

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成26年10月10日提出
【発行者名】	日興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 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	雄谷 敦史
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	GW7つの卵
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので平成26年 4月10日付をもって提出しま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事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。また、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「中間財務諸表」の記載事項が追加されます。

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】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

1

世界各国から7つの資産を選び、国際分散投資を行ないます。そして、効率的な資産配分を考えます。

世界各国の株式・債券から7つの資産を選び、国際分散投資を行なうことで中長期的な信託財産の成長をめざします。

2

7つの資産は、それぞれの分野に強みをもつスペシャリストが運用します。

7つの資産の運用は、それぞれの分野に強みを持つ運用アドバイザーが各マザーファンドを通じて行ないます。

3

資産配分および運用アドバイザーの決定は、日興グローバルラップ(日興GW)の助言をもとに日興アセットマネジメントが行ないます*。

日興GWが、中期的な市況見通しに応じて資産配分の助言を行ないます。また、各マザーファンドの運用状況を日々モニタリングし、必要な場合には運用アドバイザー交代の助言を行ないます*。

*最終的な運用アドバイザーの決定は、日興GWに加えて日興アセットマネジメント アメリカズ・インク(NAM アメリカス)からの情報提供や助言をもとに、日興アセットマネジメントが行ないます。

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

投資の格言

「すべての卵をひとつの籠に入れるな」(Don't put all your eggs in one basket.)という格言があるように、「分散」は古くから投資の知恵として重んじられてきました。ひとつの籠にすべての卵を入れると、籠を落としたときに全部割れてしまいますが、いくつかの籠に分けて入れておけば、籠をひとつ落としたとしても他の籠の卵は無事です。



※イメージ図です。

これを資産運用の世界に置き換えると、すべての資金をひとつの資産に集中せず、値動きの異なる傾向のある複数の資産に分散投資することで安定的なリターンが期待できることを言います。



世界各国から7つの資産を選び、国際分散投資を行ないます。 そして、効率的な資産配分を考えます。



[基本ポートフォリオ]
2014年4月11日現在



国内50%:海外50% 株式65%:債券35%

分散投資効果をもつため、日本株式を大型・小型に分類したり、海外株式を地域分割することにより、7資産に細分化しています。

長期投資の観点から、効率的な資産配分^{※1}を構築し、中期的な市況見通しを加味した上で、資産配分を決定します^{※2}。

※1 「効率的な資産配分」とは、期待されるリターンが同じ水準にある場合、リターンのブレが最も小さくなると判断される配分を指します。
※2 当ファンドでは、長期投資の観点から構築される資産配分を「基本ポートフォリオ」、中期的な市況見通しを加味して構築される資産配分を「推奨ポートフォリオ」と呼びます。

株式や債券などの資産には、値動きがあります。

株式は景気上昇期に値上がりする傾向に対し、債券は景気下降期に値上がりする傾向があるなど、一般に、株式と債券は、景気変動による傾向が異なります。

また、景気は地域によっても状況が異なるなど、さまざまな影響を受けて変動します。

[各資産の年間リターン]
(1988年～2013年)

(%)

	1988	1989	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	
株式	日本大型株式	37.0	19.0	-39.8	-0.9	-22.9	11.4	8.2	2.2	-5.8	-16.6	-7.1	71.1	-28.0	-19.6	-18.5	25.2	10.1	43.9	3.6	-10.4	-40.9	8.1	0.2	-16.3	19.6	55.6
	日本小型株式	29.7	59.0	-32.8	-5.0	-28.8	7.4	16.9	-5.5	-11.1	-46.1	1.7	35.0	-8.4	-7.1	-10.9	43.9	29.2	58.8	-19.2	-17.6	-34.0	11.4	6.0	-5.3	22.2	56.2
	北米株式	19.5	50.6	-8.4	19.6	6.1	-1.2	-9.1	41.7	39.9	48.9	11.9	12.0	-1.5	0.5	-29.7	17.5	6.4	23.2	16.6	0.9	-49.5	32.8	1.0	-4.6	29.9	58.5
	欧州先進国株式	19.8	48.5	-8.8	4.7	-4.3	16.0	-8.2	26.3	36.8	39.1	11.8	5.5	2.5	-7.8	-25.8	25.7	16.1	26.6	35.6	7.3	-56.2	40.5	-9.0	-15.1	34.8	53.1
アジア太平洋先進国株式	34.3	31.6	-15.6	29.5	6.7	62.1	-22.8	17.9	36.6	-24.0	-17.6	25.8	-5.4	3.9	-14.7	32.8	23.9	32.3	34.4	23.5	-59.5	77.7	2.0	-17.2	40.2	28.4	
債券	日本債券	5.9	-0.9	2.5	12.1	10.2	12.9	-1.5	12.1	4.9	5.5	0.5	5.4	2.0	3.2	3.3	-0.7	1.3	0.7	0.2	2.7	3.2	1.5	2.5	1.9	1.8	2.0
	海外債券	8.1	27.6	6.4	5.3	4.4	-1.3	-9.8	25.8	19.5	13.7	-0.1	-18.0	17.7	17.8	10.3	5.7	7.3	10.1	10.0	4.5	-15.5	7.4	-12.7	0.2	20.4	22.7

※表は、年間の騰落率を示したものです。

※各資産の騰落率の算出に使用したインデックスについては、後述の「各マザーファンドとベンチマーク・インデックスについて」をご覧ください。



7つの資産は、それぞれの分野に強みを持つ スペシャリストが運用します。

【運用アドバイザー】
(有価証券届出書提出日現在)



・上記運用アドバイザーは有価証券届出書提出日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

日興GWが運用アドバイザーの運用状況をモニタリングし、必要な場合には運用アドバイザー交代助言を行ないます。

【運用アドバイザーの評価・選定プロセス】



資産配分および運用アドバイザーの決定は、 日興GWの助言をもとに日興アセットマネジメントが行ないます※。

※最終的な運用アドバイザーの決定は、日興GWに加えてNAM アメリカズからの情報提供や助言をもとに、日興アセットマネジメントが行ないます。

日興GW：日興グローバルラップ株式会社

日興GWは、運用アドバイザーの評価・選定や資産配分の策定など、資産運用サービスをご提供するコンサルティング・カンパニーです。前身の「株式会社グローバル・ラップ・コンサルティング・グループ」は1998年2月設立。1990年代に米国で急拡大した「投資信託ラップ」を日本で初めて導入しました。

NAM アメリカズ：日興アセットマネジメント アメリカズ・インク

NAM アメリカズは、日興アセットマネジメント・グループ®の傘下にあるグローバル運用の米国拠点です。「GW7つの卵」の運用アドバイザーを決定する際、日興アセットマネジメントへの情報提供や助言を行ないます。

※「日興アセットマネジメント・グループ」とは日興アセットマネジメント株式会社とそのグループ会社の総称です。

運用アドバイザーについて

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

●JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社

世界最大級の総合金融サービスグループの資産運用会社

JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーの資産運用部門「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループの一員で、グループ全体での運用資産総額は約168兆円(2013年12月末現在)。ファンダメンタルズ分析をベースに資産の均衡価値と市場価格との乖離を捉えることにより、超過収益の獲得を図る。

J.P.Morgan
Asset Management

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

●スパークス・アセット・マネジメント株式会社

徹底した企業訪問調査に基づく投資を行なう運用会社

国内独立系の資産運用グループ。「マクロはミクロの集積」という仮説のもと、「徹底した企業調査をベースにした運用」という投資哲学を持つ。経済構造が変革する中で成長する新興企業や、既存の産業の中で自ら体質改善を図りながら成長を捉えようとする企業に選別投資する。グループ全体での運用資産総額は約7,191億円(2013年12月末現在)。

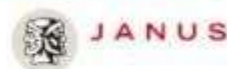


北米株式グローバル・ラップマザーファンド

●ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー

独自のリサーチで情報優位性を獲得し投資機会を発掘

米国の大手資産運用会社ジャナス・キャピタル・グループの中核企業。グループ全体で約18.3兆円(2013年12月末現在)の運用資産総額を有し、質の高い運用サービスのグローバルな提供に注力。個別企業リサーチに基づく徹底したボトムアップのファンダメンタル・アプローチによる、株式の成長性に着目したポートフォリオを構築。



欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

●MFSインターナショナル(U.K.)リミテッド

米国最古の運用会社であるMFSグループの英国法人

MFSグループは世界各地にリサーチ拠点を置くグローバルな運用会社で、米国投信の産みの親として80年超の歴史を持つ。産業・企業の徹底したファンダメンタルズ分析を行ない、継続的に高い収益成長が期待できるクオリティの高い企業を発掘し、相対的に割安な株価水準で購入を図る。グループ全体の運用資産総額は約43兆円(2013年12月末現在)。



アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

●シュローダー・インベストメント・マネージメント(シンガポール)リミテッド

英国を本拠とするグローバル資産運用グループのアジア拠点

シュローダー・グループの国際運用拠点の1つ。投資対象市場や投資対象企業について実施される徹底した調査・分析によって、本来の投資価値に比べて株価水準が割安な銘柄を見極め、またマクロ分析に基づく国別配分を組合せ、リスクコントロールに配慮しながらポートフォリオを構築する。グループ全体での運用資産総額は約40.8兆円(2013年9月末現在)。



日本債券グローバル・ラップマザーファンド

●三井住友信託銀行株式会社

資産運用で高い専門性を誇る信託銀行

三井住友信託銀行は、三井住友トラスト・グループに属している信託銀行であり、資産運用で高い専門性を有する。長期的な市場動向が中短期的な「市場テーマ(=市場が注目する材料)」の積み重ねにより構成されていると考えており、マーケット動向、マクロ動向、クレジット動向の丹念な調査・分析により、独自に市場テーマを追求し、投資行動に効果的に反映することで超過収益の獲得をめざす。三井住友信託銀行における運用資産総額は約49.5兆円(2013年12月末現在)。



海外債券グローバル・ラップマザーファンド

●ウェリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー

機関投資家向け運用サービスに特化した独立系運用会社

自社ブランドでの投信販売は行わず、運用業務に専念。世界の機関投資家に運用サービスを提供し、グループ全体の運用資産額は約87.7兆円(2013年12月末現在)。「専門性を持ったリサーチ」、「分散されたアルファ源泉における多様な戦略」、「統合されたリスク管理」を通じて、超過収益の獲得をめざす。



※上記の運用アドバイザーは有価証券届出書提出日現在のものであり、将来変更する場合があります。

※上記内容は、各社提供の情報に基づいて作成しています。

ファンドの仕組み

当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



■主な投資制限

- ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

■分配方針

毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

【各マザーファンドとベンチマーク・インデックスについて】

各マザーファンドにおけるベンチマーク・インデックスは、以下のとおりです。

- 日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド…………… 日興株式スタイルインデックス(日本大型株式)
- 日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド…………… 日興株式スタイルインデックス(日本小型株式)
- 北米株式グローバル・ラップマザーファンド…………… MSCI北米インデックス(ヘッジなし・円ベース*)
- 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド…………… MSCI欧州インデックス(ヘッジなし・円ベース*)
- アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド…………… MSCI太平洋フリー・インデックス
(日本を除く、ヘッジなし・円ベース*)
- 日本債券グローバル・ラップマザーファンド…………… 日興債券パフォーマンスインデックス(総合)
- 海外債券グローバル・ラップマザーファンド…………… 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*)

*ヘッジなし・円ベースとは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

※日興株式スタイルインデックスおよび日興債券パフォーマンスインデックス(総合)に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はSMBC日興証券株式会社に帰属します。また、SMBC日興証券株式会社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

※MSCI指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

※シティ世界国債インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

情報提供サービスを充実させています。

ファンドの運用実績、パフォーマンスの要因分析、世界の市況・経済動向、各マザーファンドの運用状況等についてご説明しています。



マンスリーレポート
(原則毎月9営業日作成)



四半期レビュー
(原則1・4・7・10月作成)



スペシャルレビュー
(原則毎年1月作成)

それぞれ、日興アセットマネジメントのホームページ(アドレス <http://www.nikkoam.com/>)に掲載されます。

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

委託会社の概況(平成26年7月末現在)

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	179,869,100株	91.29%
DBS Bank Ltd.	6 Shenton Way, #46-00, DBS Building Tower One, Singapore 068809	14,283,400株	7.24%

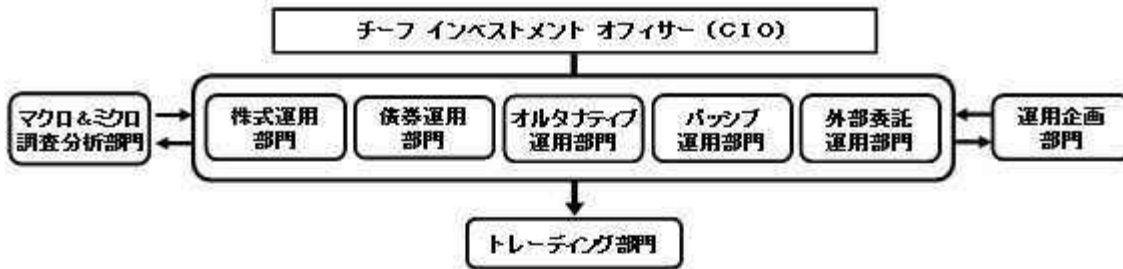
2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

