債証券	5.500	2017年 7 月30日	4.47
POLAND GOVT	ポーランド	国債証券	3.250	2025年 7 月25日	4.45
US TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	1.750	2022年 3 月31日	4.05
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	5.000	2040年 9 月 1 日	3.54
MEXICAN BONOS DESARR FIX	メキシコ	国債証券	7.750	2042年11月13日	3.37
FNMA 30YR AUG FWD	アメリカ	特殊債券	4.500	2045年 8 月 1 日	2.96

※上記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。

年間収益率の推移



※年間収益率は、税引前分配金を再投資(複利運用)したと仮定して、委託会社が暦年ベースで算出したものです。
※2015年は年初から基準日までの収益率を表示しています。

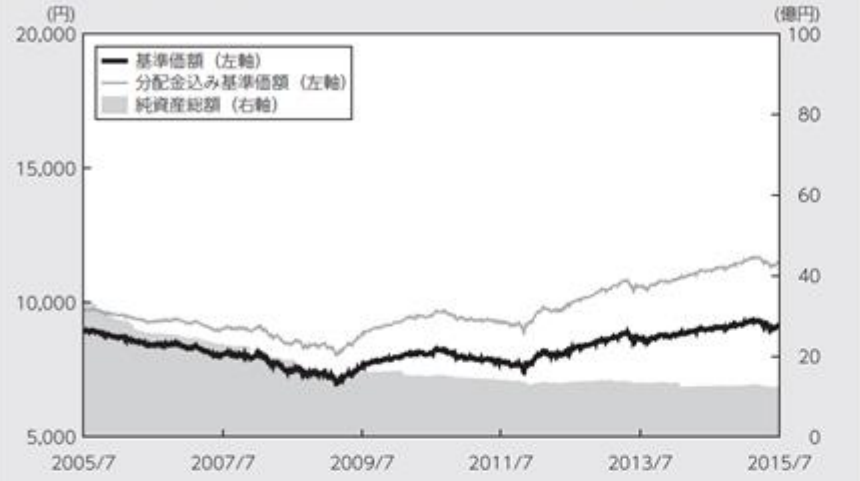
ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
ファンドの運用状況は、委託会社のホームページで確認することができます。

基準日:2015年7月31日

LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオB(為替ヘッジあり)

基準価額・純資産の推移(過去10年間)

(2005年7月末～2015年7月末)



※分配金込み基準価額は、税引前分配金を再投資(複利運用)したと仮定して、委託会社が算出したものです。

基準価額・純資産総額

基準価額	純資産総額
9,155円	13億円

分配の推移

2014年 6 月	30円
2014年 9 月	30円
2014年12月	30円
2015年 3 月	30円
2015年 6 月	30円
直近1年間累計	120円
設定来累計	1,950円

※1万口当たり、税引前
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、または分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

■種類別組入比率

資産	比率(%)
国債証券	84.03
特殊債券	9.48
社債券	10.15
現金・預金・その他の資産	△3.66

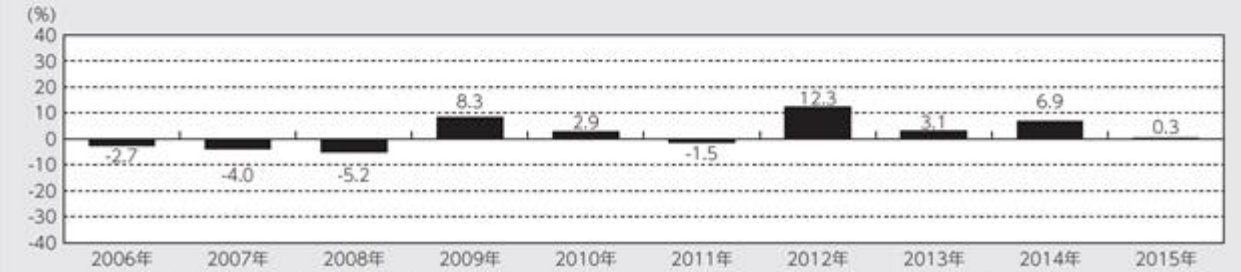
その他投資資産	比率(%)
先物	△6.4
オプション	△0.0

■組入上位銘柄

銘柄	国	種類	利率(%)	償還日	比率(%)
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	3.750	2021年 5 月 1 日	15.54
UK TREASURY	イギリス	国債証券	5.000	2018年 3 月 7 日	10.24
US TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	1.750	2022年 3 月31日	6.82
FRANCE O.A.T.	フランス	国債証券	3.250	2021年10月25日	6.24
US TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	0.625	2016年 7 月15日	5.05
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	3.750	2024年 9 月 1 日	4.66
POLAND GOVT	ポーランド	国債証券	3.250	2025年 7 月25日	4.50
FNMA 30YR AUG FWD	アメリカ	特殊債券	4.500	2045年 8 月 1 日	4.28
SPAIN GOVT	スペイン	国債証券	5.500	2017年 7 月30日	3.71
MEXICAN BONOS DESARR FIX	メキシコ	国債証券	7.750	2042年11月13日	3.36

※上記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。

年間収益率の推移



※年間収益率は、税引前分配金を再投資(複利運用)したと仮定して、委託会社が暦年ベースで算出したものです。
※2015年は年初から基準日までの収益率を表示しています。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
ファンドの運用状況は、委託会社のホームページで確認することができます。

第３【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報　第３ ファンドの経理状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

（１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）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）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成26年12月19日から平成27年 6月18日まで）の財務諸表について、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】
【LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオA（為替ヘッジなし）】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成26年12月18日現在	当期 平成27年 6月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,999,455	7,971,208
金銭信託	721,401	763,708
コール・ローン	26,423,463	946,140
国債証券	417,113,808	383,948,850
特殊債券	50,637,535	13,340,697
社債券	54,144,586	50,418,690
プット・オプション（買）	1,464	―
派生商品評価勘定	10,386,170	14,745,196
未収入金	12,446,381	48,380,797
未収利息	3,467,265	5,850,615
前払費用	579,751	653,410
その他未収収益	232,872	―
差入委託証拠金	21,797,208	18,012,630
流動資産合計	601,951,359	545,031,941
資産合計	601,951,359	545,031,941
負債の部		
流動負債		
コール・オプション（売）	90,941	―
派生商品評価勘定	11,649,549	12,279,813
未払金	83,068,380	63,431,393
未払収益分配金	3,674,317	3,624,443
未払解約金	835,229	1,101,154
未払受託者報酬	66,048	61,598
未払委託者報酬	1,651,294	1,539,832
その他未払費用	60,732	57,033
流動負債合計	101,096,490	82,095,266
負債合計	101,096,490	82,095,266
純資産の部		
元本等		
元本	459,289,657	453,055,471
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	41,565,212	9,881,204
（分配準備積立金）	70,253,265	66,685,963
元本等合計	500,854,869	462,936,675
純資産合計	500,854,869	462,936,675
負債純資産合計	601,951,359	545,031,941

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　平成26年 6月19日 至　平成26年12月18日	当期 自　平成26年12月19日 至　平成27年 6月18日
営業収益		
受取利息	7,797,534	7,518,802
有価証券売買等損益	14,450,528	△7,783,463
派生商品取引等損益	△12,106,101	381,863
為替差損益	31,033,405	△21,110,018
その他収益	232,872	256,965
営業収益合計	41,408,238	△20,735,851
営業費用		
受託者報酬	131,422	124,726
委託者報酬	3,285,597	3,118,044
その他費用	515,738	392,773
営業費用合計	3,932,757	3,635,543
営業利益又は営業損失（△）	37,475,481	△24,371,394
経常利益又は経常損失（△）	37,475,481	△24,371,394
当期純利益又は当期純損失（△）	37,475,481	△24,371,394
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（△）	282,961	△105,545
期首剰余金又は期首欠損金（△）	12,146,450	41,565,212
剰余金増加額又は欠損金減少額	173,706	449,390
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	233,715
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	173,706	215,675
剰余金減少額又は欠損金増加額	538,226	587,818
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	538,226	487,993
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	99,825
分配金	7,409,238	7,279,731
期末剰余金又は期末欠損金（△）	41,565,212	9,881,204

