

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年4月12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】	代表取締役社長 柴田 拓美
【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】	森川 晃
【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。

第一部【証券情報】**(1)【ファンドの名称】**

GW7つの卵(以下「ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。(以下「受益権」といいます。)
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社債、株式等の振替に関する法律第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社は、やむを得ない事情などがある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

5兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または「(8)申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

(5)【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または「(8)申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は3.24%(税抜3%)が上限となっております。

(6)【申込単位】

販売会社または「(8)申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

平成28年4月13日から平成29年4月10日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9)【払込期日】

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとしします。
- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額(設定総額)は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

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】

ファンドの目的

主に、世界各国の株式、債券に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。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単体型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単体型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外

目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株 中小型株	年2回	日本		
債券 一般	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()
公債	年6回 (隔月)	欧州		
社債	年12回 (毎月)	アジア		
その他債券 クレジット属性 ()	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資 産複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))		アフリカ		
資産複合 ()		中近東 (中東)		
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。

「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル(含む日本)

目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド

目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジなし

目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

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。

※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。

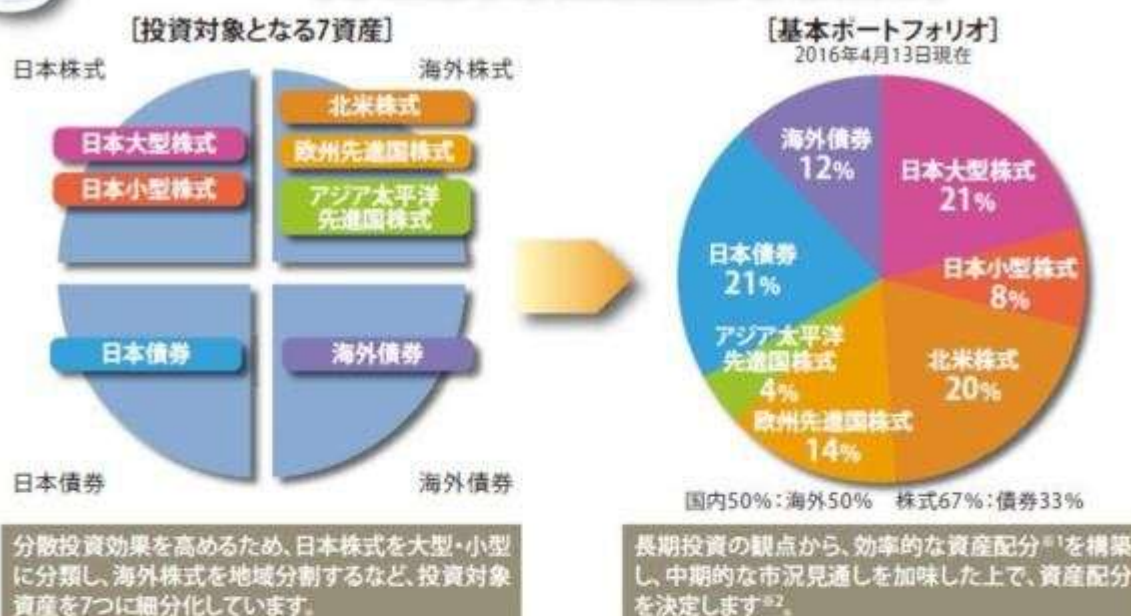


※イメージ図です。

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。



※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思わ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があるのに対し、債券は景気下降期に値上がりする傾向があり、一般に、株式と債券は、景気変動による値動きの傾向が異なります。

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]

(1995年～2015年)

(%)

	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015
日本大型株式	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	10.1	12.2
日本小型株式	-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	14.4	14.5
北米株式	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	28.4	0.1
欧州先進国株式	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	7.6	-2.0
アジア太平洋先進国株式	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	13.7	-8.0
日本債券	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	4.2	1.0
海外債券	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	16.4	-4.5

※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〕



・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。

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 アメリカス：日興アセットマネジメント アメリカス・インク

NAM アメリカスは、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207兆円(2015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9,818億円(2015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22兆円(2015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長い歴史を持つ。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組入れを図る。グループ全体の運用資産総額は約50兆円(2015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個別配分を組合せ、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53兆円(2015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53兆円(2015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

●ウエルントン・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111兆円(2015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な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。



マンズリーレポート
(原則毎月9営業日目作成)



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。

信託金限度額

- ・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成15年2月28日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

平成16年12月28日

- ・「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」における投資顧問会社の変更

平成17年12月9日

- ・「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」、「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」における投資顧問会社の変更など、ならびに「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」における運用指図権限の範囲の変更