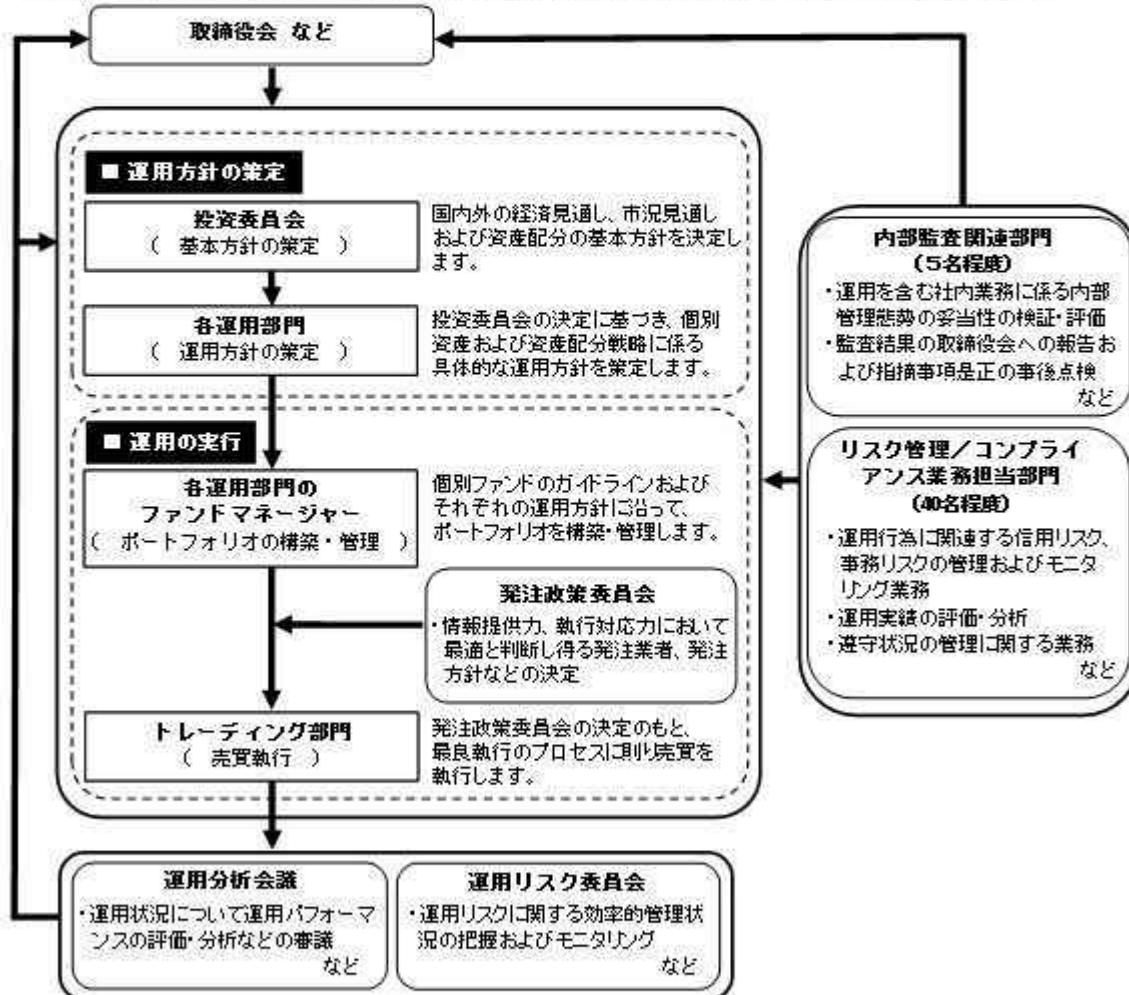
<更新後>

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)における運用体制>

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門では外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているなどのモニタリングを行っております。

上記体制は平成26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。

(5) 【投資制限】

<訂正前>

約款に定める投資制限

<GW7つの卵>

1)～15) (略)

<日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド>

<日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド>

1)～13) (略)

<日本債券グローバル・ラップマザーファンド>

1)～11) (略)

<北米株式グローバル・ラップマザーファンド>

<欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド>

<アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド>

1)～14) (略)

<海外債券グローバル・ラップマザーファンド>

1)～13) (略)

<訂正後>

約款に定める投資制限

<GW7つの卵>

1)～15) (略)

2014年12月1日以降、以下の投資制限が追加となります。

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

<日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド>

<日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド>

1)～13) (略)

2014年12月1日以降、以下の投資制限が追加となります。

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

<日本債券グローバル・ラップマザーファンド>

1)～11) (略)

2014年12月1日以降、以下の投資制限が追加となります。

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

<北米株式グローバル・ラップマザーファンド>

<欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド>

<アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド>

1)～14) (略)

2014年12月1日以降、以下の投資制限が追加となります。

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

<海外債券グローバル・ラップマザーファンド>

1)～13) (略)

2014年12月1日以降、以下の投資制限が追加となります。

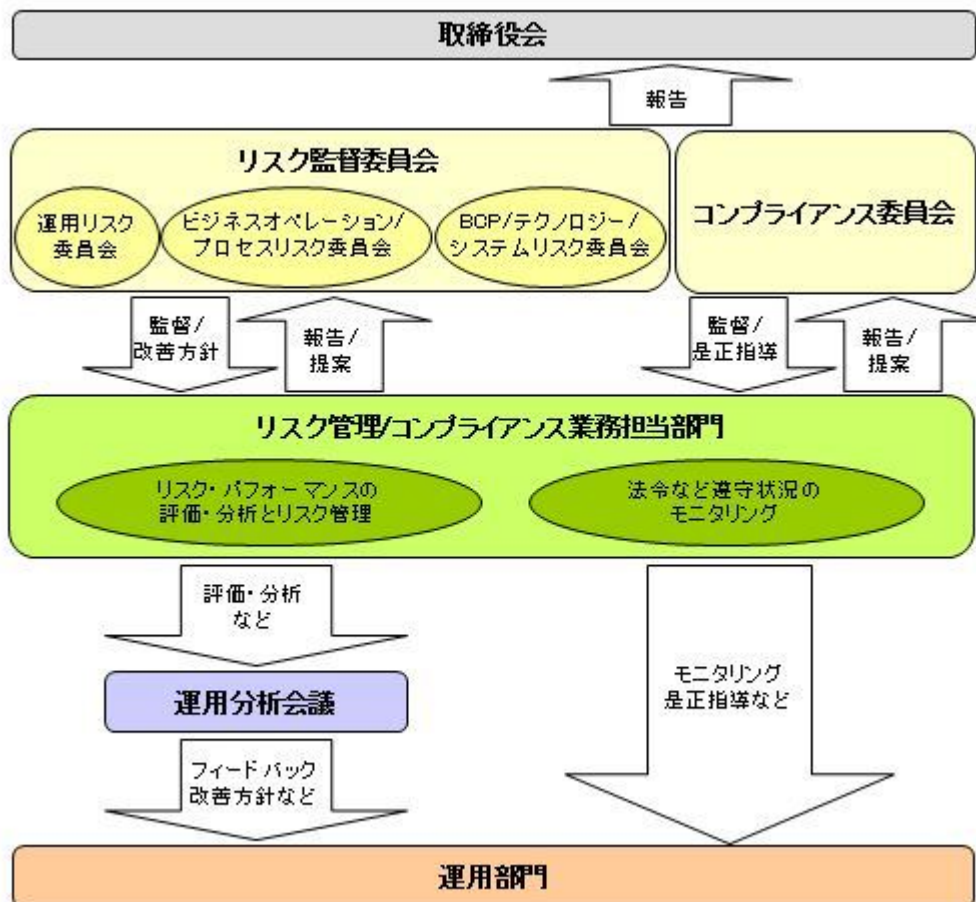
14) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

<更新後>

(2) リスク管理体制

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)におけるリスク管理体制>



全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況およびリスク管理状況については、リスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。本委員会およびその部門別委員会においては、各種リスク（運用リスク、事務リスク、システムリスクなど）に関するモニタリングとその報告に加えて、重大なリスクの洗い出し、より予防的なリスクの軽減に繋がる施策、管理手法の構築などに努めております。

リスク・パフォーマンスの評価・分析とリスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析と運用プロセスおよびリスク運営状況のモニタリングを行いません。運用パフォーマンスおよびリスクに係る評価と分析の結果については運用分析会議に報告し、リスク管理状況についてはリスク監督委員会あるいはその部門別委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、リスク管理/コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはリスク管理/コンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成26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。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。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。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用はありません。)のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益(譲渡益)^{*}については譲渡所得として、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、20.315% (所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

^{*} 解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。)を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当等(申告分離課税を選択したものに限り)と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益(譲渡益)および普通分配金(申告分離課税を選択したものに限り)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

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および譲渡所得が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。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315% (所得税のみ)の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

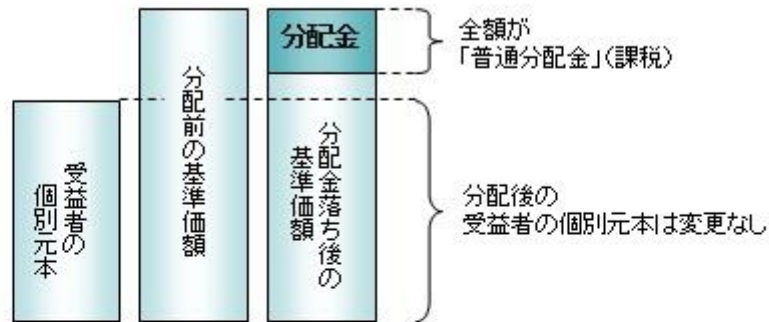
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

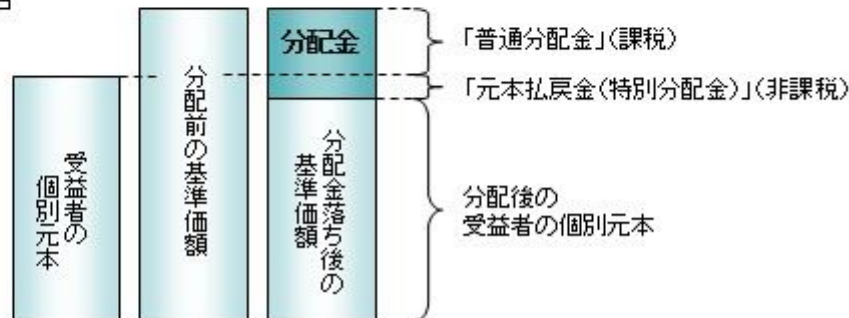
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は平成26年10月10日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【GW7つの卵】

以下の運用状況は2014年7月31日現在です。

・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】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	97,391,209,111	99.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		968,947,316	0.99
合計(純資産総額)		98,360,156,427	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	北米株式グローバル・ラップマザーファンド	11,375,489,820	1.7251	19,623,857,489	1.8120	20,612,387,553	20.96

日本	親投資信託受益証券	日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド	11,795,444,326	1.6176	19,080,310,742	1.6117	19,010,717,620	19.33
日本	親投資信託受益証券	日本債券グローバル・ラップマザーファンド	15,042,590,262	1.2347	18,573,086,197	1.2561	18,894,997,628	19.21
日本	親投資信託受益証券	欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	6,469,298,913	2.5686	16,617,041,188	2.5928	16,773,598,221	17.05
日本	親投資信託受益証券	海外債券グローバル・ラップマザーファンド	4,243,593,086	2.2469	9,534,929,305	2.3028	9,772,146,158	9.94
日本	親投資信託受益証券	日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド	1,854,812,615	3.1138	5,775,515,521	3.4546	6,407,635,659	6.51
日本	親投資信託受益証券	アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	1,074,301,993	5.0073	5,379,352,370	5.5103	5,919,726,272	6.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第2計算期間末 (2005年 1月11日)	92,365	99,196	1.0781	1.1581
第3計算期間末 (2006年 1月10日)	278,488	347,980	1.0805	1.3505
第4計算期間末 (2007年 1月10日)	583,704	637,978	1.0671	1.1671
第5計算期間末 (2008年 1月10日)	504,338	505,885	0.9781	0.9811
第6計算期間末 (2009年 1月13日)	255,052	256,286	0.6199	0.6229
第7計算期間末 (2010年 1月12日)	256,958	258,604	0.7807	0.7857
第8計算期間末 (2011年 1月11日)	181,386	182,117	0.7448	0.7478
第9計算期間末 (2012年 1月10日)	121,907	122,458	0.6637	0.6667
第10計算期間末 (2013年 1月10日)	116,051	116,482	0.8083	0.8113
第11計算期間末 (2014年 1月10日)	107,192	110,809	1.0372	1.0722
2013年 7月末日	117,558		0.9513	
8月末日	114,630		0.9425	
9月末日	116,580		0.9817	
10月末日	116,578		1.0062	

11月末日	115,297		1.0448
12月末日	111,602		1.0743
2014年 1月末日	103,946		1.0034
2月末日	104,211		1.0195
3月末日	102,176		1.0211
4月末日	100,350		1.0177
5月末日	100,600		1.0319
6月末日	99,540		1.0485
7月末日	98,360		1.0582