（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 平成26年12月19日　至 平成27年 6月18日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・特殊債券・社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引・オプション取引 個別法に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定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 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（未適用の会計基準等に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

前期 平成26年12月18日現在	当期 平成27年 6月18日現在
1.　特定期間の末日における受益権の総数 459,289,657口	1.　特定期間の末日における受益権の総数 453,055,471口
2.　特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額　1.0905円 (一万口当たり純資産額)　(10,905円)	2.　特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額　1.0218円 (一万口当たり純資産額)　(10,218円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
1.信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。	同左
2.分配金の計算過程	平成26年 6月19日から 平成26年 9月18日まで の計算期間	平成26年12月19日から 平成27年 3月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	3,348,686円	1,737,759円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円	－円

収益調整金額	31,670,890円	31,783,349円
分配準備積立金額	58,187,006円	69,432,718円
当ファンドの分配対象収益額	93,206,582円	102,953,826円
当ファンドの期末残存口数	466,865,145口	456,911,023口
1万口当たり収益分配対象額	1,996.43円	2,253.24円
1万口当たり分配金額	80.00円	80.00円
収益分配金金額	3,734,921円	3,655,288円
	平成26年 9月19日から 平成26年12月18日まで の計算期間	平成27年 3月19日から 平成27年 6月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	3,590,345円	3,876,375円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	13,805,095円	－円
収益調整金額	31,488,479円	32,027,776円
分配準備積立金額	56,532,142円	66,434,031円
当ファンドの分配対象収益額	105,416,061円	102,338,182円
当ファンドの期末残存口数	459,289,657口	453,055,471口
1万口当たり収益分配対象額	2,295.18円	2,258.82円
1万口当たり分配金額	80.00円	80.00円
収益分配金金額	3,674,317円	3,624,443円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	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、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（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引、債券先物オプション取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引、債券先物オプション取引は金利変動リスク、為替予約取引は為替変動リスクを有しております。	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（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引は金利変動リスク、為替予約取引は為替変動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	委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。 ①市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 ②信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。 ③流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	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	国債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定、コール・オプション(売)、プット・オプション(買) デリバティブ取引については、（その他の注記）の3　デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。	国債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の3　デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　元本の移動

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
期首元本額	470,701,140円	459,289,657円
期中追加設定元本額	5,610,887円	6,533,594円
期中解約元本額	17,022,370円	12,767,780円

2　有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 平成26年12月18日現在	当期 平成27年 6月18日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	7,128,202	△13,348,523
特殊債券	205,681	△55,915
社債券	△299,230	△802,375
合計	7,034,653	△14,206,813

3　デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

債券関連

種類	前期 平成26年12月18日現在				当期 平成27年 6月18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								
債券先物取引								
買建	341,738,183	－	343,757,450	2,019,267	275,330,458	－	274,073,573	△1,256,885
売建	476,960,545	－	481,112,079	△4,151,534	280,993,106	－	277,569,636	3,423,470
債券先物オプション取引								
買建								
プット	22,118,480 (74,946)	－	1,464	△73,482	－	－	－	－
売建								
コール	17,460,660 (138,809)	－	90,941	47,868	－	－	－	－
合計	858,277,868	－	824,961,934	△2,157,881	556,323,564	－	551,643,209	2,166,585

（注）時価の算定方法

外国先物取引について

A　外国先物取引について

1）外国先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2）特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

B　外国オプション取引について

1）外国オプション取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2）特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

3）契約額等のうち、(　)内はオプション料であります。

通貨関連

種類	前期 平成26年12月18日現在				当期 平成27年 6月18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								
買建	289,801,329	－	295,960,908	6,159,579	273,409,314	－	284,385,535	10,976,221
米ドル	20,200,857	－	20,177,300	△23,557	34,357,655	－	34,776,195	418,540
ユーロ	269,139,873	－	275,322,940	6,183,067	232,192,157	－	242,472,220	10,280,063
英ポンド	－	－	－	－	6,429,500	－	6,683,301	253,801
スウェーデンクローナ	460,599	－	460,668	69	430,002	－	453,819	23,817
売建	247,404,736	－	252,695,427	△5,290,691	242,395,242	－	253,072,665	△10,677,423
米ドル	191,793,949	－	196,879,301	△5,085,352	126,193,633	－	129,765,550	△3,571,917
メキシコペソ	9,909,359	－	9,590,464	318,895	18,793,370	－	19,599,760	△806,390
ユーロ	－	－	－	－	14,528,919	－	14,964,973	△436,054
英ポンド	33,439,457	－	34,138,440	△698,983	71,723,825	－	77,477,947	△5,754,122
ポーランドズロチ	1,526,771	－	1,566,770	△39,999	6,495,869	－	6,552,270	△56,401
オーストラリアドル	10,735,200	－	10,520,452	214,748	4,659,626	－	4,712,165	△52,539
合計	537,206,065	－	548,656,335	868,888	515,804,556	－	537,458,200	298,798

(注) 時価の算定方法

為替予約取引について

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

①特定期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②特定期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2.特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

次表の通りです。

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	HUNGARY	8,000.00	8,790.80	
		T-NOTE INFLATION INDEX	30,000.00	30,703.40	
		T-NOTE INFLATION INDEX	100,000.00	98,433.55	
		UNITED MEXICAN STATES	16,000.00	16,880.64	
		US TREASURY BOND	10,000.00	8,826.17	
		US TREASURY BOND	10,000.00	9,825.78	
		US TREASURY NOTE	140,000.00	140,000.00	
		US TREASURY NOTE	70,000.00	70,243.35	
		US TREASURY NOTE	40,000.00	40,060.93	
		US TREASURY NOTE	30,000.00	30,576.56	
		US TREASURY NOTE	190,000.00	191,402.73	
		US TREASURY NOTE	50,000.00	49,769.53	
	国債証券小計		694,000.00	695,513.44 (85,826,358)	
	特殊債券	FNMA 30YR JUL FWD	100,000.00	108,109.38	
	特殊債券小計		100,000.00	108,109.38 (13,340,697)	
	社債券	ACTAVIS FUNDING SCS	2,000.00	1,925.66	
		ACTAVIS FUNDING SCS	2,000.00	1,922.98	
		AT&T INC	10,000.00	10,331.40	
		CALIFORNIA RESOURCES CRP	10,000.00	9,075.00	
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	10,000.00	9,075.00	
		CRESTWOOD MIDSTREAM PART	10,000.00	10,362.50	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,000.00	23,812.20	
		JP MORGAN CHASE & CO	30,000.00	32,316.90	
		KRAFT FOODS INC	5,000.00	5,576.35	
		RANGE RESOURCES CORP	10,000.00	10,312.50	
		RIO TINTO FIN USA LTD	40,000.00	45,386.00	
		VERIZON COMMUNICATIONS	20,000.00	21,912.60	
		WACHOVIA CAP TRUST FRN	60,000.00	59,025.00	※
	社債券小計		229,000.00	241,034.09 (29,743,606)	
米ドル小計			1,023,000.00	1,044,656.91 (128,910,661)	