平成20年11月18日

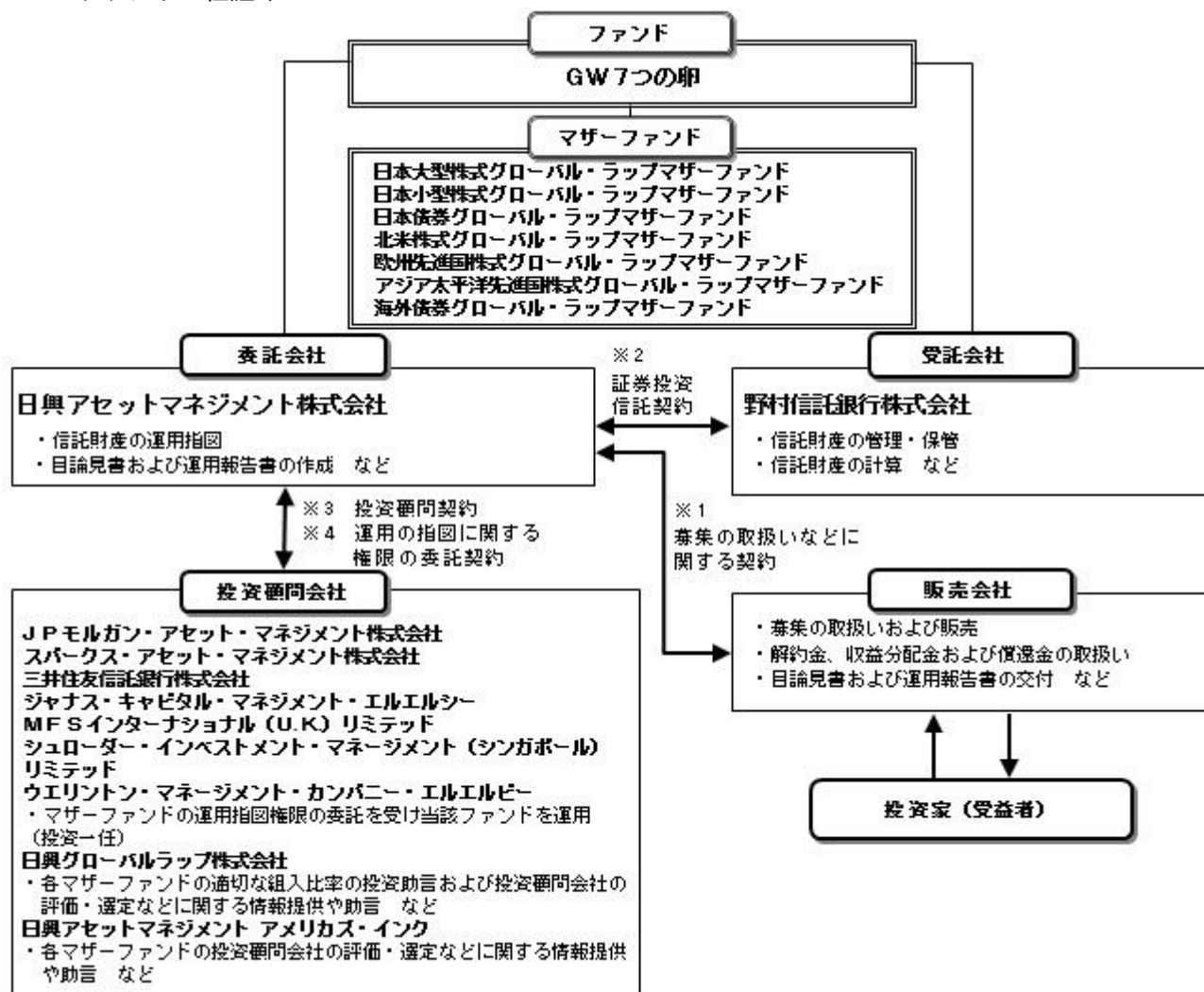
- ・「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」、「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」における投資顧問会社の変更など

平成22年5月18日

- ・「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」における投資顧問会社の変更

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。
- 4 投資顧問会社に運用の指図に関する権限を委託するにあたり、そのルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。委託する業務内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（平成28年1月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円

2) 沿革

昭和34年：日興證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】

(1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に分散投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
- ・各マザーファンドの受益証券への投資比率は、下記の資産配分を基本とし、中期的な市況見通しに応じて機動的に変更します。なお、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。

証券投資信託 「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」21%

証券投資信託 「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」 8%

証券投資信託 「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」21%

証券投資信託 「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」20%

証券投資信託 「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」14%

証券投資信託 「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」... 4%

証券投資信託 「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」12%

- ・上記の基本資産配分は、長期的な市況見通しに応じて変更される場合があります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

< GW 7つの卵 >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託 「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」

証券投資信託 「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」

証券投資信託 「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」

証券投資信託 「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」

証券投資信託 「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」

証券投資信託 「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」

証券投資信託 「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限り。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

1) 証券投資信託 日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

2) 証券投資信託 日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

- 3) 証券投資信託 日本債券グローバル・ラップマザーファンド
- 4) 証券投資信託 北米株式グローバル・ラップマザーファンド
- 5) 証券投資信託 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド
- 6) 証券投資信託 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
- 7) 証券投資信託 海外債券グローバル・ラップマザーファンド
- 8) 株券または新株引受権証券
- 9) 国債証券
- 10) 地方債証券
- 11) 特別の法律により法人の発行する債券
- 12) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 13) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 14) コマーシャル・ペーパー
- 15) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、8)～15)の証券または証書の性質を有するもの
- 17) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
- 18) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で19)に定めるもの以外のもの
- 19) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 20) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 21) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 22) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 23) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
- 24) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 25) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 26) 外国の者に対する権利で25)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入