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第2期	2004年 1月14日～2005年 1月11日	0.0800
第3期	2005年 1月12日～2006年 1月10日	0.2700
第4期	2006年 1月11日～2007年 1月10日	0.1000
第5期	2007年 1月11日～2008年 1月10日	0.0030
第6期	2008年 1月11日～2009年 1月13日	0.0030
第7期	2009年 1月14日～2010年 1月12日	0.0050
第8期	2010年 1月13日～2011年 1月11日	0.0030
第9期	2011年 1月12日～2012年 1月10日	0.0030
第10期	2012年 1月11日～2013年 1月10日	0.0030
第11期	2013年 1月11日～2014年 1月10日	0.0350
当中間期	2014年 1月11日～2014年 7月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第2期	2004年 1月14日～2005年 1月11日	7.47
第3期	2005年 1月12日～2006年 1月10日	25.27
第4期	2006年 1月11日～2007年 1月10日	8.01
第5期	2007年 1月11日～2008年 1月10日	8.06
第6期	2008年 1月11日～2009年 1月13日	36.32
第7期	2009年 1月14日～2010年 1月12日	26.75
第8期	2010年 1月13日～2011年 1月11日	4.21
第9期	2011年 1月12日～2012年 1月10日	10.49
第10期	2012年 1月11日～2013年 1月10日	22.24
第11期	2013年 1月11日～2014年 1月10日	32.65
当中間期	2014年 1月11日～2014年 7月10日	1.09

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）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（分配落ち、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。

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第2期	2004年 1月14日～2005年 1月11日	87,363,652,509	2,796,396,521
第3期	2005年 1月12日～2006年 1月10日	203,506,702,073	31,441,036,327
第4期	2006年 1月11日～2007年 1月10日	380,068,619,701	90,828,905,824
第5期	2007年 1月11日～2008年 1月10日	107,582,341,767	138,924,698,265
第6期	2008年 1月11日～2009年 1月13日	6,547,417,251	110,726,620,676
第7期	2009年 1月14日～2010年 1月12日	4,726,664,478	87,049,479,782
第8期	2010年 1月13日～2011年 1月11日	3,850,774,660	89,455,456,824
第9期	2011年 1月12日～2012年 1月10日	1,883,793,298	61,745,716,270
第10期	2012年 1月11日～2013年 1月10日	1,410,974,674	41,513,364,187
第11期	2013年 1月11日～2014年 1月10日	1,150,408,361	41,372,192,112
当中間期	2014年 1月11日～2014年 7月10日	2,210,329,850	11,521,978,429

（参考）

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2014年 7月31日現在です。

・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	40,234,766,840	98.59
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		576,524,046	1.41
合計（純資産総額）		40,811,290,886	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	454,900	5,560.00	2,529,244,000	6,137.00	2,791,721,300	6.84
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,989,300	541.00	1,617,211,300	615.60	1,840,213,080	4.51

日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	189,000	8,088.00	1,528,632,000	7,572.00	1,431,108,000	3.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,334,000	733.00	977,822,000	808.70	1,078,805,800	2.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	272,300	3,115.00	848,214,500	3,652.00	994,439,600	2.44
日本	株式	KDDI	情報・通信業	164,300	5,823.00	956,718,900	5,997.00	985,307,100	2.41
日本	株式	オリックス	その他金融業	558,600	1,371.00	765,840,600	1,693.50	945,989,100	2.32
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	254,100	3,520.00	894,432,000	3,654.00	928,481,400	2.28
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	858,600	895.91	769,228,326	1,022.00	877,489,200	2.15
日本	株式	三井不動産	不動産業	250,000	2,935.00	733,750,000	3,444.50	861,125,000	2.11
日本	株式	ダイキン工業	機械	112,200	5,314.00	596,230,800	7,180.00	805,596,000	1.97
日本	株式	三井物産	卸売業	449,500	1,423.00	639,638,500	1,666.00	748,867,000	1.83
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	223,900	3,065.24	686,307,236	3,296.50	738,086,350	1.81
日本	株式	電通	サービス業	175,900	3,735.00	656,986,500	4,125.00	725,587,500	1.78
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,000	40,315.34	645,045,440	45,245.00	723,920,000	1.77
日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	155,900	2,955.46	460,756,214	4,490.00	699,991,000	1.72
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,049,400	654.31	686,632,914	660.30	692,918,820	1.70
日本	株式	マツダ	輸送用機器	272,200	2,291.95	623,868,790	2,501.00	680,772,200	1.67
日本	株式	リコー	電気機器	560,200	1,145.00	641,429,000	1,199.50	671,959,900	1.65
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	80,000	7,507.00	600,560,000	8,322.00	665,760,000	1.63
日本	株式	協和発酵キリン	医薬品	444,000	1,121.51	497,950,440	1,419.00	630,036,000	1.54
日本	株式	ソニー	電気機器	348,200	1,845.20	642,498,640	1,772.00	617,010,400	1.51
日本	株式	住友商事	卸売業	439,100	1,278.00	561,169,800	1,370.50	601,786,550	1.47
日本	株式	ユニ・チャーム	化学	92,900	5,756.66	534,793,714	6,344.00	589,357,600	1.44
日本	株式	スズケン	卸売業	172,200	3,898.56	671,332,032	3,310.00	569,982,000	1.40
日本	株式	味の素	食料品	344,000	1,418.00	487,792,000	1,594.50	548,508,000	1.34
日本	株式	JXホールディングス	石油・石炭製品	1,006,600	492.00	495,247,200	534.50	538,027,700	1.32
日本	株式	日本航空	空運業	93,300	4,680.00	436,644,000	5,730.00	534,609,000	1.31
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	122,800	3,681.00	452,026,800	4,330.50	531,785,400	1.30
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	77,200	5,444.00	420,276,800	6,860.00	529,592,000	1.30

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	建設業	2.49
		食料品	4.96
		化学	5.25
		医薬品	4.27
		石油・石炭製品	1.32
		ガラス・土石製品	1.15
		鉄鋼	2.10
		非鉄金属	1.06
		機械	5.62

	電気機器	12.65
	輸送用機器	15.16
	電気・ガス業	2.18
	陸運業	2.96
	海運業	0.39
	空運業	1.31
	情報・通信業	9.00
	卸売業	5.01
	小売業	4.53
	銀行業	7.87
	証券、商品先物取引業	1.70
	保険業	0.42
	その他金融業	2.32
	不動産業	3.09
	サービス業	1.78
合 計		98.59

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2014年 7月31日現在です。

・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	13,276,935,900	97.30
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		368,541,959	2.70
合計（純資産総額）		13,645,477,859	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	西尾レントオール	サービス業	65,000	3,545.00	230,425,000	4,420.00	287,300,000	2.11
日本	株式	岡村製作所	その他製品	311,000	869.00	270,259,000	893.00	277,723,000	2.04
日本	株式	エレコム	電気機器	104,400	2,054.00	214,437,600	2,642.00	275,824,800	2.02
日本	株式	トラスコ中山	卸売業	105,400	2,348.00	247,479,200	2,609.00	274,988,600	2.02
日本	株式	マクニカ	卸売業	78,700	2,647.00	208,318,900	3,410.00	268,367,000	1.97
日本	株式	タムラ製作所	電気機器	636,000	260.00	165,360,000	415.00	263,940,000	1.93
日本	株式	S Foods	食料品	160,900	1,074.00	172,806,600	1,626.00	261,623,400	1.92
日本	株式	イリソ電子工業	電気機器	40,800	5,090.00	207,672,000	6,400.00	261,120,000	1.91
日本	株式	セーレン	繊維製品	280,000	847.00	237,160,000	930.00	260,400,000	1.91
日本	株式	トーカロ	金属製品	145,800	1,624.00	236,779,200	1,765.00	257,337,000	1.89
日本	株式	アネスト岩田	機械	353,100	636.00	224,571,600	728.00	257,056,800	1.88
日本	株式	T O A	電気機器	194,700	1,036.00	201,709,200	1,282.00	249,605,400	1.83
日本	株式	T P R	機械	100,000	1,505.00	150,500,000	2,438.00	243,800,000	1.79
日本	株式	エス・エム・エス	サービス業	96,300	1,912.00	184,125,600	2,523.00	242,964,900	1.78
日本	株式	S B Sホールディングス	陸運業	348,900	561.00	195,732,900	687.00	239,694,300	1.76
日本	株式	セントラル硝子	化学	650,000	329.00	213,850,000	360.00	234,000,000	1.71
日本	株式	ユシロ化学工業	石油・石炭製品	174,800	994.00	173,751,200	1,317.00	230,211,600	1.69
日本	株式	アーレスティ	非鉄金属	248,500	810.00	201,285,000	909.00	225,886,500	1.66
日本	株式	加藤製作所	機械	300,000	510.00	153,000,000	742.00	222,600,000	1.63
日本	株式	オブテックス	電気機器	97,300	1,724.00	167,745,200	2,247.00	218,633,100	1.60
日本	株式	阪和興業	卸売業	500,000	386.00	193,000,000	431.00	215,500,000	1.58
日本	株式	前田工織	その他製品	169,400	1,665.00	282,051,000	1,244.00	210,733,600	1.54
日本	株式	ユーシン精機	機械	80,500	2,930.00	235,865,000	2,611.00	210,185,500	1.54
日本	株式	キッツ	機械	350,000	497.00	173,950,000	597.00	208,950,000	1.53
日本	株式	日東工業	電気機器	95,400	2,147.00	204,823,800	2,168.00	206,827,200	1.52
日本	株式	T O W A	機械	350,100	534.00	186,953,400	590.00	206,559,000	1.51
日本	株式	ニチユ三菱フォークリフト	輸送用機器	283,000	775.00	219,325,000	726.00	205,458,000	1.51
日本	株式	日特エンジニアリング	機械	207,100	840.00	173,964,000	982.00	203,372,200	1.49
日本	株式	日本工営	サービス業	351,000	503.00	176,553,000	551.00	193,401,000	1.42
日本	株式	萩原工業	その他製品	124,100	1,285.00	159,468,500	1,557.00	193,223,700	1.42

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	2.67
		食料品	1.92
		繊維製品	3.97
		パルプ・紙	0.98
		化学	4.81
		石油・石炭製品	2.28
		ゴム製品	1.00

	非鉄金属	1.66
	金属製品	3.30
	機械	13.06
	電気機器	16.21
	輸送用機器	3.88
	その他製品	7.02
	陸運業	2.29
	倉庫・運輸関連業	1.08
	情報・通信業	6.10
	卸売業	8.27
	小売業	2.89
	銀行業	2.31
	保険業	0.80
	その他金融業	0.56
	不動産業	0.62
	サービス業	9.65
合 計		97.30

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2014年 7月31日現在です。

・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	19,766,969,000	52.39
地方債証券	日本	115,248,000	0.31
特殊債券	日本	1,915,032,000	5.08
	韓国	99,921,000	0.26
	小計	2,014,953,000	5.34
社債券	日本	13,163,916,993	34.89
	アメリカ	200,852,000	0.53
	フランス	705,116,242	1.87
	オランダ	200,864,000	0.53
	スウェーデン	200,894,000	0.53

	オーストラリア	204,964,000	0.54
	韓国	500,689,408	1.33
	小計	15,177,296,643	40.22
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		657,493,305	1.74
合計（純資産総額）		37,731,959,948	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	2,700,000,000	104.60	2,824,281,000	105.01	2,835,378,000	1.000	2021/12/20	7.51
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,700,000,000	100.24	2,706,561,000	100.65	2,717,712,000	0.600	2024/6/20	7.20
日本	国債証券	第123回利付国債(20年)	1,700,000,000	113.81	1,934,787,000	114.99	1,954,898,000	2.100	2030/12/20	5.18
日本	国債証券	第323回利付国債(10年)	1,700,000,000	103.93	1,766,835,000	104.21	1,771,655,000	0.900	2022/6/20	4.70
日本	国債証券	第114回利付国債(20年)	1,300,000,000	114.46	1,487,992,000	115.58	1,502,605,000	2.100	2029/12/20	3.98
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	1,300,000,000	100.18	1,302,394,000	100.82	1,310,725,000	0.600	2024/3/20	3.47
日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	1,100,000,000	100.88	1,109,785,000	101.93	1,121,241,000	1.500	2034/3/20	2.97
日本	国債証券	第109回利付国債(5年)	1,100,000,000	100.00	1,100,099,000	100.01	1,100,198,000	0.100	2018/3/20	2.92
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	800,000,000	101.37	810,980,000	101.63	813,064,000	1.500	2034/6/20	2.15
日本	国債証券	第99回利付国債(20年)	600,000,000	115.44	692,664,000	116.13	696,786,000	2.100	2027/12/20	1.85
日本	国債証券	第105回利付国債(20年)	600,000,000	115.30	691,818,000	115.98	695,916,000	2.100	2028/9/20	1.84
日本	特殊債券	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	112.52	675,120,000	114.96	689,796,000	2.590	2035/12/20	1.83
日本	社債券	第32回ソフトバンク株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	600,000,000	100.91	605,480,573	100.91	605,480,573	1.670	2015/6/2	1.60
日本	国債証券	第41回利付国債(30年)	600,000,000	100.29	601,740,000	100.69	604,140,000	1.700	2043/12/20	1.60
日本	国債証券	第42回利付国債(30年)	600,000,000	100.16	600,998,000	100.59	603,564,000	1.700	2044/3/20	1.60
日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	500,000,000	105.07	525,350,000	105.73	528,655,000	1.100	2021/9/20	1.40
日本	特殊債券	第109回福岡北九州高速道路債券	500,000,000	104.63	523,155,000	104.00	520,015,000	2.090	2016/9/20	1.38
日本	国債証券	第43回利付国債(30年)	500,000,000	100.50	502,528,000	100.49	502,485,000	1.700	2044/6/20	1.33
日本	特殊債券	第21回道路債券	400,000,000	118.66	474,648,000	120.81	483,256,000	2.750	2033/6/20	1.28
日本	社債券	第7回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	400,000,000	106.63	426,556,000	106.87	427,492,000	1.606	2020/9/28	1.13