メキシコペソ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	243,600.00	271,014.74	
		MEXICAN BONOS DESARR FIX	1,197,000.00	1,235,232.18	
		MEXICAN BONOS DESARR FIX	1,771,300.00	1,965,275.06	
メキシコペソ小計			3,211,900.00	3,471,521.98 (28,084,612)	
ユーロ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	20,000.00	24,873.80	
		BUONI POLIENNALI	610,000.00	682,291.10	
		BUONI POLIENNALI	40,000.00	46,858.80	
		BUONI POLIENNALI	85,000.00	108,222.00	
		BUONI POLIENNALI	40,000.00	39,838.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	12,477.20	
		FRANCE O.A.T.	80,000.00	93,089.60	
		SPAIN GOVT	140,000.00	154,894.60	
		SPAIN GOVT	150,000.00	164,596.50	
		SPAIN GOVT	20,000.00	26,586.60	
	国債証券小計		1,195,000.00	1,353,728.60 (190,009,346)	
	社債券	CITIGROUP INC	70,000.00	88,530.40	
		GOLDMAN SACHS GROUP	50,000.00	58,770.00	
	社債券小計		120,000.00	147,300.40 (20,675,084)	
ユーロ小計			1,315,000.00	1,501,029.00 (210,684,430)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY	300,000.00	333,708.00	
英ポンド小計			300,000.00	333,708.00 (65,253,262)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVT	440,000.00	437,267.60	
ポーランドズロチ小計			440,000.00	437,267.60 (14,775,272)	
合計 （外貨建証券の邦貨換算額）				447,708,237 (447,708,237)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)備考欄の※の銘柄はハイブリッド優先証券であることを示しています。

有価証券明細表注記
外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券	12銘柄	66.6%	28.8%
	特殊債券	1銘柄	10.3%	
	社債券	13銘柄	23.1%	
メキシコペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	6.3%
ユーロ	国債証券	10銘柄	90.2%	47.0%
	社債券	2銘柄	9.8%	

英ポンド	国債証券	1銘柄	100.0%	14.6%
ポーランドズロチ	国債証券	1銘柄	100.0%	3.3%

第２ 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

債券関連

「(3)注記表（その他の注記）3　デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項　債券関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

通貨関連

「(3)注記表（その他の注記）3　デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項　通貨関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

【ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成26年12月18日現在	当期 平成27年 6月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	22,355,148	10,618,792
コール・ローン	86,576,537	53,860
国債証券	1,084,788,148	1,084,833,673
特殊債券	126,755,138	131,328,705
社債券	128,170,165	121,096,028
コール・オプション（買）	1,106,138	―
プット・オプション（買）	20,024	―
派生商品評価勘定	8,184,758	11,621,042
未収入金	―	217,990,970
未収利息	9,764,764	16,185,988
前払費用	860,180	1,948,755
その他未収収益	597,671	―
差入委託証拠金	30,996,376	43,372,143
流動資産合計	1,500,175,047	1,639,049,956
資産合計	1,500,175,047	1,639,049,956
負債の部		
流動負債		
売付債券	―	13,009,059
コール・オプション（売）	269,111	133,043
プット・オプション（売）	27,840	7,712
派生商品評価勘定	42,499,860	59,770,531
未払金	179,945,162	320,557,071
未払収益分配金	4,163,207	4,120,487
未払解約金	20,156	98,496
未払受託者報酬	171,125	173,629
未払委託者報酬	4,278,110	4,340,772
その他未払費用	158,437	161,232
流動負債合計	231,533,008	402,372,032
負債合計	231,533,008	402,372,032
純資産の部		
元本等		
元本	1,387,735,978	1,373,495,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△119,093,939	△136,817,785
（分配準備積立金）	320,174,653	315,759,972
元本等合計	1,268,642,039	1,236,677,924
純資産合計	1,268,642,039	1,236,677,924
負債純資産合計	1,500,175,047	1,639,049,956

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自　平成26年 6月19日 至　平成26年12月18日	当期 自　平成26年12月19日 至　平成27年 6月18日
営業収益		
受取利息	21,008,956	20,452,458
有価証券売買等損益	40,444,655	△26,927,471
派生商品取引等損益	△31,572,501	3,625,703
為替差損益	6,106,660	1,157,700
その他収益	597,671	675,712
営業収益合計	36,585,441	△1,015,898
営業費用		
受託者報酬	343,410	345,001
委託者報酬	8,585,268	8,625,010
その他費用	817,500	669,257
営業費用合計	9,746,178	9,639,268
営業利益又は営業損失（△）	26,839,263	△10,655,166
経常利益又は経常損失（△）	26,839,263	△10,655,166
当期純利益又は当期純損失（△）	26,839,263	△10,655,166
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（△）	72,382	△115,595
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△138,930,442	△119,093,939
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,063,057	3,498,107
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,063,057	3,498,107
剰余金減少額又は欠損金増加額	626,223	2,354,950
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	626,223	2,354,950
分配金	8,367,212	8,327,432
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△119,093,939	△136,817,785

（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 平成26年12月19日　至 平成27年 6月18日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・特殊債券・社債券・売付債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引・オプション取引 個別法に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定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 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（未適用の会計基準等に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

前期 平成26年12月18日現在	当期 平成27年 6月18日現在
1.　特定期間の末日における受益権の総数 1,387,735,978口	1.　特定期間の末日における受益権の総数 1,373,495,709口
2.　元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 119,093,939円	2.　元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 136,817,785円
3.　特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額　0.9142円 (一万口当たり純資産額)　(9,142円)	3.　特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額　0.9004円 (一万口当たり純資産額)　(9,004円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
1.信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。	同左
2.分配金の計算過程	平成26年 6月19日から 平成26年 9月18日まで の計算期間	平成26年12月19日から 平成27年 3月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	7,698,633円	8,214,103円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円	－円
収益調整金額	34,899,597円	42,168,303円
分配準備積立金額	316,775,275円	317,273,014円
当ファンドの分配対象収益額	359,373,505円	367,655,420円
当ファンドの期末残存口数	1,401,335,083口	1,402,315,141口
1万口当たり収益分配対象額	2,564.49円	2,621.76円
1万口当たり分配金額	30.00円	30.00円
収益分配金金額	4,204,005円	4,206,945円
	平成26年 9月19日から 平成26年12月18日まで の計算期間	平成27年 3月19日から 平成27年 6月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	8,055,298円	6,460,428円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円	－円
収益調整金額	35,444,145円	42,566,194円
分配準備積立金額	316,282,562円	313,420,031円
当ファンドの分配対象収益額	359,782,005円	362,446,653円
当ファンドの期末残存口数	1,387,735,978口	1,373,495,709口
1万口当たり収益分配対象額	2,592.56円	2,638.85円
1万口当たり分配金額	30.00円	30.00円
収益分配金金額	4,163,207円	4,120,487円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	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、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（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減を目的として、為替予約取引を、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引、債券先物オプション取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引、債券先物オプション取引は金利変動リスク、為替予約取引は為替変動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	委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。 ①市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 ②信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。 ③流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。	同左

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	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	国債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定、コール・オプション(買)、コール・オプション(売)、プット・オプション(買)、プット・オプション(売) デリバティブ取引については、（その他の注記）の3　デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。	国債証券、特殊債券、社債券、売付債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定、コール・オプション(売)、プット・オプション(売) デリバティブ取引については、（その他の注記）の3　デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　元本の移動

項目	前期 自 平成26年 6月19日 至 平成26年12月18日	当期 自 平成26年12月19日 至 平成27年 6月18日
期首元本額	1,402,883,708円	1,387,735,978円
期中追加設定元本額	6,653,232円	32,832,265円
期中解約元本額	21,800,962円	47,072,534円