<日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

<日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

<日本債券グローバル・ラップマザーファンド>

わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。

<北米株式グローバル・ラップマザーファンド>

米国およびカナダの金融商品取引所上場株式およびNASDAQ市場で取引されている株式を主要投資対象とします。

<欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド>

欧州主要先進国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。

<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>

アジア・環太平洋主要先進国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。

<海外債券グローバル・ラップマザーファンド>

海外の公社債を主要投資対象とします。

「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」、「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」および「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」の投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第18条、第19条および第20条に定めるものに限ります。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」および「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」の投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限ります。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」および「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」は、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

1) 株券または新株引受権証券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7) コマーシャル・ペーパー

8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの

10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券

11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、

有価証券に係るものに限ります。）

- 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 外国の者に対する権利で16)の有価証券の性質を有するもの
「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」は、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
 - 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
「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」および「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」は、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
 - 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または

外国投資証券で投資法人債券に類する証券

- 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」は、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
 - 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)～8)の証券または証書の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 11) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 12) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 13) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 14) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 15) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 外国の者に対する権利で16)の有価証券の性質を有するもの
各マザーファンドは、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの（「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」を除きます。）各マザーファンドは、次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引

- 5) 為替先渡取引（「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」は行ないません。）
 6) 有価証券の貸付
 7) 公社債の空売
 8) 公社債の借入
 9) 外国為替予約取引（「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」は行ないません。）

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、わが国の大型株式の動き（日興株式スタイルインデックス（日本大型株式） [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> わが国の金融商品取引所上場株式の中から、時価総額の大きな銘柄を中心に厳選投資を行ないます。 ポートフォリオ構築にあたっては、企業のファンダメンタルズ分析、バリュエーション分析などにより、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選し、流動性、銘柄分散も考慮して、リスクの低減につとめます。 株式の組入比率は原則として高位を維持します。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社（投資一任）
信託期間	無期限（平成13年9月14日設定）
決算日	毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日）

^{*}日興株式スタイルインデックス（日本大型株式）は、わが国の金融商品取引所上場株式の中で、全時価総額の上位85%に属する株式の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各株式の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算します。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はS M B C日興証券株式会社に帰属します。また、S M B C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。

<日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、わが国の小型株式の動き（日興株式スタイルインデックス（日本小型株式） [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> わが国の金融商品取引所上場株式の中から、時価総額の小さな銘柄を中心に厳選投資を行ないます。 ポートフォリオ構築にあたっては、企業のファンダメンタルズ分析、バリュエーション分析などにより、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選し、流動性、銘柄分散も考慮して、リスクの低減につとめます。 株式の組入比率は原則として高位を維持します。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	スパークス・アセット・マネジメント株式会社（投資一任）
信託期間	無期限（平成13年9月14日設定）
決算日	毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日）

^{*}日興株式スタイルインデックス（日本小型株式）は、わが国の金融商品取引所上場株式の中で、全時価総額の下位15%に属する株式の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各株式の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算します。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はS M B C日興証券株式会社に帰属します。また、S M B C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。

<日本債券グローバル・ラップマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、わが国の公社債市場全体の動き（日興債券パフォーマンスインデックス（総合） [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・わが国の公社債を中心に投資を行ない、安定したインカム（利子等収益）の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。 ・国債、政府保証債、金融債などで核となるポートフォリオを構築し、社債への投資にあたっては、企業の信用度調査を充分に行ない、流動性、銘柄分散も考慮したうえで、ポートフォリオ全体のリスクの低減につとめます。 ・公社債の組入比率は原則として高位を維持します。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	三井住友信託銀行株式会社（投資一任）
信託期間	無期限（平成13年9月14日設定）
決算日	毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日）

^{*}日興債券パフォーマンスインデックス（総合）は、日興リサーチセンター株式会社が発表している、日本の債券市場の動きを表す指数です。国債、地方債、政府保証債、財投機関債、金融債、事業債などの円建て公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存年数1年以上、残存額面10億円以上で、格付会社からBBB格相当以上の格付を取得している発行体に限られます。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は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。

<北米株式グローバル・ラップマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、米国およびカナダの株式市場全体の動き（MSCI北米インデックス（ヘッジなし・円ベース） [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	米国およびカナダの金融商品取引所上場株式およびNASDAQ市場で取引されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・米国およびカナダの金融商品取引所上場株式およびNASDAQ市場で取引されている株式を中心に厳選投資を行ないます。 ・投資対象銘柄については、企業訪問などにより調査、分析を充分に行ない、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選します。 ・株式の組入比率は原則として高位を維持します。 ・外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ・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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	ジャンナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー（投資一任）
信託期間	無期限（平成13年9月14日設定）
決算日	毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日）

^{*} MSCI北米インデックスは、MSCI Inc. が発表している、アメリカとカナダの株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、両国市場の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。（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。