日本	社債券	第1回明治安田生命2012基金特定目的会社B号特定社債(一般担保付)	400,000,000	101.44	405,788,000	101.49	405,960,000	0.850	2017/8/9	1.08
日本	国債証券	第92回利付国債(20年)	300,000,000	115.55	346,674,000	116.07	348,237,000	2.100	2026/12/20	0.92
フランス	社債券	第13回ルノー円貨社債(2013)	300,000,000	101.19	303,587,242	101.19	303,587,242	1.920	2015/6/12	0.80
日本	社債券	第12回日本プライムリアルティ投資法人無担保投資法人債(特定投資法人債間限定同順位特約付)	300,000,000	100.77	302,313,632	100.77	302,313,632	1.270	2015/5/21	0.80
日本	社債券	第1回日本生命2010基金特定目的会社特定社債(一般担保付)	300,000,000	100.84	302,529,000	100.66	301,998,000	0.880	2015/8/5	0.80
日本	社債券	第38回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	100.58	301,755,000	100.51	301,548,000	0.605	2016/2/26	0.80
日本	社債券	第1回日本電産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	300,000,000	100.39	301,197,000	100.44	301,344,000	0.386	2017/9/20	0.80
韓国	社債券	第6回ウリィ銀行円貨社債(2013)	300,000,000	100.03	300,096,408	100.03	300,096,408	0.770	2015/2/5	0.80
日本	国債証券	第98回利付国債(20年)	200,000,000	115.54	231,084,000	116.13	232,270,000	2.100	2027/9/20	0.62
日本	国債証券	第110回利付国債(20年)	200,000,000	115.84	231,680,000	115.80	231,614,000	2.100	2029/3/20	0.61

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	52.39
地方債証券	0.31
特殊債券	5.34
社債券	40.22
合計	98.26

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

北米株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2014年7月31日現在です。

・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
出資金	アメリカ	446,090,775	1.01
株式	アメリカ	35,516,434,011	80.76
	カナダ	2,756,674,129	6.27
	オランダ	1,231,351,344	2.80
	アイルランド	897,788,126	2.04
	イギリス	517,200,672	1.18
	スイス	825,103,975	1.88
	バミューダ	87,569,491	0.20
	小計	41,832,121,748	95.12
投資証券	アメリカ	1,351,081,868	3.07
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		347,638,728	0.79
合計（純資産総額）		43,976,933,119	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（％）
為替予約取引	売建		68,451,335	0.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	144,472	7,921.50	1,144,435,959	10,092.67	1,458,108,292	3.32
カナダ	株式	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	運輸	42,818	15,827.72	677,711,589	19,824.25	848,834,976	1.93
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	61,300	12,099.01	741,669,777	13,630.71	835,562,554	1.90
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	125,799	6,281.04	790,149,746	6,058.89	762,202,743	1.73
アメリカ	株式	ANADARKO PETROLEUM CORP	エネルギー	60,571	9,190.42	556,673,204	11,300.12	684,460,144	1.56
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	63,011	9,769.81	615,605,913	10,619.26	669,130,349	1.52
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	124,554	5,147.64	641,159,464	5,142.50	640,518,945	1.46
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	10,485	59,451.40	623,347,984	60,416.14	633,463,301	1.44
アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP		60,570	8,533.61	516,881,316	9,899.31	599,601,358	1.36
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	101,929	5,179.71	527,962,661	5,698.91	580,885,064	1.32
スイス	株式	TE CONNECTIVITY LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	87,913	6,135.00	539,346,474	6,517.60	572,982,164	1.30
アメリカ	株式	NOBLE ENERGY INC	エネルギー	81,299	6,926.76	563,139,435	6,895.06	560,561,808	1.27

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	119,190	4,090.34	487,528,161	4,482.20	534,233,776	1.21
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	8,704	59,656.08	519,246,568	61,241.00	533,041,699	1.21
カナダ	株式	KEYERA CORP	エネルギー	67,618	6,666.19	450,755,098	7,675.33	518,990,789	1.18
イギリス	株式	AON PLC	保険	58,412	8,684.26	507,265,467	8,854.35	517,200,672	1.18
アメリカ	株式	US BANCORP	銀行	114,195	4,455.46	508,791,483	4,414.32	504,093,501	1.15
アメリカ	株式	JONES LANG LASALLE INC	不動産	38,663	12,248.40	473,560,141	13,006.41	502,866,869	1.14
アメリカ	株式	PACWEST BANCORP	銀行	114,416	4,482.20	512,835,739	4,373.18	500,361,992	1.14
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	47,407	9,791.31	464,177,107	10,521.55	498,795,358	1.13
アメリカ	株式	BLACKROCK INC	各種金融	15,032	32,853.12	493,848,196	32,379.23	486,724,691	1.11
アメリカ	株式	PHILLIPS 66	エネルギー	57,006	7,986.55	455,281,476	8,404.90	479,129,843	1.09
アメリカ	株式	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	素材	34,001	13,227.26	449,740,287	13,919.71	473,284,366	1.08
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	58,090	7,904.02	459,144,667	7,807.34	453,528,584	1.03
アメリカ	出資金	BROOKFIELD INFRASTRUCTURE PA-LP		108,135	4,018.34	434,524,223	4,125.31	446,090,775	1.01
アメリカ	株式	LOWE'S COS INC	小売	87,651	5,058.16	443,353,045	4,985.13	436,952,462	0.99
アメリカ	株式	KROGER CO	食品・生活必需品小売り	85,399	4,485.28	383,039,153	5,114.73	436,792,870	0.99
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	44,919	7,419.59	333,280,967	9,646.30	433,302,217	0.99
アメリカ	株式	AMERICAN EXPRESS CO	各種金融	46,260	9,360.37	433,011,109	9,350.09	432,535,325	0.98
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	19,411	22,505.63	436,856,920	22,016.07	427,353,954	0.97

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
出資金			1.01
株式	国外	エネルギー	12.65
		素材	4.70
		資本財	5.37
		商業・専門サービス	1.65
		運輸	5.03
		耐久消費財・アパレル	1.18
		消費者サービス	1.29
		メディア	4.12
		小売	4.98
		食品・生活必需品小売り	1.57
		食品・飲料・タバコ	3.80
		家庭用品・パーソナル用品	1.73
		ヘルスケア機器・サービス	3.75

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.59
	銀行	5.47
	各種金融	5.54
	保険	1.18
	不動産	1.98
	ソフトウェア・サービス	9.36
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.04
	電気通信サービス	0.62
	半導体・半導体製造装置	1.52
投資証券		3.07
合 計		99.21

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	665,610.03	67,998,750	68,451,335	0.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2014年 7月31日現在です。

・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	168,797,484	0.46
	ドイツ	4,173,417,407	11.40
	イタリア	171,001,594	0.47
	フランス	5,089,985,829	13.91
	オランダ	2,322,639,530	6.35
	スペイン	544,027,248	1.49
	ベルギー	1,052,537,564	2.88
	オーストリア	162,665,878	0.44
	ルクセンブルク	226,478,963	0.62
	アイルランド	492,934,048	1.35
	ポルトガル	475,154,137	1.30
	イギリス	11,537,934,006	31.52

	スイス	5,377,190,897	14.69
	スウェーデン	1,290,114,215	3.52
	デンマーク	914,521,441	2.50
	トルコ	143,107,365	0.39
	バミューダ	384,861,402	1.05
	ジャージー	941,108,427	2.57
	小計	35,468,477,435	96.90
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,136,517,368	3.10
合計（純資産総額）		36,604,994,803	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（％）
為替予約取引	買建		108,524,303	0.30
	売建		115,700,680	0.32

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	172,043	8,117.75	1,396,603,783	9,099.63	1,565,528,934	4.28
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	342,930	3,754.91	1,287,674,715	4,145.54	1,421,633,461	3.88
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	153,812	7,343.13	1,129,461,512	7,734.97	1,189,731,975	3.25
フランス	株式	DANONE	食品・飲料・タバコ	131,143	6,847.28	897,973,103	7,583.13	994,474,942	2.72
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	852,743	1,052.69	897,682,556	1,116.20	951,840,263	2.60
ドイツ	株式	LINDE AG	素材	44,023	19,393.97	853,780,829	21,551.91	948,780,174	2.59
ドイツ	株式	BAYER AG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	62,351	13,071.70	815,034,066	13,917.80	867,788,748	2.37
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	2,298,770	384.54	883,969,016	351.82	808,771,652	2.21
スイス	株式	UBS AG-REG	各種金融	434,396	1,994.33	866,330,060	1,806.33	784,665,784	2.14
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	302,558	2,782.25	841,795,021	2,479.50	750,192,561	2.05

フランス	株式	GDF SUEZ	公益事業	270,521	2,670.56	722,443,644	2,697.43	729,712,813	1.99
オランダ	株式	AKZO NOBEL NV	素材	95,669	7,843.57	750,387,073	7,523.88	719,802,076	1.97
ベルギー	株式	KBC GROEP NV	銀行	121,642	5,979.14	727,314,791	5,700.09	693,371,199	1.89
フランス	株式	PERNOD-RICARD SA	食品・飲料・タバコ	57,901	11,175.57	647,077,257	11,725.40	678,912,501	1.85
イギリス	株式	RIO TINTO PLC	素材	113,337	5,552.34	629,285,559	5,975.16	677,206,709	1.85
スウェーデン	株式	ERICSSON LM-B SHS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	520,249	1,241.96	646,129,592	1,293.80	673,100,237	1.84
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	71,332	8,393.76	598,743,689	9,213.30	657,203,116	1.80
オランダ	株式	ING GROEP NV-CVA	各種金融	449,456	1,420.71	638,550,229	1,386.26	623,066,470	1.70
ドイツ	株式	SIEMENS AG-REG	資本財	48,183	13,143.36	633,286,708	12,774.06	615,492,533	1.68
ジャーシー	株式	MPP PLC	メディア	290,130	2,134.97	619,421,747	2,089.73	606,296,266	1.66
イギリス	株式	WHITBREAD PLC	消費者サービス	70,611	7,229.70	510,496,347	7,502.88	529,785,860	1.45
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	28,696	17,710.05	508,207,767	17,948.44	515,048,721	1.41
デンマーク	株式	JYSKE BANK-REG	銀行	84,621	5,526.44	467,653,217	5,967.19	504,949,754	1.38
イギリス	株式	BG GROUP PLC	エネルギー	244,411	1,882.68	460,147,702	2,054.06	502,037,302	1.37
スウェーデン	株式	ATLAS COPCO AB-A SHS	資本財	159,951	2,679.19	428,539,151	3,109.01	497,289,898	1.36
オランダ	株式	REED ELSEVIER NV	メディア	204,544	2,102.82	430,120,851	2,359.82	482,688,045	1.32
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SE	資本財	51,439	8,645.57	444,719,578	8,890.85	457,336,742	1.25
イギリス	株式	IG GROUP HOLDINGS PLC	各種金融	429,775	1,104.89	474,858,397	1,063.13	456,910,993	1.25
ドイツ	株式	SYMRISE AG	素材	78,385	4,955.28	388,420,250	5,516.13	432,382,164	1.18
フランス	株式	L'OREAL	家庭用品・パーソナル用品	24,064	17,143.69	412,545,948	17,645.28	424,616,258	1.16

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	6.81
		素材	9.63
		資本財	8.30
		商業・専門サービス	2.39
		運輸	0.97
		自動車・自動車部品	0.46
		耐久消費財・アパレル	3.72
		消費者サービス	4.83
		メディア	3.63
		小売	2.00
		食品・生活必需品小売り	1.16
		食品・飲料・タバコ	9.23

	家庭用品・パーソナル用品	2.96
	ヘルスケア機器・サービス	0.58
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.85
	銀行	8.68
	各種金融	5.76
	保険	2.98
	不動産	1.28
	ソフトウェア・サービス	1.20
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.84
	電気通信サービス	4.30
	公益事業	2.90
	半導体・半導体製造装置	1.45
合 計		96.90

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	ユーロ	買建	787,606.55	107,847,393	108,524,303	0.30
	ユーロ	売建	53,384.77	7,313,964	7,355,887	0.02
	英ポンド	売建	71,769.65	12,410,459	12,487,197	0.03
	スウェーデンクローナ	売建	3,783,632.40	56,376,122	56,527,467	0.15
	デンマーククローネ	売建	2,128,253.85	39,060,812	39,330,129	0.11

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2014年 7月31日現在です。

・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	176,733,548	1.36
	アイルランド	288,279,879	2.21
	イギリス	114,930,939	0.88
	オーストラリア	7,678,229,940	58.90
	パミュダ	302,010,797	2.32
	香港	2,554,001,529	19.59