2　有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期 平成26年12月18日現在	当期 平成27年 6月18日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	21,573,221	△47,928,508
特殊債券	280,422	△574,327
社債券	△87,286	△2,278,706
売付債券	―	△38,563

合計	**21,766,357**	**△50,820,104**

3　デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

債券関連

種類	前期 平成26年12月18日現在				当期 平成27年 6月18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								
債券先物取引								
買建	853,678,116	－	856,512,504	2,834,388	745,644,253	－	743,860,277	△1,783,976
売建	1,089,832,241	－	1,095,919,663	△6,087,422	739,572,961	－	730,832,886	8,740,075
債券先物オプション取引								
買建								
コール	50,481,500 (285,117)	－	1,106,138	821,021	－	－	－	－
プット	52,051,040 (194,498)	－	20,024	△174,474	－	－	－	－
売建								
コール	47,868,340 (253,107)	－	269,111	△16,004	86,133,200 (246,724)	－	133,043	113,681
プット	44,007,990 (165,877)	－	27,840	138,037	15,054,800 (26,592)	－	7,712	18,880
合計	2,137,919,227	－	1,953,855,280	△2,484,454	1,586,405,214	－	1,474,833,918	7,088,660

（注）時価の算定方法

A　外国先物取引について

1）外国先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2）特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

B　外国オプション取引について

1）外国オプション取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2）特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

3）契約額等のうち、(　)内はオプション料であります。

通貨関連

種類	前期 平成26年12月18日現在				当期 平成27年 6月18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								
買建	142,865,878	－	142,749,997	△115,881	101,867,653	－	103,126,166	1,258,513
米ドル	78,882,220	－	79,522,300	640,080	74,663,400	－	75,095,790	432,390
ユーロ	62,704,501	－	61,948,350	△756,151	10,108,354	－	10,245,550	137,196
英ポンド	－	－	－	－	13,080,620	－	13,672,400	591,780
スウェーデンクローナ	1,279,157	－	1,279,347	190	1,194,184	－	1,260,326	66,142
オーストラリアドル	－	－	－	－	2,821,095	－	2,852,100	31,005
売建	1,291,900,368	－	1,322,846,555	△30,946,187	1,306,247,772	－	1,362,611,873	△56,364,101
米ドル	330,974,396	－	339,451,840	△8,477,444	287,200,888	－	295,470,591	△8,269,703

カナダドル	14,223,057	－	14,405,961	△182,904	13,867,011	－	14,251,773	△384,762
メキシコペソ	31,349,481	－	30,340,618	1,008,863	55,239,819	－	57,610,061	△2,370,242
ユーロ	826,578,308	－	849,639,538	△23,061,230	761,721,202	－	795,302,727	△33,581,525
英ポンド	39,702,497	－	40,532,396	△829,899	139,092,970	－	150,251,855	△11,158,885
デンマーククローネ	2,873,475	－	2,952,000	△78,525	2,701,665	－	2,824,500	△122,835
ポーランドズロチ	6,021,686	－	6,179,444	△157,758	18,244,168	－	18,402,576	△158,408
オーストラリアドル	40,177,468	－	39,344,758	832,710	28,180,049	－	28,497,790	△317,741
合計	1,434,766,246	－	1,465,596,552	△31,062,068	1,408,115,425	－	1,465,738,039	△55,105,588

（注）時価の算定方法

為替予約取引について

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

①特定期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②特定期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2.特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

次表の通りです。

通貨	種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	HUNGARY	22,000.00	24,174.70	
		T-NOTE INFLATION INDEX	280,000.00	275,613.98	
		UNITED MEXICAN STATES	47,000.00	49,586.88	
		US T STRIP PRINC	230,000.00	92,833.52	
		US TREASURY BOND	110,000.00	121,137.50	
		US TREASURY BOND	60,000.00	63,128.90	
		US TREASURY BOND	90,000.00	90,376.17	
		US TREASURY BOND	40,000.00	35,304.68	
		US TREASURY BOND	40,000.00	39,303.12	
		US TREASURY NOTE	320,000.00	322,912.49	
		US TREASURY NOTE	520,000.00	520,000.00	
		US TREASURY NOTE	100,000.00	98,167.96	
	国債証券小計		1,859,000.00	1,732,539.90 (213,795,423)	
	特殊債券	FHLMC GOLD 15YR JUL FWD	100,000.00	105,355.50	
		FNMA 15YR JUL FWD	300,000.00	310,646.55	
		FNMA 15YR JUL FWD	100,000.00	105,421.88	
		FNMA 30YR JUL FWD	400,000.00	432,437.52	
		FNMA 30YR JUL FWD	100,000.00	110,390.62	
	特殊債券小計		1,000,000.00	1,064,252.07 (131,328,705)	
	社債券	ACTAVIS FUNDING SCS	2,000.00	1,963.66	
		ACTAVIS FUNDING SCS	4,000.00	3,851.32	
		ACTAVIS FUNDING SCS	4,000.00	3,845.96	
		AT&T INC	30,000.00	30,994.20	
		ATWOOD OCEANICS INC	10,000.00	9,787.50	
		CALIFORNIA RESOURCES CRP	20,000.00	18,150.00	
		CHESAPEAKE ENERGY CORP	20,000.00	18,150.00	
		CRESTWOOD MIDSTREAM PART	20,000.00	20,725.00	
		ENTERPRISE PRODUCTS OPER	30,000.00	30,158.70	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	50,000.00	59,530.50	
		JP MORGAN CHASE & CO	80,000.00	86,178.40	
		KRAFT FOODS INC	15,000.00	16,729.05	
		QEP RESOURCES INC	10,000.00	10,375.00	
		QEP RESOURCES INC	10,000.00	9,700.00	
		RANGE RESOURCES CORP	20,000.00	20,625.00	

		RIO TINTO FIN USA LTD	30,000.00	34,039.50	
		VERIZON COMMUNICATIONS	60,000.00	65,737.80	
		WACHOVIA CAP TRUST FRN	90,000.00	88,537.50	※
		XL GROUP PLC FRN	20,000.00	17,135.80	
	社債券小計		525,000.00	546,214.89 (67,402,917)	
米ドル小計			3,384,000.00	3,343,006.86 (412,527,045)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVT	140,000.00	154,842.80	
カナダドル小計			140,000.00	154,842.80 (15,625,186)	
メキシコペソ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	680,900.00	757,528.48	
		MEXICAN BONOS DESARR FIX	3,518,000.00	3,630,364.92	
		MEXICAN BONOS DESARR FIX	4,895,500.00	5,431,606.20	
メキシコペソ小計			9,094,400.00	9,819,499.60 (79,439,751)	
ユーロ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	90,000.00	111,932.10	
		BUONI POLIENNALI	1,640,000.00	1,834,356.40	
		BUONI POLIENNALI	170,000.00	199,149.90	
		BUONI POLIENNALI	140,000.00	178,248.00	
		BUONI POLIENNALI	220,000.00	219,111.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	124,772.00	
		FRANCE O.A.T.	640,000.00	744,716.80	
		SPAIN GOVT	470,000.00	520,003.30	
		SPAIN GOVT	240,000.00	263,354.40	
		SPAIN GOVT	80,000.00	106,346.40	
	国債証券小計		3,790,000.00	4,301,990.50 (603,827,386)	
	社債券	CITIGROUP INC	90,000.00	113,824.80	
		GOLDMAN SACHS GROUP	63,000.00	73,263.33	
		GOLDMAN SACHS GROUP	50,000.00	58,770.00	
		JP MORGAN CHASE & CO	50,000.00	57,128.00	
	社債券小計		253,000.00	302,986.13 (42,527,133)	
ユーロ小計			4,043,000.00	4,604,976.63 (646,354,519)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY	600,000.00	667,416.00	
英ポンド小計			600,000.00	667,416.00 (130,506,524)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVT	1,240,000.00	1,232,299.60	
ポーランドズロチ小計			1,240,000.00	1,232,299.60 (41,639,403)	