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

< 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、欧州先進国の株式市場全体の動き（MSCI 欧州インデックス（ヘッジなし・円ベース） [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	欧州主要先進国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ 欧州主要先進国（MSCI 欧州インデックス採用国）の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式を中心に厳選投資を行ないます。 ・ 投資対象銘柄については、企業訪問などにより調査、分析を充分に行ない、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選します。 ・ また、投資対象国間の資産配分を図ることによりリスクの低減につとめます。 ・ 株式の組入比率は原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ・ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ・ 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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	MFS インターナショナル（U.K.）リミテッド（投資一任）
信託期間	無期限（平成13年9月14日設定）
決算日	毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日）

^{*} MSCI 欧州インデックスは、MSCI Inc. が発表している、イギリス、フランス、ドイツなど、欧州主要先進国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各国市場の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。（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。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<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>

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、アジアおよび環太平洋の主要先進国の株式市場全体の動き（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） [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行いません。
主な投資対象	アジア・環太平洋主要先進国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 日本を除くアジアおよび環太平洋地域の主要先進国（MSCI太平洋フリー・インデックス（日本を除く）採用国・地域）の株式を中心に厳選投資を行いません。 投資対象銘柄については、企業訪問などにより調査、分析を充分に行ない、中長期的に成長が期待できる銘柄を厳選します。 また、投資対象国間の資産配分を図ることによりリスクの低減につとめます。 株式の組入比率は原則として高位を維持します。 外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	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（投資一任）
信託期間	無期限（平成13年9月14日設定）

決算日	毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日）
-----	----------------------

* M S C I 太平洋フリー・インデックス（日本を除く）は、MSCI Inc. が発表している、オーストラリア、香港など、日本を除くアジアおよび環太平洋地域の主要先進国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、各国市場の配当込みリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。（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。

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

< D R（預託証券） >

ある国で発行されている株式をその国以外の海外市場で流通させる目的で、原株式を銀行などに預託し海外で発行する代替証券をいいます。海外投資家も国内投資家とほぼ同様の権利を享受でき、取引形態についても株式と変わりません。

< カントリーファンド >

特定の国、地域の有価証券に投資することを目的としたクローズド・エンド型の会社型投資信託をいいます。会社型投資信託とは、証券投資を目的とする会社を設立し、投資家はその発行株式に投資する形態をいいます。

< 海外債券グローバル・ラップマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	中長期的な観点から、世界の主要国の債券市場の動き（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） [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 世界各国の信用度の高い公社債を中心に投資を行ない、安定したインカム（利子等収益）の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。 ポートフォリオの構築にあたっては、信用度の調査、各国の金利動向の見通しに基づき、安定したリターンの提供とリスクコントロールにつとめます。 外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、為替ヘッジを行なうことがあります。為替ヘッジ比率は、マクロ環境、金利動向、ヘッジコストなどを勘案して決定します。また、ヘッジコストなどを勘案して、当該外貨建資産と異なる通貨により為替ヘッジを行なうこともあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 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。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー（投資一任）
信託期間	無期限（平成13年9月14日設定）
決算日	毎年3月25日（休業日の場合は翌営業日）

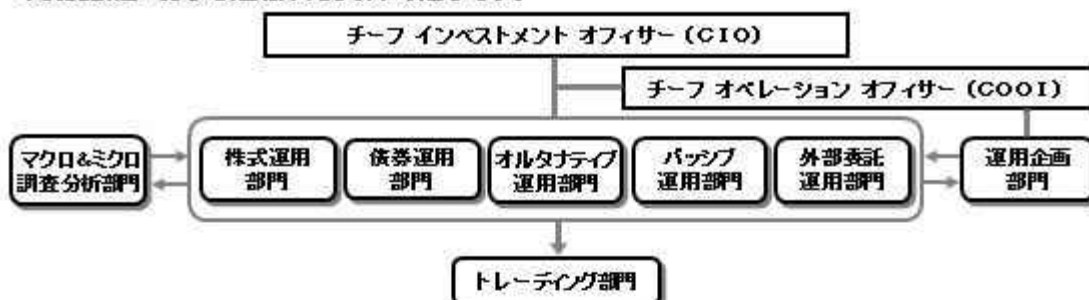
*シティ世界国債インデックス（除く日本）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、日本を除く世界の主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。当インデックスのリターンは、残存年数1年以上の固定利付債のトータルリターンを時価総額比に基づいて加重平均して計算されます。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