	シンガポール	1,508,810,466	11.57
	中国	103,091,976	0.79
	小計	12,726,089,074	97.63
投資証券	オーストラリア	124,948,509	0.96
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		184,203,708	1.41
合計(純資産総額)		13,035,241,291	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(%)
為替予約取引	売建		1,065,422	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	280,162	3,427.22	960,177,257	3,740.87	1,048,052,422	8.04
オーストラリア	株式	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	95,807	7,285.12	697,965,875	7,973.82	763,948,692	5.86
オーストラリア	株式	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	215,989	3,336.55	720,659,887	3,374.46	728,847,450	5.59
オーストラリア	株式	AUST AND NZ BANKING GROUP	銀行	191,848	3,107.80	596,226,749	3,247.85	623,093,757	4.78
香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	1,005,200	476.39	478,870,244	550.04	552,901,716	4.24
オーストラリア	株式	WESTPAC BANKING CORP	銀行	157,241	3,224.83	507,075,557	3,295.81	518,236,649	3.98
オーストラリア	株式	WOOLWORTHS LTD	食品・生活必需品 小売り	140,556	3,413.79	479,829,061	3,528.89	496,007,619	3.81
オーストラリア	株式	CSL LTD	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	69,095	6,880.74	475,424,838	6,465.00	446,699,728	3.43
オーストラリア	株式	BRAMBLES LTD	商業・専門サービス	479,717	900.47	431,974,813	891.09	427,474,284	3.28
オーストラリア	株式	RIO TINTO LTD	素材	62,920	5,886.50	370,378,998	6,337.43	398,751,372	3.06
シンガポール	株式	UNITED OVERSEAS BANK LTD	銀行	196,192	1,724.48	338,330,769	1,987.25	389,882,846	2.99
オーストラリア	株式	WESFARMERS LTD	食品・生活必需品 小売り	90,938	3,989.31	362,780,128	4,186.90	380,749,040	2.92
香港	株式	HUTCHISON WHAMPOA LTD	資本財	254,000	1,350.05	342,914,413	1,418.56	360,315,002	2.76
オーストラリア	株式	WOODSIDE PETROLEUM LTD	エネルギー	83,787	3,764.59	315,424,366	4,113.04	344,620,087	2.64
シンガポール	株式	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	電気通信サービス	969,020	295.20	286,058,101	330.51	320,280,490	2.46

パミューダ	株式	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	資本財	82,000	3,430.04	281,263,895	3,683.05	302,010,797	2.32
アイルランド	株式	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	素材	222,954	1,364.94	304,319,190	1,293.00	288,279,879	2.21
香港	株式	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	不動産	207,000	1,165.10	241,176,942	1,332.30	275,787,756	2.12
香港	株式	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	不動産	121,000	1,633.53	197,657,977	1,995.80	241,492,768	1.85
オーストラリア	株式	INCITEC PIVOT LTD	素材	815,104	283.08	230,746,195	285.84	232,990,631	1.79
オーストラリア	株式	COMPUTERSHARE LTD	ソフトウェア・サービス	187,185	1,170.22	219,048,379	1,244.08	232,873,564	1.79
香港	株式	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	不動産	329,000	651.04	214,192,324	692.18	227,727,384	1.75
シンガポール	株式	KEPPEL CORP LTD	資本財	244,700	876.70	214,529,542	910.58	222,819,562	1.71
香港	株式	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	資本財	34,400	5,994.09	206,196,971	6,127.80	210,796,423	1.62
オーストラリア	株式	TELSTRA CORPORATION LTD	電気通信サービス	385,053	480.97	185,200,875	526.60	202,769,218	1.56
アメリカ	株式	RESMED INC-CDI	ヘルスケア機器・サービス	335,612	458.49	153,877,297	526.60	176,733,548	1.36
オーストラリア	株式	AGL ENERGY LTD	公益事業	122,014	1,451.26	177,075,208	1,414.81	172,627,847	1.32
オーストラリア	株式	QBE INSURANCE GROUP LTD	保険	148,256	1,230.65	182,451,780	1,058.95	156,996,699	1.20
オーストラリア	株式	ASX LTD	各種金融	41,639	3,448.42	143,588,884	3,473.26	144,623,206	1.11
シンガポール	株式	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	小売	37,000	3,574.57	132,259,230	3,827.42	141,614,599	1.09

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	2.64
		素材	16.90
		資本財	8.97
		商業・専門サービス	4.23
		耐久消費財・アパレル	0.47
		メディア	0.53
		小売	1.09
		食品・生活必需品小売り	6.73
		ヘルスケア機器・サービス	1.36
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.43
		銀行	25.94
		各種金融	1.11
		保険	6.24
		不動産	10.88
		ソフトウェア・サービス	1.79
電気通信サービス	4.01		
公益事業	1.32		
投資証券			0.96
合計			98.59

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	10,360.00	1,057,756	1,065,422	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2014年 7月31日現在です。

- ・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。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	3,632,249,992	19.43
	カナダ	275,523,197	1.47
	メキシコ	287,571,353	1.54
	ドイツ	1,558,604,005	8.34
	イタリア	2,071,669,740	11.08
	フランス	1,907,617,761	10.21
	オランダ	544,325,132	2.91
	スペイン	1,194,975,744	6.39
	ベルギー	516,354,958	2.76
	オーストリア	310,239,609	1.66
	フィンランド	133,615,859	0.71
	アイルランド	159,076,146	0.85
	イギリス	1,407,074,138	7.53
	スイス	31,973,334	0.17
	スウェーデン	87,622,903	0.47
	ノルウェー	52,104,733	0.28
	デンマーク	215,266,636	1.15
	ポーランド	150,126,039	0.80
	オーストラリア	234,762,492	1.26
	シンガポール	83,264,194	0.45
マレーシア	88,179,903	0.47	
南アフリカ	74,317,859	0.40	
	小計	15,016,515,727	80.34
特殊債券	アメリカ	32,846,535	0.18

	ドイツ	130,379,109	0.70
	フランス	81,090,890	0.43
	イギリス	52,016,099	0.28
	国際機関	127,632,706	0.68
	小計	423,965,339	2.27
社債券	アメリカ	1,333,007,645	7.13
	カナダ	212,409,946	1.14
	フランス	102,723,289	0.55
	オランダ	60,663,890	0.32
	ベルギー	63,172,117	0.34
	イギリス	120,217,245	0.64
	スウェーデン	51,515,709	0.28
	シンガポール	56,797,473	0.30
	英ヴァージン諸島	52,976,701	0.28
	小計	2,053,484,015	10.99
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,198,129,088	6.41
合計（純資産総額）		18,692,094,169	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	2,520,990,127	13.49
	買建	カナダ	12,915,417	0.07
	買建	オーストラリア	73,589,770	0.39
	売建	アメリカ	628,223,870	3.36
	売建	ドイツ	751,299,380	4.02
	売建	オーストラリア	23,346,116	0.12
その他先物取引	売建	アメリカ	513,015,800	2.74

(注)先物取引は、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います。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,697,251,027	9.08
	売建		1,720,638,509	9.21

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------	------	-----------------

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,225,000	10,283.24	1,154,294,229	10,280.98	1,154,040,275	0.500	2016/6/15	6.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,465,000	10,837.81	700,664,982	10,909.33	705,288,290	3.125	2021/5/15	3.77
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,230,000	14,495.31	468,198,830	14,584.44	471,077,564	2.500	2019/5/1	2.52
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,835,000	15,142.85	429,299,805	15,460.38	438,301,890	2.500	2021/1/4	2.34
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,650,000	14,679.65	389,010,890	14,940.35	395,919,322	3.500	2017/11/1	2.12
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	2,400,000	14,259.54	342,229,056	14,204.62	340,911,104	2.000	2016/2/26	1.82
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,150,000	13,927.16	299,433,956	14,794.88	318,089,959	2.250	2024/5/25	1.70
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,845,000	16,240.41	299,635,704	17,098.03	315,458,774	5.500	2021/4/30	1.69
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,880,000	15,146.97	284,763,149	15,793.48	296,917,550	3.000	2022/4/25	1.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,920,000	10,039.92	293,165,890	10,082.51	294,409,411	0.625	2017/11/30	1.58
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,920,000	15,425.90	296,177,433	15,285.98	293,490,876	5.000	2016/10/25	1.57
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,585,000	17,746.72	281,285,583	17,612.70	279,161,367	1.750	2017/1/22	1.49
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,545,000	16,151.53	249,541,262	17,075.77	263,820,659	5.500	2022/9/1	1.41
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,675,000	15,243.48	255,328,337	15,520.63	259,970,673	4.500	2018/1/31	1.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,625,000	9,697.63	254,562,790	9,852.70	258,633,600	1.750	2022/5/15	1.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,485,000	9,444.52	234,696,388	9,947.52	247,195,957	3.125	2043/2/15	1.32
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,105,000	20,828.17	230,151,284	21,189.39	234,142,828	4.750	2030/12/7	1.25
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,630,000	13,801.77	224,968,987	14,139.91	230,480,580	1.000	2019/5/25	1.23
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,605,000	13,832.83	222,017,022	14,152.80	227,152,507	3.500	2030/3/1	1.22
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,525,000	14,634.36	223,173,990	14,661.22	223,583,605	3.750	2016/8/1	1.20
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,985,000	10,300.26	204,460,295	10,243.21	203,327,860	1.625	2019/3/31	1.09
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,365,000	14,950.14	204,069,519	14,830.38	202,434,712	4.000	2016/7/15	1.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,075,000	9,250.87	191,955,664	9,745.03	202,209,528	3.000	2042/5/15	1.08
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,325,000	14,948.58	198,068,696	15,100.28	200,078,796	3.750	2024/9/1	1.07
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	8,975,000	2,164.78	194,289,710	2,186.73	196,259,771	4.000	2019/11/15	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,880,000	10,248.84	192,678,225	10,268.12	193,040,771	1.500	2018/8/31	1.03
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,355,000	13,853.03	187,708,611	14,158.05	191,841,616	1.000	2018/11/25	1.03
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	22,073,100	836.25	184,586,500	835.18	184,351,702	8.000	2015/12/17	0.99
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	810,000	19,997.52	161,979,952	21,044.68	170,461,982	5.500	2031/1/4	0.91
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	830,000	18,139.23	150,555,688	19,736.26	163,811,005	5.000	2035/3/28	0.88

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.34
特殊債券	2.27
社債券	10.99
合計	93.59

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	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	TNOTE2Y 1409	買建	17	米ドル	3,733,559.47	383,996,591	3,728,312.5	383,456,940	2.05
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TNOTE5Y 1409	買建	118	米ドル	14,038,665.68	1,443,876,765	14,018,953.42	1,441,849,359	7.71
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TNOTE10Y1409	売建	49	米ドル	6,138,130.34	631,306,705	6,108,156.25	628,223,870	3.36
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TBOND20Y1409	買建	47	米ドル	6,461,628.08	664,578,448	6,462,500	664,668,125	3.56
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TBOND30Y1409	買建	2	米ドル	296,051.11	30,448,856	301,562.5	31,015,703	0.17
	カナダ	モントリオール取引所	CAN 10Y 1409	買建	1	加ドル	134,815.47	12,710,402	136,990	12,915,417	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BOBL5Y 1409	売建	16	ユーロ	2,050,362.76	282,539,988	2,052,800	282,875,840	1.51
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1409	売建	9	ユーロ	1,335,979.91	184,098,032	1,332,900	183,673,620	0.98
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUXL30Y 1409	売建	15	ユーロ	2,041,503.16	281,319,135	2,066,400	284,749,920	1.52
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR03Y1409	買建	7	豪ドル	762,040	73,094,877	767,199.44	73,589,770	0.39
オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR10Y1409	売建	2	豪ドル	243,198.56	23,327,605	243,391.54	23,346,116	0.12	
その他先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	90DEURO 1409	売建	20	米ドル	4,987,994.15	513,015,198	4,988,000	513,015,800	2.74

(注)先物取引は、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います。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	13,400,639.03	1,363,747,753	1,377,991,707	7.37
	加ドル	買建	2,444,000.00	230,742,669	230,224,800	1.23
	ユーロ	買建	146,000.00	19,976,925	20,117,340	0.11
	英ポンド	買建	223,000.00	38,476,833	38,784,160	0.21
	スウェーデンクローナ	買建	780,000.00	11,562,543	11,653,200	0.06
	南アフリカランド	買建	1,929,000.00	18,396,462	18,479,820	0.10
	米ドル	売建	3,451,548.85	351,065,938	354,925,875	1.90
	加ドル	売建	1,127,000.00	106,433,880	106,163,400	0.57
	メキシコペソ	売建	10,967,000.00	85,652,270	85,652,270	0.46
	ユーロ	売建	4,281,000.00	587,524,440	589,878,990	3.16
	英ポンド	売建	417,702.35	72,340,495	72,660,154	0.39

スイスフラン	売建	987,000.00	111,511,260	111,767,880	0.60
デンマーククローネ	売建	3,319,000.00	61,102,790	61,335,120	0.33
トルコリラ	売建	290,000.00	13,899,700	13,914,200	0.07
ポーランドズロチ	売建	688,000.00	22,786,560	22,752,160	0.12
豪ドル	売建	2,381,000.00	226,361,670	227,885,510	1.22
ニュージーランドドル	売建	315,000.00	27,742,050	27,445,950	0.15
シンガポールドル	売建	393,000.00	32,174,910	32,461,800	0.17
南アフリカランド	売建	1,440,000.00	13,766,400	13,795,200	0.07