オーストラリアドル	社債券	WESTPAC BANKING	100,000.00	117,007.00	
オーストラリアドル小計			100,000.00	117,007.00 (11,165,978)	
合計 （外貨建証券の邦貨換算額）				1,337,258,406 (1,337,258,406)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)備考欄の※の銘柄はハイブリッド優先証券であることを示しています。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券	12銘柄	51.9%	30.8%
	特殊債券	5銘柄	31.8%	
	社債券	19銘柄	16.3%	
カナダドル	国債証券	1銘柄	100.0%	1.2%
メキシコペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	5.9%
ユーロ	国債証券	10銘柄	93.4%	48.4%
	社債券	4銘柄	6.6%	
英ポンド	国債証券	1銘柄	100.0%	9.8%
ポーランドズロチ	国債証券	1銘柄	100.0%	3.1%
オーストラリアドル	社債券	1銘柄	100.0%	0.8%

第２ 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

債券関連

「(3)注記表（その他の注記）3　デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項　債券関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

通貨関連

「(3)注記表（その他の注記）3　デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項　通貨関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「第3　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

２【ファンドの現況】

以下は、平成27年 7月31日現在のファンドの状況であります。

【純資産額計算書】

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）

Ⅰ　資産総額	478,230,969円
Ⅱ　負債総額	24,992,951円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	453,238,018円
Ⅳ　発行済口数	452,045,738口
Ⅴ　1万口当たり純資産額 （Ⅲ／Ⅳ×10,000）	10,026円

ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）

Ⅰ　資産総額	1,413,575,961円
Ⅱ　負債総額	158,793,559円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,254,782,402円
Ⅳ　発行済口数	1,370,568,200口
Ⅴ　1万口当たり純資産額 （Ⅲ／Ⅳ×10,000）	9,155円

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（訂正前）

(1)資本金の額（平成27年１月末現在）

（以下略）

（訂正後）

(1)資本金の額（平成27年７月末現在）

（以下略）

２【事業の内容及び営業の概況】

（訂正前）

（前略）

(2)平成27年１月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託（親投資信託を除きます。）は以下の通りです。

種　類	ファンド数	純資産総額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	58	1,654,870
合　計	58	1,654,870

（訂正後）

（前略）

(2)平成27年７月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託（親投資信託を除きます。）は以下の通りです。

種　類	ファンド数	純資産総額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	63	1,760,908
合　計	63	1,760,908

３【委託会社等の経理状況】

原届出書の第三部　委託会社等の情報　第１　委託会社等の概況　３　委託会社等の経理状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

１．当社の財務諸表は、「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条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に従って作成しております。
財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

	第16期事業年度 (平成26年3月31日)	第17期事業年度 (平成27年3月31日)
資　産　の　部		
流動資産		
現金及び預金	1,824,780	2,594,047
前払費用	57,883	90,111
未収委託者報酬	525,781	729,271
未収運用受託報酬	1,399,086	1,359,621
その他未収収益	24,810	28,870
繰延税金資産	234,156	436,730
流動資産計	4,066,499	5,238,652
固定資産		
有形固定資産	※1	※1
建物	242,923	223,431
器具備品	44,716	26,529
有形固定資産計	287,640	249,960
無形固定資産		
ソフトウェア	22,131	31,315
無形固定資産計	22,131	31,315
投資その他の資産		
投資有価証券	149,549	101,165
長期差入保証金	131,711	129,278
保険積立金	426,602	484,188
前払年金費用	-	13,511
投資その他の資産計	707,862	728,144
固定資産計	1,017,635	1,009,420
資産合計	5,084,134	6,248,073

（単位：千円）

		第16期事業年度 (平成26年3月31日)		第17期事業年度 (平成27年3月31日)
負　債　の　部				
流動負債				
預り金		21,681		18,729
未払金		762,472		1,117,368
未払手数料		201,468		248,960
未払消費税等		31,779		325,370
その他未払金		529,223		543,038
未払費用	※2	1,124,568	※2	1,163,172
未払法人税等		87,315		346,913
前受金		23,333		52,711
流動負債計		2,019,370		2,698,895
固定負債				
退職給付引当金		192,015		86,880
役員退職慰労引当金		545,354		602,668
固定負債計		737,369		689,548
負債合計		2,756,739		3,388,444
純　資　産　の　部				
株主資本				
資本金		1,000,000		1,000,000
資本剰余金				
資本準備金		226,405		226,405
資本剰余金計		226,405		226,405
利益剰余金				
利益準備金		23,594		23,594
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		1,077,395		1,609,629
利益剰余金計		1,100,989		1,633,223
株主資本合計		2,327,395		2,859,629
純資産合計		2,327,395		2,859,629
負債純資産合計		5,084,134		6,248,073

(2) 【損益計算書】

（単位：千円）

		第16期事業年度 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）		第17期事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
営業収益				
委託者報酬		9,272,682		10,051,079
運用受託報酬		2,474,827		2,487,985
その他営業収益		343,897		329,360
営業収益計		12,091,407		12,868,425
営業費用				
支払手数料		3,856,873		3,786,684
広告宣伝費		96,872		68,911
公告費		665		665
調査費		4,587,465		5,008,827
調査費	121,649		143,484	
委託調査費	4,464,905		4,863,881	
図書費	910		1,462	
委託計算費		150,156		165,794
営業雑経費		201,116		179,517
通信費	61,228		49,866	
印刷費	125,776		117,501	
協会費	13,632		11,595	
諸会費	479		553	
営業費用計		8,893,148		9,210,401
一般管理費				
給料		1,538,261		1,545,298
役員報酬	103,822		98,885	
給料・手当	965,869		958,889	
賞与	468,570		487,523	
交際費		16,036		12,867
寄付金		-		120
旅費交通費		49,992		58,533
租税公課		21,772		17,192
不動産賃借料		247,255		248,605
退職給付費用		133,694		38,668
退職金		-		17,519
役員退職慰労引当金繰入額		62,415		57,314
固定資産減価償却費		49,348		49,536
諸経費	※1	299,134	※1	427,375
一般管理費計		2,417,910		2,473,031
営業利益		780,347		1,184,993

（単位：千円）

		第16期事業年度 （自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日）	第17期事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）
営業外収益			
受取利息	※1	2,199	456
受取配当金		1,173	1,279
為替差益		3,830	39,845
営業外収益計		7,202	41,581
経常利益		787,550	1,226,574
特別損失			
固定資産除却損		-	557
特別損失計		-	557
税引前当期純利益		787,550	1,226,016
法人税、住民税及び事業税		344,916	496,356
法人税等調整額		24,589	△202,573
法人税等合計		369,505	293,782
当期純利益		418,044	932,234

（3）【株主資本等変動計算書】

第16期事業年度（自 平成25年4月 1日　至 平成26年3月31日）　（単位：千円）

	株主資本						純資産合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計		
				繰越利益剰余金			
当期首残高	1,000,000	226,405	23,594	1,259,350	1,282,944	2,509,350	2,509,350
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	△600,000	△600,000	△600,000	△600,000
当期純利益	-	-	-	418,044	418,044	418,044	418,044
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△181,955	△181,955	△181,955	△181,955
当期末残高	1,000,000	226,405	23,594	1,077,395	1,100,989	2,327,395	2,327,395