同指数に関する著作権、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。

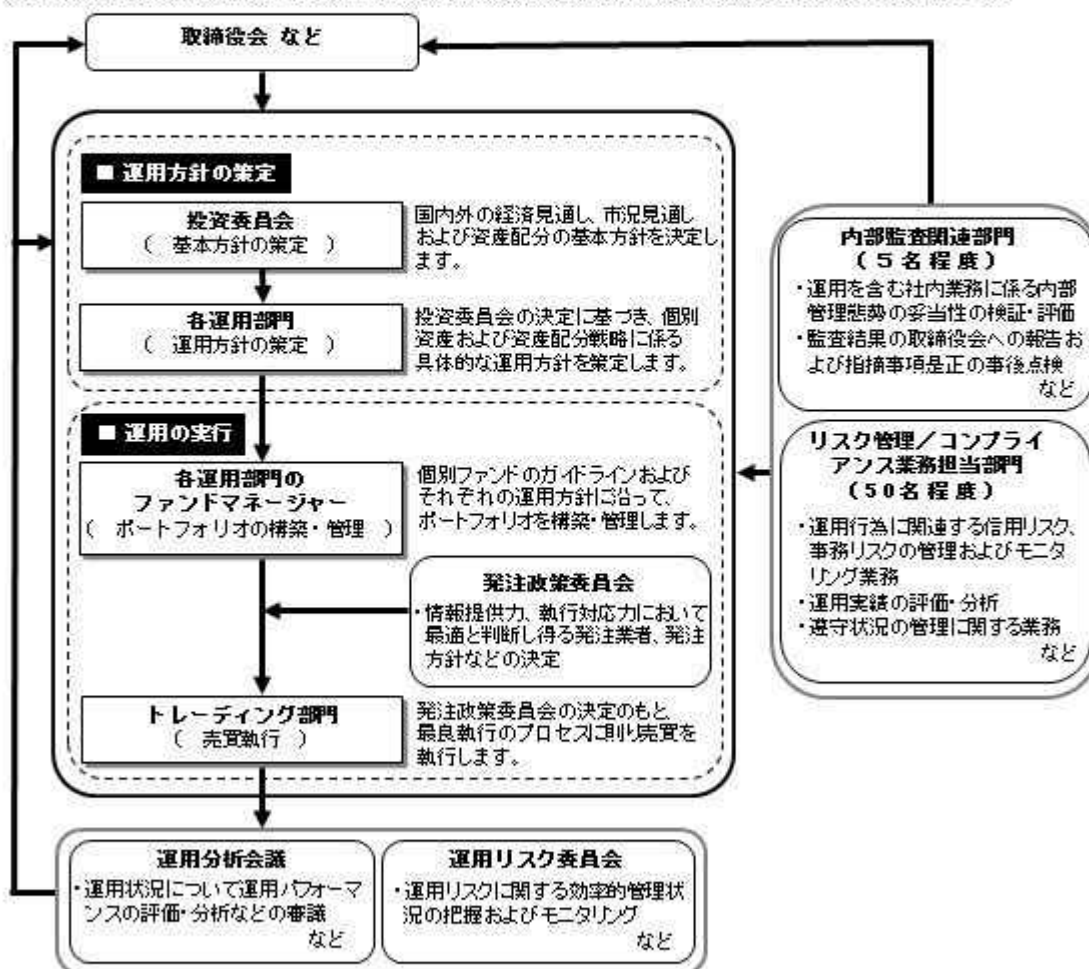
（3）【運用体制】

<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っています。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かのモニタリングを行っております。

上記体制は平成28年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

各マザーファンドの運用アドバイザー（投資顧問会社）は以下の通りです。なお、運用アドバイザーについては、将来、変更する場合があります。

以下の内容は、各社提供の情報に基づいて作成しています。

「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、「JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社」に委託します。

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社は、世界有数の金融サービス会社であるJPモルガン・チェース・アンド・カンパニー傘下の日本拠点のひとつであり、「JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー」の資産運用部門である「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループに属しています。同グループの運用総資産は約207兆円にのぼります（2015年12月末）。

同社のJPモルガン（JPM）日本株運用の運用哲学は、アナリストが市場では手薄になりがちな長期的

な業績予想を行なうことによって当該企業株価の均衡価値を解明し、その均衡価値と市場価格のカイ離を捉えるというものです。また、配当割引モデル(DDM)を活用することにより客観的に銘柄の割安度を判定し、市場タイミングや業種配分の偏りといった銘柄選択以外のリスクは原則として排除するなど、徹底したリスクコントロールのもと、安定的な超過収益の積上げをめざします。

「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、スパークス・アセット・マネジメント株式会社に委託します。

スパークス・アセット・マネジメントは、1989年に発足した日本で数少ない独立系の投資顧問会社です。同社は創業以来「マクロはミクロの集積」という投資哲学の下、「徹底した企業調査をベースにした投資」を一貫して行なっています。特に、経済構造が変革する中で成長する新興企業群や、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群に注目しています。2015年12月末現在の同社を含むグループ全体の運用資産額は約9,818億円です。

徹底した企業訪問・財務分析から得た調査結果を同社独自の社内データベースに蓄積し活用しています。この中から合議の上で有望銘柄がリストアップされ、ポートフォリオの構築が行なわれます。また、運用はチームによる組織立った運用体制が敷かれています。

「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、三井住友信託銀行株式会社に委託します。

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しています。

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します。三井住友信託銀行における運用資産総額は約53.3兆円(2015年12月末現在)にのびります。

「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、ジャンス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーに委託します。

ジャンス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー(ジャンス)は、米国コロラド州デンバーを本拠地とし、ニューヨーク証券取引所に上場している米国有数の資産運用グループ「ジャンス・キャピタル・グループ(JCG)」の一員です。創設以来、一貫して資産運用に専念。揺るぎない投資哲学と豊富な専門知識、グローバルに広がるネットワークを基盤に、個人投資家から機関投資家に至るまで、世界中のお客様を対象とする様々な資産運用戦略の提供に取り組み、確かな実績を築いています。2015年12月現在、JCGの運用資産総額は約22.7兆円に上ります。