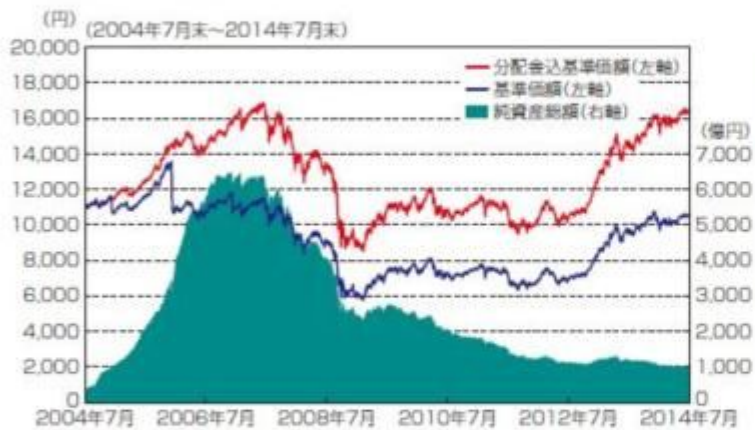
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2014年7月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,582円

純資産総額…………… 983.60億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金込基準価額は、2004年7月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金込基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2010年1月	2011年1月	2012年1月	2013年1月	2014年1月	設定来累計
50円	30円	30円	30円	350円	6,750円

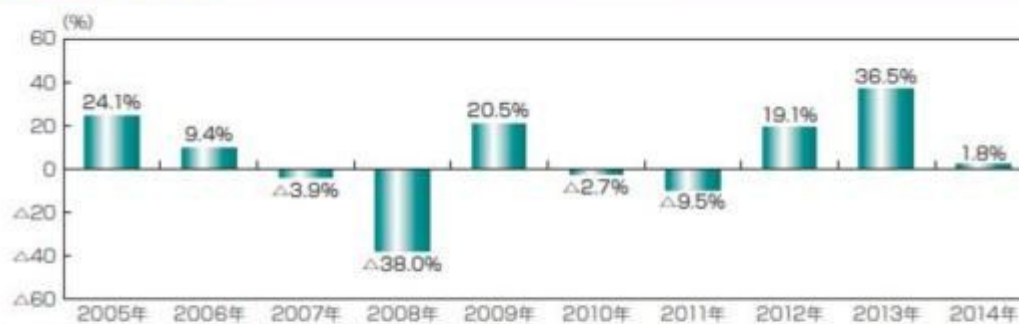
主要な資産の状況

組入資産	比率※1	組入上位銘柄	業種名・種類	比率※2
日本大型株式 グローバル・ラップ マザーファンド	19.33%	トヨタ自動車	輸送用機器	6.8%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4.5%
		ソフトバンク	情報・通信業	3.5%
日本小型株式 グローバル・ラップ マザーファンド	6.51%	西尾レントオール	サービス業	2.1%
		岡村製作所	その他製品	2.0%
		エレコム	電気機器	2.0%
日本債券 グローバル・ラップ マザーファンド	19.21%	第320回利付国債(10年)	国債証券	7.5%
		第334回利付国債(10年)	国債証券	7.2%
		第123回利付国債(20年)	国債証券	5.2%
北米株式 グローバル・ラップ マザーファンド	20.96%	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェア	3.3%
		CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	運輸	1.9%
		CHEVRON CORP	エネルギー	1.9%
欧州先進国株式 グローバル・ラップ マザーファンド	17.05%	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー	4.3%
		ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	3.9%
		NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	3.3%
アジア太平洋株式 グローバル・ラップ マザーファンド	6.02%	BHP BILLITON LTD	素材	8.0%
		COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	5.9%
		NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	5.6%
海外債券 グローバル・ラップ マザーファンド	9.94%	US TREASURY N/B	国債証券	6.2%
		US TREASURY N/B	国債証券	3.8%
		BUONI POLIENNALI DEL TES	国債証券	2.5%
現金その他	0.99%			

※1:当ファンドの対純資産総額比です。

※2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

※2014年は、2014年7月末までの騰落率です。

※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別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

運用報告書の作成

委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は原則として知れている受益者に対して交付されます。

<訂正後>

運用報告書の作成

委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。運用報告書は原則として知れている受益者に対して交付されます。

上記規定は、2014年12月1日以降、以下の通り変更となります。

- ・ 委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・ 交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

第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）に基づき作成しております。
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26年 1月11日から平成26年 7月10日まで）の中間財務諸表について、あらた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】

【GW7つの卵】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)	
当中間計算期間末 平成26年 7月10日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,883,502,286
親投資信託受益証券	97,602,983,829
未収入金	345,321,431
未収利息	2,897
流動資産合計	99,831,810,443
資産合計	99,831,810,443
負債の部	
流動負債	
未払解約金	259,436,343
未払受託者報酬	27,000,332
未払委託者報酬	945,013,638
その他未払費用	2,603,933
流動負債合計	1,234,054,246
負債合計	1,234,054,246
純資産の部	
元本等	
元本	94,034,676,043
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,563,080,154
（分配準備積立金）	79,225
元本等合計	98,597,756,197
純資産合計	98,597,756,197
負債純資産合計	99,831,810,443

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)	
当中間計算期間 自 平成26年 1月11日 至 平成26年 7月10日	
営業収益	
受取利息	377,698
有価証券売買等損益	1,943,495,753
営業収益合計	1,943,873,451
営業費用	

	当中間計算期間 自 平成26年 1月11日 至 平成26年 7月10日
受託者報酬	27,000,332
委託者報酬	945,013,638
その他費用	2,603,933
営業費用合計	974,617,903
営業利益又は営業損失（ ）	969,255,548
経常利益又は経常損失（ ）	969,255,548
中間純利益又は中間純損失（ ）	969,255,548
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（ ）	102,553,342
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	3,845,794,154
剰余金増加額又は欠損金減少額	73,538,709
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	73,538,709
剰余金減少額又は欠損金増加額	428,061,599
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	428,061,599
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,563,080,154

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

		当中間計算期間末 平成26年 7月10日現在
1.	期首元本額	103,346,324,622円
	期中追加設定元本額	2,210,329,850円
	期中一部解約元本額	11,521,978,429円
2.	受益権の総数	94,034,676,043口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 平成26年 1月11日 至 平成26年 7月10日	
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	233,929,962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

	当中間計算期間末 平成26年 7月10日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額は ありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載 しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品 の時価を帳簿価額としております。
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。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成26年 7月10日現在
1口当たり純資産額	1.0485円
(1万口当たり純資産額)	(10,485円)

当ファンドは、「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本小型株式グローバル・ラップマ
ザーファンド」「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」「北米株式グローバル・ラップマザーファン
ド」「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマ
ザーファンド」「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」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」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通り
です。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年 7月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	305,464,498
株式	39,976,651,700

平成26年 7月10日現在

未収入金	395,555,938
未収配当金	20,345,100
未収利息	469
流動資産合計	40,698,017,705
資産合計	40,698,017,705
負債の部	
流動負債	
未払金	123,288,738
未払解約金	75,153,666
流動負債合計	198,442,404
負債合計	198,442,404
純資産の部	
元本等	
元本	25,620,722,322
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,878,852,979
元本等合計	40,499,575,301
純資産合計	40,499,575,301
負債純資産合計	40,698,017,705

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年 7月10日現在
1.	期首	平成26年 1月11日
	期首元本額	26,983,497,381円
	期首からの追加設定元本額	409,813,243円
	期首からの一部解約元本額	1,772,588,302円
	元本の内訳	
	GW7つの卵	11,890,515,293円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	114,564円

グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	392,344,487円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	842,475,163円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	5,988,411,780円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	2,750,773,054円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	2,489,228,471円
日本大型株式ファンド	127,273,456円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	43,279,559円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	123,363,281円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	174,111,149円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	414,607,100円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	384,224,965円
計	25,620,722,322円
2. 受益権の総数	25,620,722,322口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
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。

（1口当たり情報）

平成26年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	1.5807円
(1万口当たり純資産額)	(15,807円)

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年 7月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	585,626,096
株式	13,165,816,000
未収入金	3,221,400
未収配当金	9,619,800
未収利息	900
流動資産合計	13,764,284,196
資産合計	13,764,284,196
負債の部	
流動負債	
未払解約金	29,747,107
流動負債合計	29,747,107
負債合計	29,747,107
純資産の部	
元本等	
元本	4,078,902,848
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,655,634,241
元本等合計	13,734,537,089
純資産合計	13,734,537,089
負債純資産合計	13,764,284,196

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 7月10日現在
1. 期首	平成26年 1月11日

期首元本額	4,822,624,219円
期首からの追加設定元本額	25,000,430円
期首からの一部解約元本額	768,721,801円
元本の内訳	
GW7つの卵	1,911,803,416円
グローバル・ラップ・バランス 安定型	41,853円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	92,099,992円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	182,886,996円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	969,483,932円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	386,434,067円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	258,805,795円
日本小型株式ファンド	73,679,056円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	15,522,201円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	28,955,691円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	38,271,456円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	67,016,739円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	53,901,654円
計	4,078,902,848円
2. 受益権の総数	4,078,902,848口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
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。

（1口当たり情報）

平成26年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	3.3672円
(1万口当たり純資産額)	(33,672円)

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
平成26年 7月10日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	454,133,377
国債証券	20,328,148,000
地方債証券	115,318,000
特殊債券	2,008,080,000
社債券	15,284,254,314
未収利息	74,971,160
前払費用	9,794,509
流動資産合計	38,274,699,360
資産合計	38,274,699,360
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
流動負債合計	200,000,000
負債合計	200,000,000
純資産の部	
元本等	
元本	30,364,825,702
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,709,873,658
元本等合計	38,074,699,360
純資産合計	38,074,699,360
負債純資産合計	38,274,699,360

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p>
-----------------	--

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
--	--

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年 7月10日現在
1.	期首	平成26年 1月11日
	期首元本額	32,427,240,890円
	期首からの追加設定元本額	433,142,787円
	期首からの一部解約元本額	2,495,557,975円
	元本の内訳	
	GW7つの卵	15,326,769,846円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	1,074,808円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	2,110,158,213円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	2,823,312,606円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	7,452,448,837円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	363,876,111円
	日本債券ファンド	57,459,621円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(安定型)	418,267,198円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(安定成長型)	671,759,134円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(成長型)	563,460,560円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(積極成長型)	523,940,869円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(積極型)	52,297,899円
	計	30,364,825,702円
2.	受益権の総数	30,364,825,702口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		平成26年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	

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。
-------------------------	---

(1口当たり情報)

平成26年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	1.2539円
(1万口当たり純資産額)	(12,539円)

北米株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年 7月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	238,524,995
コール・ローン	24,786,637
出資金	455,259,322
株式	42,034,209,831
投資証券	1,305,509,888
派生商品評価勘定	194,850
未収入金	982,651,348
未収配当金	33,772,168
未収利息	38
流動資産合計	45,074,909,077
資産合計	45,074,909,077
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,466
未払金	813,383,788
未払解約金	271,478,285
流動負債合計	1,084,911,539
負債合計	1,084,911,539
純資産の部	
元本等	
元本	24,511,833,781
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	19,478,163,757
元本等合計	43,989,997,538
純資産合計	43,989,997,538
負債純資産合計	45,074,909,077

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>出資金、株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「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条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年 7月10日現在
1.	期首	平成26年 1月11日
	期首元本額	27,661,790,414円
	期首からの追加設定元本額	151,408,701円
	期首からの一部解約元本額	3,301,365,334円
	元本の内訳	
	GW 7つの卵	11,484,972,744円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	135,866円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	380,617,130円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	784,892,236円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	5,741,724,191円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	2,379,524,757円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	2,604,477,113円
	北米株式ファンド	68,698,552円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	51,562,702円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	120,550,971円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	159,441,842円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	399,458,944円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	335,776,733円
	計	24,511,833,781円
2.	受益権の総数	24,511,833,781口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成26年 7月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	79,164,593	-	79,173,256	8,663
	米ドル	13,933,349	-	13,925,158	8,191
	加ドル	65,231,244	-	65,248,098	16,854
	売建	350,642,878	-	350,506,157	136,721
	米ドル	336,709,529	-	336,560,918	148,611
	加ドル	13,933,349	-	13,945,239	11,890
	合計	429,807,471	-	429,679,413	145,384

（注）1.時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成26年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	1.7946円
(1万口当たり純資産額)	(17,946円)

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年 7月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	860,468,570
コール・ローン	20,017,309
株式	35,521,324,993
派生商品評価勘定	195,387
未収入金	322,153,237
未収配当金	100,649,105
未収利息	30
流動資産合計	36,824,808,631
資産合計	36,824,808,631
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	458,738
未払金	118,543,778
未払解約金	94,083,612
流動負債合計	213,086,128
負債合計	213,086,128
純資産の部	
元本等	
元本	14,113,872,214
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	22,497,850,289
元本等合計	36,611,722,503
純資産合計	36,611,722,503
負債純資産合計	36,824,808,631

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>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「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条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年 7月10日現在
1.	期首	平成26年 1月11日
	期首元本額	15,629,328,362円
	期首からの追加設定元本額	173,267,888円
	期首からの一部解約元本額	1,688,724,036円
	元本の内訳	
	GW 7つの卵	6,469,298,913円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	61,740円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	189,400,591円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	445,694,617円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	3,179,393,563円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	1,420,205,016円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	1,761,740,635円
	欧州先進国株式ファンド	47,768,075円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	23,839,210円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	60,517,395円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	89,739,595円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	222,546,132円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	203,666,732円

	計	14,113,872,214円
2.	受益権の総数	14,113,872,214口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成26年 7月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	106,936,830	-	107,132,217	195,387
	ユーロ	88,067,607	-	88,259,777	192,170
	英ポンド	18,869,223	-	18,872,440	3,217
	売建	201,020,442	-	201,479,180	458,738
	ユーロ	112,952,835	-	113,173,503	220,668
	英ポンド	30,795,216	-	30,853,630	58,414
	スイスフラン	37,409,925	-	37,498,706	88,781
	スウェーデンクローナ	10,392,870	-	10,455,814	62,944