第17期事業年度（自 平成26年4月 1日　至 平成27年3月31日）　（単位：千円）

	株主資本						純資産合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計		
				繰越利益剰余金			
当期首残高	1,000,000	226,405	23,594	1,077,395	1,100,989	2,327,395	2,327,395
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	△400,000	△400,000	△400,000	△400,000
当期純利益	-	-	-	932,234	932,234	932,234	932,234
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	532,234	532,234	532,234	532,234
当期末残高	1,000,000	226,405	23,594	1,609,629	1,633,223	2,859,629	2,859,629

重要な会計方針

1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)満期保有目的の債券 償却原価法（定額法） (2)その他有価証券 時価のあるもの 期末日の市場価額等に基づく時価法（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

2.固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産 定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物　12年～18年 器具備品　4年～8年 (2)無形固定資産 定額法によっております。 ただしソフトウエア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
3.引当金の計上基準	(1)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付企業年金について当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。 なお、退職給付債務は、簡便法（確定給付企業年金制度においては直近の年金財政計算上の責任準備金に合理的な調整を加えた額をもって退職給付債務とし、退職一時金制度においては当事業年度末現在の要支給額を退職給付債務とする方法）により計算しております。また、確定給付企業年金制度については、年金資産が退職給付債務を超えるため、前払年金費用を計上しております。 (2)役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に充てるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)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、税抜方式によっております。ただし、固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、発生会計期間の費用として処理しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

第16期事業年度 (平成26年3月31日)	第17期事業年度 (平成27年3月31日)
※1 固定資産の減価償却累計額 建物　142,720千円 器具備品　181,559千円 ※2 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。 未払費用　1,087千円	※1 固定資産の減価償却累計額 建物　165,429千円 器具備品　191,043千円 ※2 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。 未払費用　4,197千円

（損益計算書関係）

第16期事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第17期事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
※1 関係会社との取引 諸経費　47,487千円	※1 関係会社との取引 諸経費　65,393千円

（株主資本等変動計算書関係）

第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）

1．　発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数（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	78,270	－	－	78,270

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25年6月24日定時株主総会	普通株式	600,000	7,665.7	平成25年3月31日	平成25年6月27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26年6月26日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	400,000	5,110.5	平成26年3月31日	平成26年6月27日

第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）

1．　発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数（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	78,270	－	－	78,270

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26年6月26日定時株主総会	普通株式	400,000	5,110.5	平成26年3月31日	平成26年6月27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
次の通り決議する予定であります。

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27年6月12日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	840,000	10,732.0	平成27年3月31日	平成27年6月15日

（リース取引関係）

第16期事業年度 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）	第17期事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）
オペレーティング・リース取引 （借主側） オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 1年以内　196,942千円 1年超　49,235千円 合計　246,177千円	オペレーティング・リース取引 （借主側） オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 1年以内　226,176千円 1年超　876,232千円 合計　1,102,409千円

（金融商品関係）

第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）

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

当社は公募及び私募投資信託の設定、運用等の投資信託委託業務及び年金基金等に対して投資一任業務を行っております。

資金運用については、安全性の高い金融資産で運用し、デリバティブ取引は行っておらず、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

営業債権である未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されております。

なお、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

営業債務であるその他未払金、未払手数料、未払費用は、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。また、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

預金の一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、未収運用受託報酬に関連して、投資顧問業務マニュアルに従い、投資顧問部が主要な取引先の状況を定期的にモニタリングしております。

また、財務部が未収運用受託報酬を取引相手ごとに期日及び残高を管理するとともに、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握を図っております。また、係る状況が発生した場合には、速やかに経営委員会において報告を行っております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、外貨建ての預金、債権債務に関する為替の変動リスクに関して、経理規定に従い、財務部が外貨建ての預金及び債権債務残高を把握しております。また、定期的に行われる本社との財務・資金委員会において報告を行っております。

2．　金融商品の時価等に関する事項

平成26年3月31日における貸借対照表計上額、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）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（1）現金及び預金	1,824,780	1,824,780	－
（2）未収委託者報酬	525,781	525,781	－
（3）未収運用受託報酬	1,399,086	1,399,086	－
（4）投資有価証券	140,263	140,263	－
資産計	3,889,912	3,889,912	－
（1）その他未払金	529,223	529,223	－
（2）未払手数料	201,468	201,468	－
（3）未払費用	1,124,568	1,124,568	－
負債計	1,855,260	1,855,260	－

（注）1．　金融資産の時価の算定方法に関する事項

資産

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、（3）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。

（4）投資有価証券

上記表の投資有価証券は金銭信託及び投資信託受益証券であります。これらの時価について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、投資信託受益証券については基準価額を基礎としております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記をご参照ください。

負債

（1）その他未払金、（2）未払手数料、（3）未払費用

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

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	9,285

上記については、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ため「（4）投資有価証券」には含めておりません。

（注）3.　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内
現金及び預金	1,824,780	―
未収委託者報酬	525,781	―
未収運用受託報酬	1,399,086	―
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	137,263
合計	3,749,649	137,263

第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）

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

当社は公募及び私募投資信託の設定、運用等の投資信託委託業務及び年金基金等に対して投資一任業務を行っております。

資金運用については、安全性の高い金融資産で運用し、デリバティブ取引は行っておらず、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

営業債権である未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されております。

なお、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

営業債務であるその他未払金、未払手数料、未払費用は、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。また、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

預金の一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、未収運用受託報酬に関連して、投資顧問業務マニュアルに従い、投資顧問部が主要な取引先の状況を定期的にモニタリングしております。

また、財務部が未収運用受託報酬を取引相手ごとに期日及び残高を管理するとともに、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握を図っております。また、係る状況が発生した場合には、速やかに経営委員会において報告を行っております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、外貨建ての預金、債権債務に関する為替の変動リスクに関して、経理規定に従い、財務部が外貨建ての預金及び債権債務残高を把握しております。また、定期的に行われる本社との財務・資金委員会において報告を行っております。

2．金融商品の時価等に関する事項

平成27年3月31日における貸借対照表計上額、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）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（1）現金及び預金	2,594,047	2,594,047	―
（2）未収委託者報酬	729,271	729,271	―
（3）未収運用受託報酬	1,359,621	1,359,621	―
（4）投資有価証券	91,880	91,880	―
資産計	4,774,821	4,774,821	―
（1）その他未払金	543,038	543,038	―
（2）未払手数料	248,960	248,960	―
（3）未払費用	1,163,172	1,163,172	―
負債計	1,955,170	1,955,170	―

（注）1．金融資産の時価の算定方法に関する事項

資産

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、（3）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。

（4）投資有価証券

上記表の投資有価証券は金銭信託及び投資信託受益証券であります。これらの時価について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、投資信託受益証券については基準価額を基礎としております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記をご参照ください。

負債

（1）その他未払金、（2）未払手数料、（3）未払費用

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

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	9,285

上記については、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ため「（4）投資有価証券」には含めておりません。

（注）3．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内
現金及び預金	2,594,047	―
未収委託者報酬	729,271	―
未収運用受託報酬	1,359,621	―

投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	1,400	85,480
合計	4,684,341	85,480

（有価証券関係）

第16期事業年度 (平成26年3月31日)	第17期事業年度 (平成27年3月31日)
1.その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 金銭信託 貸借対照表計上額　137,263千円 取得原価　137,263千円 差額　－ 投資信託受益証券 貸借対照表計上額　3,000千円 取得原価　3,000千円 差額　－ （注）非上場株式（貸借対照表計上額9,285千円）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、上記「その他有価証券」には含めておりません。	1.その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 金銭信託 貸借対照表計上額　86,880千円 取得原価　86,880千円 差額　－ 投資信託受益証券 貸借対照表計上額　5,000千円 取得原価　5,000千円 差額　－ （注）同　左

（退職給付関係）

第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）

1.　採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に充てるため、確定給付企業年金制度と退職一時金制度を併用しております。