ジャンスの株式運用は、綿密なファンダメンタルズ分析に基づく銘柄選択に重点を置いています。企業利益の中長期的成長性や競争優位性の高い銘柄を見極め、より多くの情報とアナリストが推奨する最良の投資アイデアの中から、ボトムアップアプローチによる銘柄選択によって超過収益の獲得を目指します。

「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、MFSインターナショナル(U.K.)リミテッドに委託します。

MFSインターナショナル(U.K.)リミテッドは、米国に本拠を置くマサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニー(MFS)グループの英国法人です。MFSは1924年米国初のミューチュアル・ファンドの設定と共に創業した米国最古の資産運用会社で、発祥の地であるボストンの他、ロンドン・シンガポール・東京・シドニー・メキシコシティ・トロント、香港、サンパウロにリサーチ拠点を置くグローバルな運用会社として、世界中の投資家から約50兆円の運用資産を受託しています(2015年12月末現在)。

同社は、「企業の利益・キャッシュフローの持続的な成長こそが中長期的な株価上昇に繋がる」との信念のもと、独自のリサーチ活動を通じて、産業や個別企業について徹底したファンダメンタルズ分析を行なっています。業界平均以上の、かつ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ポートフォリオに組み入れるよう努めています。

「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」の運用は、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)リミテッドに委託します。

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)リミテッドは、シュローダー・グループの中でロンドン、ニューヨークと並んで国際運用拠点の一つと位置付けられています。シュローダー・グループは、1804年に英国に創業した国際金融グループで、ロンドンに本拠地を置きグローバルにオフィスを展開しています。なお、運用資産総額は約53.5兆円にのびります(2015年9月末現在)。

同社は、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み合わせ、リスクのコントロールに配慮しながら、ポートフォリオを構築します。

「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーに委託します。

ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー(ウエリントン)は、マサチューセッツ州ボストンに本拠を構えるアメリカの独立系投資運用会社です。その起源は1928年に遡るアメリカでも歴史のある運用会社の一つです。自社ブランドでの投信販売は行わずに、純粋に資産運用業務のみに専念しています。ウエリントン・マネージメント・グループ全体での運用資産額は約111.5兆円におよび、アメリカでも大手の一角を担っています(2015年12月末現在)。

ウエリントンでは、「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、超過収益の獲得を目指しています。マクロ、定量、スプレッドの各チームが、独立した投資アイデアを創出するとともに、個別取引・戦略レベルとポートフォリオ・レベルでアクティブにリスクを管理しています。

各マザーファンドの適切な組入比率および運用アドバイザーの評価・選定などについて、日興グローバルラップ株式会社(日興GW)より情報提供や助言を受けます。

日興GWでは、多角的な視点から資産配分を策定します。月例で投資政策に関する委員会を開催し、投資環境と中長期的な市況見通しを確認しています。

各マザーファンドの運用アドバイザーの評価・選定などについて、日興アセットマネジメント アメリカズ・インクより情報提供や助言を受けます。

日興アセットマネジメント アメリカズ・インクは、運用会社に関する情報収集と評価分析をグローバルベースで実施可能な調査体制を有しており、運用会社調査に関しての豊かな経験と実績があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価益を含みます。)などの全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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。

3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

<分配金受取りコース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5)【投資制限】

約款に定める投資制限

<GW7つの卵>

1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には、制限を設けません。

2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。

3) 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の

5%以下とします。

- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始

日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ)再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が弁済される日からその翌営業日までとします。

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)株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。

2)投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができます。

3)外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

4)信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

5)わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

6)わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

7)わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

8)信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

9)信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

10)信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ)株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ)公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

11)信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

12)信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13)信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 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) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社

債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。

- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 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) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。

- 3) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 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。

法令による投資制限
同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）
同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属

します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

- ・当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に中小型株式や新興企業の株式は、株式市場全体の平均に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

- ・市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・一般に中小型株式や新興企業の株式は、株式市場全体の平均に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高いと考えられます。

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れや廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