	デンマーククローネ	8,526,769	-	8,549,765	22,996
	トルコリラ	942,827	-	947,762	4,935
	合計	307,957,272	-	308,611,397	263,351

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成26年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	2.5940円
(1万口当たり純資産額)	(25,940円)

アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年 7月10日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	274,537,758
コール・ローン	141,661,654
株式	12,364,397,036
投資証券	123,096,408
未収配当金	13,784,896
未収利息	217
流動資産合計	12,917,477,969
資産合計	12,917,477,969
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	83,316
未払金	16,194,366
未払解約金	25,222,655
流動負債合計	41,500,337

平成26年 7月10日現在

負債合計	41,500,337
純資産の部	
元本等	
元本	2,411,547,525
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,464,430,107
元本等合計	12,875,977,632
純資産合計	12,875,977,632
負債純資産合計	12,917,477,969

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>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「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条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年 7月10日現在
1.	期首	平成26年 1月11日
	期首元本額	2,740,286,860円
	期首からの追加設定元本額	37,150,319円
	期首からの一部解約元本額	365,889,654円
	元本の内訳	
	GW7つの卵	1,105,570,138円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	10,629円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	25,913,530円

グローバル・ラップ・バランス 成長型	63,871,595円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	543,745,715円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	230,545,176円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	321,098,088円
アジア太平洋先進国株式ファンド	24,925,737円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	3,977,067円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	8,264,653円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	12,841,805円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	38,020,109円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	32,763,283円
計	2,411,547,525円
2. 受益権の総数	2,411,547,525口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成26年 7月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	33,210,081	-	33,293,397	83,316

	米ドル	5,026,725	-	5,027,220	495
	豪ドル	22,217,162	-	22,284,641	67,479
	シンガポールドル	5,966,194	-	5,981,536	15,342
	合計	33,210,081	-	33,293,397	83,316

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成26年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	5.3393円
(1万口当たり純資産額)	(53,393円)

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成26年 7月10日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	635,841,281
コール・ローン	11,277,276
国債証券	15,218,586,466
特殊債券	425,362,968
社債券	1,972,171,463
派生商品評価勘定	14,099,686
未収利息	147,854,672
前払費用	22,512,351
差入委託証拠金	310,370,933
流動資産合計	18,758,077,096
資産合計	18,758,077,096
負債の部	
流動負債	

平成26年 7月10日現在	
派生商品評価勘定	30,167,319
流動負債合計	30,167,319
負債合計	30,167,319
純資産の部	
元本等	
元本	8,194,312,907
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,533,596,870
元本等合計	18,727,909,777
純資産合計	18,727,909,777
負債純資産合計	18,758,077,096

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 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で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「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条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年 7月10日現在
1.	期首	平成26年 1月11日
	期首元本額	8,944,447,267円
	期首からの追加設定元本額	92,155,591円
	期首からの一部解約元本額	842,289,951円

元本の内訳	
GW7つの卵	4,312,719,769円
グローバル・ラップ・バランス 安定型	70,679円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	181,093,066円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	343,008,788円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	2,100,967,998円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	778,208,721円
海外債券ファンド	65,602,653円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	27,420,008円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	57,635,098円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	68,460,958円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	147,599,800円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	111,525,369円
計	8,194,312,907円
2. 受益権の総数	8,194,312,907口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（債券関連）

（平成26年 7月10日現在）

（単位：円）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引	債券先物取引					
	買建	3,368,679,812	-	3,374,874,541	6,194,729	
	売建	1,292,160,362	-	1,303,482,417	11,322,055	
合計		4,660,840,174	-	4,678,356,958	5,127,326	

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成26年 7月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	2,578,921,871	-	2,570,238,989	8,682,882	
	米ドル	2,137,847,939	-	2,127,397,459	10,450,480	
	加ドル	286,573,935	-	288,542,540	1,968,605	
	メキシコペソ	28,871,176	-	28,934,000	62,824	
	スイスフラン	6,602,340	-	6,614,320	11,980	
	スウェーデンクローナ	39,907,430	-	39,393,250	514,180	
	ノルウェークローネ	911,665	-	906,950	4,715	
	豪ドル	46,878,470	-	46,949,420	70,950	
	ニュージーランドドル	28,011,481	-	28,183,050	171,569	
	南アフリカランド	3,317,435	-	3,318,000	565	
	売建	2,582,587,694	-	2,584,848,730	2,261,036	
	米ドル	445,805,674	-	444,672,600	1,133,074	
	加ドル	512,442,060	-	516,309,200	3,867,140	

	メキシコペソ	85,761,940	-	85,761,940	-
	ユーロ	713,399,610	-	712,439,780	959,830
	英ポンド	263,948,000	-	264,875,200	927,200
	スイスフラン	112,547,610	-	112,557,480	9,870
	デンマーククローネ	61,766,590	-	61,700,210	66,380
	トルコリラ	13,789,500	-	13,864,900	75,400
	ポーランドズロチ	23,013,600	-	23,089,280	75,680
	豪ドル	276,325,830	-	275,576,840	748,990
	ニュージーランド ドル	28,063,350	-	28,183,050	119,700
	シンガポールドル	32,072,730	-	32,167,050	94,320
	南アフリカランド	13,651,200	-	13,651,200	-
	合計	5,161,509,565	-	5,155,087,719	10,943,918

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの中間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中間同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(金利関連)

(平成26年 7月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	金利先物取引				
	売建	506,634,771	-	506,631,160	3,611
	合計	506,634,771	-	506,631,160	3,611

（注）1.時価の算定方法

金利先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2.金利先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

平成26年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	2.2855円
(1万口当たり純資産額)	(22,855円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2014年 7月31日現在です。

【GW7つの卵】

【純資産額計算書】

資産総額	98,659,746,871円
負債総額	299,590,444円
純資産総額（ - ）	98,360,156,427円
発行済口数	92,946,683,732口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0582円

（参考）

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	40,986,897,257円
負債総額	175,606,371円
純資産総額（ - ）	40,811,290,886円
発行済口数	25,322,127,685口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6117円

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	13,816,564,165円
負債総額	171,086,306円
純資産総額（ - ）	13,645,477,859円
発行済口数	3,949,919,219口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4546円

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	37,749,304,876円
負債総額	17,344,928円
純資産総額（ - ）	37,731,959,948円
発行済口数	30,039,193,419口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2561円

北米株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	44,215,381,666円
負債総額	238,448,547円
純資産総額（ - ）	43,976,933,119円
発行済口数	24,270,224,770口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8120円

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	36,619,753,409円
負債総額	14,758,606円
純資産総額（ - ）	36,604,994,803円
発行済口数	14,118,195,966口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5928円

アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	13,078,178,205円
負債総額	42,936,914円
純資産総額（ - ）	13,035,241,291円
発行済口数	2,365,602,011口
1口当たり純資産額（ / ）	5.5103円

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	19,263,251,632円
負債総額	571,157,463円
純資産総額（ - ）	18,692,094,169円
発行済口数	8,117,010,719口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3028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】

< 更新後 >

(1) 資本金の額

平成26年7月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

(2) 会社の意思決定機関（平成26年7月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役・監査役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

当社の取締役会は10名以内の取締役で構成され、取締役の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、代表取締役若干名を選定します。

・監査役会

当社の監査役会は5名以内の監査役で構成され、監査役の任期は選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までを任期とします。監査役会は、その決議をもって常勤の監査役を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（平成26年7月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用に関するリスク・パフォーマンスの評価と分析および法令など遵守状況のモニタリングとリスクの管理については、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

< 更新後 >

- ・「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、証券投資信託の設定を行なうとともに「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）を行

なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。

- ・委託会社の運用する、平成26年7月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	516	96,554
株式投資信託	459	74,962
単位型	67	1,779
追加型	392	73,183
公社債投資信託	57	21,591
単位型	41	329
追加型	16	21,262
投資法人合計	1	43

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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、以下「財務諸表等規則」という。）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8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成していません。

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55期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

<更新後>

	第54期 (平成25年3月31日)		第55期 (平成26年3月31日)	
(単位：百万円)				
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	15,820	3	17,805
有価証券		-		234
前払費用	3	380	3	419
未収入金		4		37
未収委託者報酬		7,472		7,162
未収収益	3	342	3	608
関係会社短期貸付金		606		240
立替金		335		303
繰延税金資産		869		984
その他	2	30	2	30

流動資産合計		25,862		27,826
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	48	1	47
器具備品	1	124	1	134
有形固定資産合計		172		181
無形固定資産				
ソフトウェア		70		91
無形固定資産合計		70		91
投資その他の資産				
投資有価証券		7,170		7,290
関係会社株式		22,935		21,702
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		706		692
繰延税金資産		500		525
投資その他の資産合計		31,373		30,271
固定資産合計		31,616		30,544
資産合計		57,478		58,371

(単位：百万円)

		第54期 (平成25年3月31日)		第55期 (平成26年3月31日)
負債の部				
流動負債				
預り金		305		329
未払金		3,862		3,404
未払収益分配金		6		6
未払償還金		115		112
未払手数料	3	3,195	3	2,743
その他未払金		545		542
未払費用	3	3,282	3	3,239
未払法人税等		589		2,286
未払消費税等	4	123	4	356
賞与引当金		1,770		1,935
役員賞与引当金		80		150
流動負債合計		10,012		11,702
固定負債				
退職給付引当金		1,001		1,081
その他		55		55
固定負債合計		1,057		1,137
負債合計		11,070		12,840
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220

資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	23,530	22,694
利益剰余金合計	23,530	22,694
自己株式	68	68
株主資本合計	46,045	45,209
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	362	321
評価・換算差額等合計	362	321
純資産合計	46,408	45,531
負債純資産合計	57,478	58,371

(2) 【損益計算書】

< 更新後 >

	(単位：百万円)	
	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,848	63,120
その他営業収益	1,922	2,557
営業収益合計	54,771	65,678
営業費用		
支払手数料	26,955	31,207
広告宣伝費	649	1,081
公告費	7	2
調査費	10,797	13,405
調査費	691	712
委託調査費	10,089	12,669
図書費	17	23
委託計算費	406	465
営業雑経費	530	558
通信費	188	186
印刷費	214	252
協会費	46	43
諸会費	16	11
その他	64	65
営業費用計	39,347	46,721
一般管理費		
給料	6,759	7,171
役員報酬	256	316
役員賞与引当金繰入額	80	150
給料・手当	4,565	4,719
賞与	87	50
賞与引当金繰入額	1,770	1,935
交際費	100	108
寄付金	66	54

旅費交通費	313	448
租税公課	188	209
不動産賃借料	753	755
退職給付費用	312	313
退職金	83	32
固定資産減価償却費	124	109
諸経費	3,061	3,364
一般管理費計	11,764	12,568
営業利益	3,659	6,388

(単位：百万円)

	第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月 31日)		第55期 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月 31日)	
営業外収益				
受取利息		12		17
受取配当金	1	601	1	1,774
時効成立分配金・償還金 為替差益		4		4
その他		64		26
その他		16		19
営業外収益合計		699		1,842
営業外費用				
支払利息		19		19
有価証券償還損		1		-
時効成立後支払分配金・償還金		15		22
支払源泉所得税		55		57
その他		2		13
営業外費用合計		93		114
経常利益		4,265		8,116
特別利益				
投資有価証券売却益		226		135
関係会社株式売却益		239		-
特別利益合計		465		135
特別損失				
投資有価証券売却損		84		12
関係会社株式評価損		-		4,500
固定資産処分損		3		0
割増退職金		-		59
役員退職一時金		75		235
特別損失合計		163		4,807
税引前当期純利益		4,568		3,445
法人税、住民税及び事業税		1,480		3,020
法人税等調整額		260		119
法人税等合計		1,740		2,900
当期純利益		2,827		544

(3) 【株主資本等変動計算書】

< 更新後 >

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,172	22,172	68	44,687
当期変動額							
剰余金の配当				1,468	1,468		1,468
当期純利益				2,827	2,827		2,827
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	1,358	1,358	-	1,358
当期末残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	42	42	44,729
当期変動額			
剰余金の配当			1,468
当期純利益			2,827
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	320	320	320
当期変動額合計	320	320	1,678
当期末残高	362	362	46,408

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
当期変動額							
剰余金の配当				1,380	1,380		1,380
当期純利益				544	544		544
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	836	836	-	836
当期末残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他	評価・換算	

	有価証券評 価差額金	差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
当期変動額			
剰余金の配当			1,380
当期純利益			544
株主資本以外の項目の当 期変動額（純額）	40	40	40
当期変動額合計	40	40	876
当期末残高	321	321	45,531

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算末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、総平均法により算定) 時価のないもの 総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 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～5年 器具備品 4年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(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) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、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、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、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(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。
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（表示方法の変更）

第55期 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
<p>「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年 5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年 5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。</p> <p>退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っていません。</p>

（貸借対照表関係）

第54期 (平成25年 3月31日)	第55期 (平成26年 3月31日)								
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,054百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">618百万円</td> </tr> </table> <p>2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 3,818百万円 前払費用 2百万円 未収収益 58百万円 (流動負債) 未払手数料 143百万円 未払費用 297百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務87百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務243百万円に対して保証を行っております。</p>	建物	1,054百万円	器具備品	618百万円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,091百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">625百万円</td> </tr> </table> <p>2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 6,249百万円 前払費用 2百万円 未収収益 74百万円 (流動負債) 未払手数料 98百万円 未払費用 274百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務65百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務159百万円に対して保証を行っております。</p>	建物	1,091百万円	器具備品	625百万円
建物	1,054百万円								
器具備品	618百万円								
建物	1,091百万円								
器具備品	625百万円								