確定給付企業年金制度では、給与と勤務期間に基づいた一時金又は年金を支給します。

退職一時金制度では、退職給付として賞与のうち一定額を留保した金額を一時金として支給します。

確定給付企業年金制度及び退職一時金制度は、簡便法により退職給付に係る負債及び退職給付費用を計算しております。

2.　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

退職給付引当金の期首残高	161,047千円
退職給付費用	133,694千円
退職給付の支払額	△14,669千円
制度への拠出金	△88,056千円
退職給付引当金の期末残高	192,015千円

（2）退職給付債務及び年金資産と貸借対照表に計上された退職給付に係る資産及び負債の調整表

積立型制度の退職給付債務	675,682千円
年金資産	△620,931千円
	54,751千円
非積立制度の退職給付債務	137,263千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	192,015千円
退職給付引当金	192,015千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	192,015千円

（3）退職給付に関連する損益

簡便法で計算した退職給付費用	133,694千円

第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に充てるため、確定給付企業年金制度と退職一時金制度を併用しております。

確定給付企業年金制度では、給与と勤務期間に基づいた一時金又は年金を支給します。

退職一時金制度では、退職給付として賞与のうち一定額を留保した金額を一時金として支給します。

確定給付企業年金制度及び退職一時金制度は、簡便法により退職給付に係る負債及び資産並びに退職給付費用を計算しております。

2．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

退職給付引当金の期首残高	192,015千円
退職給付費用	38,668千円
退職給付の支払額	△50,383千円
前払年金費用	13,511千円
制度への拠出金	△106,931千円
退職給付引当金の期末残高	86,880千円

（2）退職給付債務及び年金資産と貸借対照表に計上された退職給付に係る資産及び負債の調整表

積立型制度の退職給付債務	650,296千円
年金資産	△663,807千円
	△13,511千円
非積立制度の退職給付債務	86,880千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	73,369千円

退職給付引当金	86,880千円
前払年金費用	△13,511千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	73,369千円

（3）退職給付に関連する損益

簡便法で計算した退職給付費用	38,668千円

（ストック・オプション等関係）

第16期事業年度 （自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）	第17期事業年度 （自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）
1.ストック・オプション等に係る当事業年度における費用計上額及び科目名 諸経費　47,487千円 2.ストック・オプション等の内容 当社は、親会社であるレッグ・メイソン・インクの株式報酬プランに基づき当社の役員等が受領する株式報酬にかかる費用を負担しておりますが、これらの費用については、「ストック・オプション等に関する会計基準」（企業会計基準第8号　平成17年12月27日）及び「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第11号　平成18年5月31日）に準じた方法により会計処理をしております。	1.ストック・オプション等に係る当事業年度における費用計上額及び科目名 諸経費　65,393千円 2.ストック・オプション等の内容 同　左

（税効果会計関係）

第16期事業年度 （自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）	第17期事業年度 （自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）
1.繰延税金資産の発生の主な原因別内訳	1.繰延税金資産の発生の主な原因別内訳
千円	千円
繰延税金資産	繰延税金資産
未払金 166,998	未払金 161,370
役員退職慰労引当金 194,376	役員退職慰労引当金 199,488
退職給付引当金 68,434	退職給付引当金 23,803
未払費用 85,235	未払費用 109,064
有価証券評価損 32,330	有価証券評価損 29,337
長期差入保証金 23,978	長期差入保証金 22,294
繰延税金資産小計 571,353	繰延税金資産小計 545,358
評価性引当額 △337,196	評価性引当額 △108,628
繰延税金資産合計 234,156	繰延税金資産合計 436,730
2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
(%)	(%)
法定実効税率 38.0	法定実効税率 35.6
（調整）	（調整）
交際費等永久に損金に算入されない項目 5.2	交際費等永久に損金に算入されない項目 3.5
住民税均等割 0.5	住民税均等割 0.3
評価性引当金 1.2	評価性引当金 △18.6
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 2.0	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 2.7
	その他 0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率 46.9	税効果会計適用後の法人税等の負担率 23.9
3.法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正	3.法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正
「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないことになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.0%から35.6%になります。 この税率変更により、繰延税金資産の金額は15,571千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。	「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引き下げ等が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の35.6%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.3%となります。 この税率変更により、繰延税金資産の金額は33,513千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。

（資産除去債務関係）

第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）

1.　当該資産除去債務の概要

当社は、本社オフィスの賃貸借契約において、建物所有者との間で賃室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、契約上の義務に関して資産除去債務を認識しております。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を95ケ月と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する差入保証金が計上されているため、当該差入保証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。

3．当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首における資産除去債務認識額	56,984千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	―
その他増減額（△は減少）	8,294千円
期末における資産除去債務認識額	65,279千円

第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）

1．当該資産除去債務の概要

当社は、本社オフィスの賃貸借契約において、建物所有者との間で賃室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、契約上の義務に関して資産除去債務を認識しております。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

当期首より、使用見込期間を75ケ月と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する差入保証金が計上されているため、当該差入保証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。

3．当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首における資産除去債務認識額	65,279千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	―
その他増減額（△は減少）	1,658千円
期末における資産除去債務認識額	66,938千円

（セグメント情報等関係）

［セグメント情報］

当社の報告セグメントは投資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。

［関連情報］

第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）

1．製品およびサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業務	投資一任業務	その他	合計
外部顧客への営業収益	9,272,682	2,474,827	343,897	12,091,407

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

本邦の外部顧客への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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
LM・ブラジル国債ファンド（毎月分配型）	2,722,691
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	1,972,286

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごと負ののれん発生益に関する情報
第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）
該当事項はありません。

第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）

1．製品およびサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業務	投資一任業務	その他	合計
外部顧客への営業収益	10,051,079	2,487,985	329,360	12,868,425

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

本邦の外部顧客への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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	2,405,268
LM・ブラジル国債ファンド（毎月分配型）	1,783,417
LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,395,269

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごと負ののれん発生益に関する情報

第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）
該当事項はありません。

（関連当事者情報）
第16期事業年度（自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）
１．　関連当事者との取引
（１）財務諸表提出会社の親会社及び主要会社（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	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	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	レッグ・メイソン・インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	百万米ドル 11	持株会社	被所有 直接 100%	ストック・オプション費用の負担	諸経費の支払（注３）	千円 47,487	未払費用	千円 1,087

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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	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	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 13	金融業	－	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 26,500	その他未収収益	千円 33
						投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	216,041	未払費用	16,329
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー	米国 カリフォルニア州 パサディナ	米ドル 500	金融業	－	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 110,894	その他未収収益	千円 2,970
						投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	166,342	未払費用	15,205
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 1	金融業	－	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,352,521	未払費用	千円 200,596
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント（株）	東京都 千代田区	億円 10	金融業	－	役員の兼任 投資顧問契約 オフィスの賃借	委託調査費の支払（注１）	千円 28,129	未払費用	千円 2,398
							-	-	長期差入保証金	125,397
							不動産賃借料等の支払（注３）	173,484	前払費用	14,750