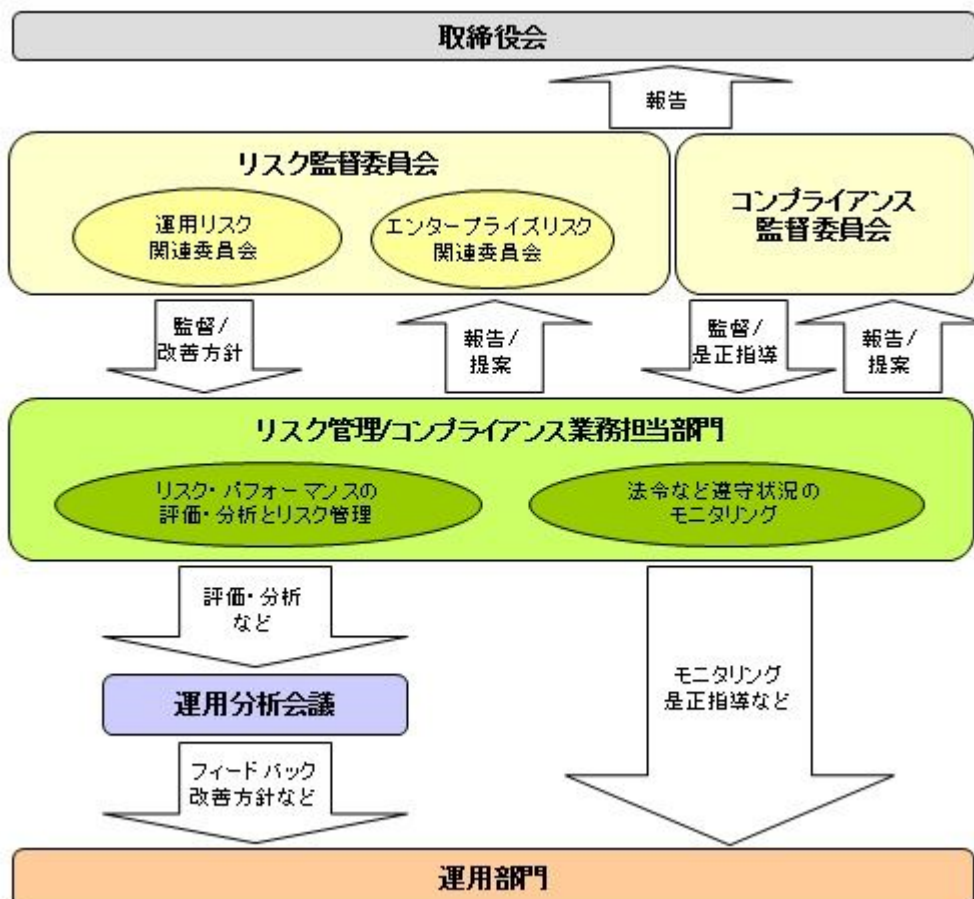
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資

する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社もしくは運用委託またはこれらの関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社もしくは運用委託またはこれらの関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（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/コンプライアンス業務担当部門を設置し、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についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、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。両委員会およびそれに関連する部門別委員会においては、法令遵守状況や各種リスク（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、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスクの管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用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、運用リスクの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の策定が図られます。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。

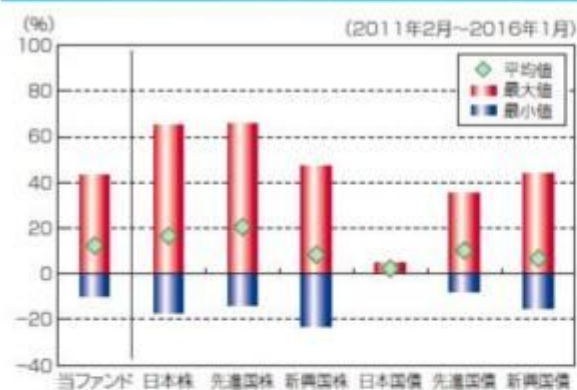
法令など遵守状況のモニタリング

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、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28年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	12.3%	16.6%	20.5%	8.4%	2.3%	10.3%	6.7%
最大値	42.9%	65.0%	65.7%	47.4%	4.5%	34.9%	43.7%
最小値	-9.5%	-17.0%	-13.6%	-22.8%	0.4%	-7.5%	-15.0%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2011年2月から2016年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、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り、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

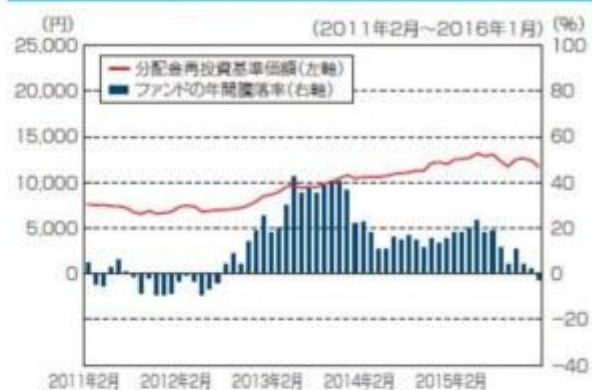
日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※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。

※分配金再投資基準価額は、2011年2月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、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り、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

日本国債……NOMURA-ボンドパフォーマンス・インデックス国債

先進国債……シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

当指数は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。

NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス国債

当指数は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLC に帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLC に帰属します。

4【手数料等及び税金】**（1）【申込手数料】**

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は3.24%（税抜3%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

（3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.944%（税抜1.8%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

販売会社毎の 純資産総額	信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
30億円以下の部分		1.15%	0.60%	

30億円超の部分	1.80%	1.05%	0.70%	0.05%
----------	-------	-------	-------	-------

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

- ・ 組入る有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・ 信託事務の処理に要する諸費用
- ・ 信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

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せん。)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、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限りません。)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)、普通分配金および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限りません。)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、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が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。また、未成年者口座内の少額上場株式等に係る配当所得及び譲渡所得等の非課税措置(ジュニアNISA)をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