（損益計算書関係）

第54期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	第55期 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)				
<p>1 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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">552百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	552百万円	<p>1 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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,290百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	1,290百万円
受取配当金	552百万円				
受取配当金	1,290百万円				

（株主資本等変動計算書関係）

第54期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	109,600	-	-	109,600

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	19,215,900	-	2,237,400	16,978,500	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,676,400	-	49,500	1,626,900	-
平成22年度ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	6,091,800	-	161,700	5,930,100	-
合計		32,249,300	-	2,448,600	29,800,700	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。

3 平成21年度ストックオプション(1)13,625,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,287,000株、平成22年度ストックオプション(1)1,732,500株及び第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年5月28日取締役会	普通株式	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19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(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日取締役会	普通株式	利益剰余金	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18日

第55期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	109,600	-	-	109,600

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
		当事業年度 期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
平成21年度 ストックオプション(1)	普通株式	16,978,500	-	1,075,800	15,902,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,626,900	-	59,400	1,567,500	-
平成22年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,310,000	-	-	2,310,000	-
第1回新株予約権	普通株式	2,955,200	-	-	2,955,200	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	5,930,100	-	541,200	5,388,900	-
合計		29,800,700	-	1,676,400	28,124,300	-

(注) 1 平成21年度ストックオプション(1)、平成21年度ストックオプション(2)及び平成23年度ストックオプション(1)の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。

3 平成21年度ストックオプション(1)15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2)1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1)2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株及び平成23年度ストックオプション(1)2,887,500株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年5月27日 取締役会	普通株式	1,380	7.01	平成25年3月31日	平成25年6月18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
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
オペレーティング・リース取引	オペレーティング・リース取引

解約不能のものに係る未経過リース料		解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	750百万円	1年内	751百万円
1年超	807百万円	1年超	77百万円
合計	1,558百万円	合計	828百万円

（金融商品関係）

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25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、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

(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

当社は、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

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

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・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。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成25年3月31日（当事業年度の決算日）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、次表には含めておりません。

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金・預金	15,820	15,820	-
(2) 未収委託者報酬	7,472	7,472	-
(3) 未収収益	342	342	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	7,091	7,091	-
(5) 未払金	(3,862)	(3,862)	-
(6) 未払費用	(3,282)	(3,282)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 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。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額79百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額20,042百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額2,892百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 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:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,820	-	-	-
未収委託者報酬	7,472	-	-	-
未収収益	342	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	385	1,299	920
合計	23,635	385	1,299	920

第55期(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、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているた

め、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

(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

当社は、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

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

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・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。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成26年3月31日（当事業年度の決算日）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、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額()	時価()	差額
(1) 現金・預金	17,805	17,805	-
(2) 未収委託者報酬	7,162	7,162	-
(3) 未収収益	608	608	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,457	7,457	-
(5) 未払金	(3,404)	(3,404)	-
(6) 未払費用	(3,239)	(3,239)	-

()負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(5) 未払金及び(6) 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。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額66百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額18,809百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 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：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	17,805	-	-	-
未収委託者報酬	7,162	-	-	-
未収収益	608	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	234	315	1,166	973
合計	25,811	315	1,166	973

(有価証券関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上 額
子会社株式	20,042
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	投資信託	6,366	5,708	658
	小計	6,366	5,708	658
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	投資信託	724	821	96
	小計	724	821	96
合計		7,091	6,529	561

(注) 1 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すべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、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。当事業年度については、該当ございません。

- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 79百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、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 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	43	35	67
投資信託	1,099	190	17
合計	1,143	226	84

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	18,809
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,819	3,188	631
	小計	3,819	3,188	631
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,637	3,768	130
	小計	3,637	3,768	130
合計		7,457	6,957	500

(注) 1 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すべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、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。当事業年度については、該当ございません。

- 2 非上場株式等(貸借対照表計上額 66百万円)については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、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 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
株式	23	11	-
投資信託	1,734	124	12
合計	1,758	135	12

(持分法損益等)

第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,069	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,065
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,280	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 7,660
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,159	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,379

(退職給付関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 退職給付債務に関する事項

(単位：百万円)

イ 退職給付債務	1,101
ロ 未積立退職給付債務	1,101
ハ 未認識数理計算上の差異	99
ニ 退職給付引当金残高	1,001

3 退職給付費用に関する事項

(単位：百万円)

イ 勤務費用	102
ロ 利息費用	13
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	24
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	171
ホ 退職給付費用合計	312

4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例
ロ 割引率	0.9%
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年

第55期(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、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	1,101	百万円
勤務費用	110	"
利息費用	9	"
数理計算上の差異の発生額	9	"
退職給付の支払額	56	"
退職給付債務の期末残高	1,174	"

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,174	百万円
未積立退職給付債務	1,174	"
未認識数理計算上の差異	92	"
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

退職給付引当金	1,081	百万円
貸借対照表に計上された負債の額	1,081	"

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	110	百万円
利息費用	9	"
数理計算上の差異の費用処理額	16	"
確定給付制度に係る退職給付費用	137	"

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率	0.8%
-----	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、176百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年1月22日から平成32年1月21日まで	同左

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名

株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,215,900	1,676,400
付与	0	0
失効	2,237,400	49,500
権利確定	0	0
権利未確定残	16,978,500	1,626,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	6,091,800
付与	0	0
失効	0	161,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,930,100
権利確定後(株)		
期首	-	-

権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2月 8日	平成22年 8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8月20日	平成23年10月7日
権利行使価格(円)	625	737 (注) 3
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第55期(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年 2月 8日	平成22年 8月20日
権利確定条件	平成24年 1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。） 、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年 1月22日から 平成32年 1月21日まで	同左

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年 8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年 1月22日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	平成25年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年 1月22日から平成32年 1月21日まで	平成25年10月7日から平成33年10月6日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

ストックオプション(新株予約権)の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2月 8日	平成22年 8月20日
権利確定前(株)		
期首	16,978,500	1,626,900
付与	0	0
失効	1,075,800	59,400
権利確定	0	0
権利未確定残	15,902,700	1,567,500
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,930,100
付与	0	0
失効	0	541,200
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,388,900
権利確定後(株)		
期首	-	-

権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年 2 月 8 日	平成22年 8 月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年 8 月20日	平成23年10月7日
権利行使価格(円)	625	737 (注) 3
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

- 2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 - 百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第54期 (平成25年 3 月31日)	第55期 (平成26年 3 月31日)
------------------------	------------------------

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	(単位：百万円)	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	(単位：百万円)
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	672	賞与引当金繰入超過額	689
その他	196	その他	294
小計	869	小計	984
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券評価損	149	投資有価証券評価損	148
退職給付引当金超過額	361	関係会社株式評価損	1,665
固定資産減価償却超過額	174	退職給付引当金超過額	385
その他	75	固定資産減価償却超過額	158
小計	760	その他	34
繰延税金資産小計	1,630	小計	2,391
評価性引当金	61	繰延税金資産小計	3,375
繰延税金資産合計	1,568	評価性引当金	1,665
		繰延税金資産合計	1,710
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)	
その他有価証券評価差額金	199	その他有価証券評価差額金	200
繰延税金負債合計	199	繰延税金負債合計	200
繰延税金資産の純額	1,369	繰延税金資産の純額	1,510
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。		法定実効税率	38.0%
		(調整)	
		評価性引当金の増減	46.6%
		交際費等永久に損金に算入されない項目	3.7%
		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.9%
		税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.9%
		海外子会社の留保利益の影響額等	6.9%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%

第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
-	<p>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</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151号)が平成26年3月31日に公布されたことにより、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となりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度において解消が見込まれる一時差異について、当社が使用した法定実効税率は38.0%から35.6%に変更されております。この結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は65百万円減少し、その他有価証券評価差額金の金額が1百万円、法人税等調整額の金額が63百万円、それぞれ増加しております。</p>

（関連当事者情報）

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	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(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	252,000	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	525 (千SGD 8,000)	関係会社 短期貸付金	606 (千SGD 8,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	5 (千SGD 76)	未収収益	5 (千SGD 76)

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

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

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成24年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	10,930百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	9,826百万円
営業収益	7,917百万円
税引前当期純利益	2,801百万円
当期純利益	2,091百万円

第55期(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) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(千SGD)	事業の内容	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(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	292,000	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	398 (千 SGD 5,059) (注2)	関係会社 短期貸付金	240 (千 SGD 2,940)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	15 (千 SGD 192)	未収収益	5 (千 SGD 64)
							-	増資の引受(注3)	3,266 (千 SGD 40,000)	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠SGD11百万、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 資金の貸付に係る取引金額 398百万円(5,059千 SGD)の内訳は、貸付240百万円(2,940千 SGD)及び返済 638百万円(8,000千 SGD)であります。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った40,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

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

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

三井住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成25年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	15,790百万円
負債合計	1,713百万円
純資産合計	14,076百万円
営業収益	11,350百万円
税引前当期純利益	4,212百万円
当期純利益	3,096百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しておりません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第55期(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しておりません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

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54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(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54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(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負ののれん発生益に関する情報

第54期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

該当事項はありません。

第55期(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。

(1株当たり情報)

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	235円69銭	231円23銭
1株当たり当期純利益金額	14円35銭	2円76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、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

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。

項目	第54期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	2,827	544
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,903	196,903
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 16,978,500株、平成21年度ストックオプション(2) 1,626,900株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,930,100株	平成21年度ストックオプション(1) 15,902,700株、平成21年度ストックオプション(2) 1,567,500株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 5,388,900株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第54期 (平成25年3月31日)	第55期 (平成26年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	46,408	45,531
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	46,408	45,531
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	196,903	196,903

(重要な後発事象)

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】

< 更新後 >

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成26年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	30,000百万円	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。

< 更新後 >

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成26年3月末現在)	事業の内容
あかつき証券株式会社	2,541百万円	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。
池田泉州T T証券株式会社	1,250百万円	
いよぎん証券株式会社	3,000百万円	
エース証券株式会社	8,831百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
S M B C フレンド証券株式会社	27,270百万円	
株式会社S B I証券	47,937百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
ちばぎん証券株式会社	4,374百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東洋証券株式会社	13,494百万円	
内藤証券株式会社	3,002百万円	
西日本シティT T証券株式会社	1,575百万円	
日産センチュリー証券株式会社	1,500百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
浜銀T T証券株式会社	3,307百万円	
ばんせい証券株式会社	1,558百万円	
ひろぎんウツミ屋証券株式会社	6,100百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
明和証券株式会社	511百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社あおぞら銀行	100,000百万円	
株式会社秋田銀行	14,100百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	

株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社沖縄銀行	22,725百万円	
株式会社鹿児島銀行	18,130百万円	
株式会社関西アーバン銀行	47,039百万円	
株式会社北九州銀行	10,000百万円	
株式会社北日本銀行	7,761百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社近畿大阪銀行	38,971百万円	
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社十八銀行	24,404百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社徳島銀行 1	11,036百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社トマト銀行	14,310百万円	
株式会社長野銀行	13,000百万円	
株式会社南都銀行	29,249百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社豊和銀行	12,495百万円	
株式会社北越銀行	24,538百万円	
株式会社北洋銀行 1	121,101百万円	
株式会社北國銀行	26,673百万円	
株式会社宮崎太陽銀行	12,252百万円	
株式会社もみじ銀行	87,465百万円	
株式会社山口銀行	10,005百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	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。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	
三井生命保険株式会社 1	167,280百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社 1	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

全国信用協同組合連合会	53,855百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
-------------	----------------------	-----------------------------------

1 募集の取扱いを行いません。

<更新後>

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額	事業の内容
ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー	581百万米ドル (平成24年12月末現在)	資産運用に関する業務を営んでいます。
MFSインターナショナル(U.K.)リミテッド	1,996千英ポンド (平成25年12月末現在)	
JPMorgan・アセット・マネジメント株式会社	2,218百万円 (平成25年12月末現在)	
ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー	10億米ドル 資本金、利益剰余金、 その他の包括利益(損益) 累計額の合計額 (平成25年12月末現在)	
スパークス・アセット・マネジメント株式会社	2,500百万円 (平成25年12月末現在)	
シュローダー・インベストメント・マネージメント(シンガポール)リミテッド	200万シンガポールドル (平成25年12月末現在)	
日興アセットマネジメント アメリカズ・インク	181百万米ドル 資本金と資本剰余金 の合計額 (平成26年3月末現在)	
日興グローバルラップ株式会社	1,499百万円 (平成25年12月末現在)	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円 (平成26年3月末現在)	

3【資本関係】

<更新後>

(2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(平成26年3月末現在)

<更新後>

(3) 投資顧問会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(平成26年3月末現在)

日興アセットマネジメント株式会社の100%子会社である持株会社が、日興アセットマネジメント アメリカズ・インクの発行済株式総数の100%を保有しております。(平成26年3月末現在)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年8月20日

日興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 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴 田 光 夫
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GW7つの卵の平成26年1月11日から平成26年7月10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、GW7つの卵の平成26年7月10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26年1月11日から平成26年7月10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。

利害関係

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成26年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55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、日興アセットマネジメント株式会社の平成26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、当社が、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。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。