同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ	ブラジル サンパウロ州 サンパウロ	百万ブラジルレアル 2	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 828,562	未払費用	千円 57,229
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インターナショナル・エクイティーズ・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 11	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 992	-	千円 -
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インベストメンツ・（ヨーロッパ）リミテッド	英国 ロンドン市	百万英ポンド 33	金融業	―	役員の兼任 サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 21,858	その他未収収益	千円 1,795
同一の親会社を持つ会社	クリアブリッジ・インベストメンツ・エルエルシー	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク	-	金融業	―	サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 156,370	その他未収収益	千円 16,616
							委託調査費の支払（注１）	437,359	未払費用	47,659
同一の親会社を持つ会社	バッテリーマーチ・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 マサチューセッツ州 ボストン	米ドル 1	金融業	―	投資顧問契約	諸経費の支払（注３）	千円 3,127	未払費用	千円 6,695
							委託調査費の支払（注１）	202,427		
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン&カンパニー・エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	サービス業	―	サービス契約	調査費・諸経費の支払（注３）	千円 76,928	前払費用	千円 8,278
									未払費用	5,556
同一の親会社を持つ会社	ブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 ペンシルバニア州 フィラデルフィア	-	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,056,165	未払費用	千円 666,106
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント・オーストラリア・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 47	金融業	―	役員の兼任 サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 27,847	その他未収収益	千円 3,157
							委託調査費の支払（注１）	157,669	未払費用	10,845
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インベストメンツ・（ルクセンブルグ）エス・エー	ルクセンブルグ	百万米ドル 1	金融業	―	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 425	-	千円 -

同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド	シンガポール	百万ＳＧドル 38	金融業	－	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 18,694	未払費用	千円 2,188

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

（注１）委託調査費の支払は国内投信及び国内年金に係る運用・助言業務の再委託に対する支払であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注２）その他営業収益の内容はグループで発行しているファンドの販売支援等のサービス報酬であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注３）諸経費の支払は当社の役員・従業員に付与されるストック・オプション等の当社費用負担額であります。不動産賃借料等の支払は、本社オフィスの賃貸借契約における当社負担額であります。調査費・諸経費の支払はテクノロジーサービス費用・マーケットデータ利用料・保険料等の当社負担額であります。負担額は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注４）取引金額には消費税等を含めておりません。期末残高には消費税等を含めております。

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

レッグ・メイソン・インク　（ニューヨーク証券取引所に上場）

第17期事業年度（自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）

１．　関連当事者との取引

（１）財務諸表提出会社の親会社及び主要会社（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	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	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	レッグ・メイソン・インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	百万米ドル 11	持株会社	被所有 直接 100%	ストック・オプション費用の負担	諸経費の支払（注３）	千円 65,393	未払費用	千円 4,197

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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	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	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 13	金融業	－	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 230	その他未収収益	千円 -
						投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	172,056	未払費用	13,284
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー	米国 カリフォルニア州 パサディナ	米ドル 500	金融業	－	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 32,252	その他未収収益	千円 2,712
						投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	239,437	未払費用	25,853

同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 1	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,775,110	未払費用	千円 220,676
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント（株）	東京都 千代田区	億円 10	金融業	―	役員の兼任 投資顧問契約 オフィスの賃借	委託調査費の支払（注１）	千円 24,280	未払費用	千円 2,100
							-	-	長期差入保証金	125,397
							不動産賃借料等の支払（注３）	173,700	前払費用	14,750
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ	ブラジル サンパウロ州 サンパウロ	百万ブラジルレアル 2	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 536,519	未払費用	千円 33,069
同一の親会社を持つ会社	QSレッグ・メイソン・グローバル・アセット・アロケーション・エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	-	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 2,289	未払費用	千円 165
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インベストメンツ・（ヨーロッパ）リミテッド	英国 ロンドン市	百万英ポンド 34	金融業	―	役員の兼任 サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 4,461	-	-
同一の親会社を持つ会社	クリアブリッジ・インベストメンツ・エルエルシー	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク	-	金融業	―	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 246,425	その他未収収益	千円 22,340
						投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	632,619	未払費用	69,369
同一の親会社を持つ会社	QSバッテリーマーチ・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 70,748	未払費用	千円 5,579
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン＆カンパニー・エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	サービス業	―	サービス契約	調査費・諸経費の支払（注３）	千円 76,269	前払費用	千円 9,218
									未払費用	4,849

同一の親会社を持つ会社	ブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 ペンシルバニア州 フィラデルフィア	-	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,111,348	未払費用	千円 612,713
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント・オーストラリア・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 47	金融業	―	役員の兼任 サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 45,989	その他未収収益	千円 3,811
							委託調査費の支払（注１）	293,494	未払費用	44,653
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド	シンガポール	百万ＳＧドル 38	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 5,976	未払費用	千円 160

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

（注１）委託調査費の支払は国内投信及び国内年金に係る運用・助言業務の再委託に対する支払であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注２）その他営業収益の内容はグループで発行しているファンドの販売支援等のサービス報酬であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注３）諸経費の支払は当社の役員・従業員に付与されるストック・オプション等の当社費用負担額であります。不動産賃借料等の支払は、本社オフィスの賃貸借契約における当社負担額であります。調査費・諸経費の支払はテクノロジーサービス費用・マーケットデータ利用料・保険料等の当社負担額であります。負担額は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注４）取引金額には消費税等を含めておりません。期末残高には消費税等を含めております。

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

レッグ・メイソン・インク　（ニューヨーク証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

第16期事業年度 （自 平成25年4月1日　至 平成26年3月31日）	第17期事業年度 （自 平成26年4月1日　至 平成27年3月31日）
１株当たり純資産額　29,735円47銭 １株当たり当期純利益金額　5,341円06銭 (注) １株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下の通りであります。 当期純利益　418,044千円 普通株式に帰属しない金額　- 普通株式に係る当期純利益　418,044千円 期中平均株式数　78千株 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	１株当たり純資産額　36,535円44銭 １株当たり当期純利益金額　11,910円49銭 (注) １株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下の通りであります。 当期純利益　932,234千円 普通株式に帰属しない金額　- 普通株式に係る当期純利益　932,234千円 期中平均株式数　78千株 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（重要な後発事象）

第16期事業年度 （自　平成25年4月1日　至　平成26年3月31日）	第17期事業年度 （自　平成26年4月1日　至　平成27年3月31日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

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】

原届出書の第三部　委託会社等の情報　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につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

(1)受託会社

①名称

野村信託銀行株式会社

②資本金の額

平成27年３月末現在　　30,000百万円

③事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。

(2)投資顧問会社

①ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド

a.資本金の額

平成27年３月末現在　　13百万米国ドル（1,562百万円）（米国ドルの円貨換算は、便宜上、平成27年３月末現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米国ドル＝120.17円）によります。）

b.事業の内容

英国において資産運用業務を営んでいます。

②ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー

a.資本金の額

平成27年３月末現在　　500米国ドル（60千円）（米国ドルの円貨換算は、便宜上、平成27年３月末現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米国ドル＝120.17円）によります。）

b.事業の内容

米国において資産運用業務を営んでいます。

(3)販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成27年３月末現在	事業の内容
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社＊	10,000	
株式会社ＳＢＩ証券	47,937	
楽天証券株式会社	7,495	

＊ ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）について、一部解約請求の受付、受益権の買取り、収益分配金の再投資、収益分配金・償還金・一部解約金の支払い、口座管理機関としての業務等のみを行います。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

平成27年６月10日

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

あ ら た 監 査 法 人
指 定 社 員
業務執行社員　公認会計士　鶴　田　光　夫　㊞

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」に掲げられているレッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成26年４月１日から平成27年３月31日までの第17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、レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成27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（レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社）が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２７年８月１２日

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
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　　松村　洋季

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　　公認会計士　　宮田　八郎

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ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）の平成２６年１２月１９日から平成２７年６月１８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。

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、ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）の平成２７年６月１８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
レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社）が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２７年８月１２日

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
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　　松村　洋季

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　　公認会計士　　宮田　八郎

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ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）の平成２６年１２月１９日から平成２７年６月１８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。

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、ＬＭ・ユーロ・アルファ　ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）の平成２７年６月１８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
レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社）が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

前へ