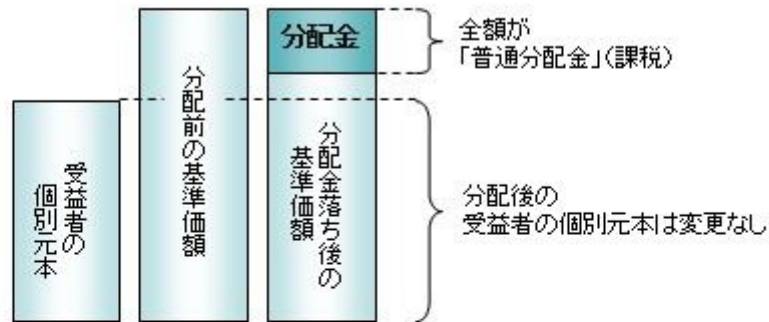
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

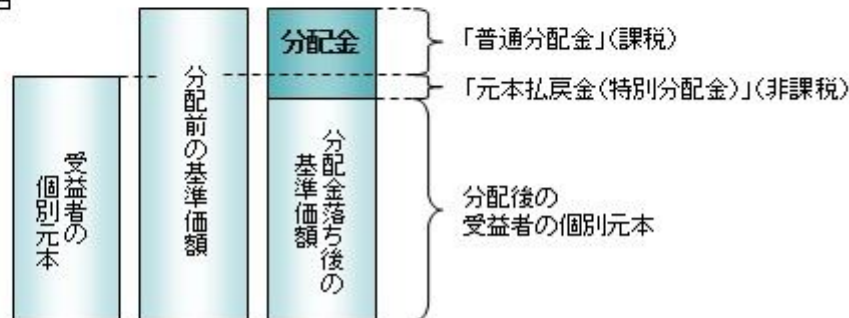
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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28年 4月12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2016年 1月29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	69,933,360,910	99.04
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		679,129,530	0.96
合計(純資産総額)		70,612,490,440	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	日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド	8,060,548,622	1.7822	14,365,509,755	1.8149	14,629,089,694	20.72

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	7,183,073,293	2.0284	14,570,437,420	2.0269	14,559,371,257	20.62
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	10,166,027,732	1.3214	13,433,389,046	1.3338	13,559,447,788	19.20
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	3,739,217,637	2.7520	10,290,326,938	2.7938	10,446,626,234	14.79
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	3,034,533,488	2.4691	7,492,566,636	2.5669	7,789,344,010	11.03
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	1,424,968,865	3.9734	5,661,971,289	4.0894	5,827,267,676	8.25
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	635,759,367	4.7777	3,037,512,909	4.9110	3,122,214,251	4.42

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.04
合 計	99.04

【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
第12計算期間末 (2015年 1月13日)	85,521	91,107	1.0718	1.1418
第13計算期間末 (2016年 1月12日)	68,917	70,957	1.0132	1.0432
2015年 1月末日	88,243		1.0841	
2月末日	90,297		1.1298	
3月末日	88,294		1.1349	
4月末日	87,405		1.1499	

5月末日	88,604		1.1918
6月末日	84,311		1.1613
7月末日	84,315		1.1821
8月末日	78,006		1.1143
9月末日	74,006		1.0613
10月末日	78,424		1.1313
11月末日	78,166		1.1417
12月末日	76,458		1.1245
2016年 1月末日	70,612		1.0281

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第12期	2014年 1月11日～2015年 1月13日	0.0700
第13期	2015年 1月14日～2016年 1月12日	0.0300

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第12期	2014年 1月11日～2015年 1月13日	10.08
第13期	2015年 1月14日～2016年 1月12日	2.67

(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
第12期	2014年 1月11日～2015年 1月13日	3,998,358,835	27,550,578,403
第13期	2015年 1月14日～2016年 1月12日	4,685,780,147	16,458,000,036

（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2016年 1月29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	32,425,093,520	98.93
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		350,238,869	1.07
合計（純資産総額）		32,775,332,389	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	350,600	8,537.11	2,993,110,766	7,200.00	2,524,320,000	7.70
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,173,500	784.54	1,705,197,690	609.40	1,324,530,900	4.04
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	236,800	3,948.84	935,085,312	5,028.00	1,190,630,400	3.63
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	180,300	3,956.12	713,288,436	4,661.00	840,378,300	2.56
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	675,300	1,217.06	821,880,618	1,180.00	796,854,000	2.43

日本	株式	キーエンス	電気機器	13,600	66,783.38	908,253,968	55,920.00	760,512,000	2.32
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	169,100	3,795.47	641,813,977	4,015.00	678,936,500	2.07
日本	株式	電通	サービス業	100,700	5,473.60	551,191,520	6,310.00	635,417,000	1.94
日本	株式	日本電産	電気機器	77,700	8,531.48	662,895,996	8,102.00	629,525,400	1.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,047,000	818.15	856,603,050	586.40	613,960,800	1.87
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	55,700	10,774.99	600,166,943	10,990.00	612,143,000	1.87
日本	株式	ダイキン工業	機械	73,100	8,010.04	585,533,924	8,010.00	585,531,000	1.79
日本	株式	ソニー	電気機器	231,300	3,303.75	764,157,375	2,523.00	583,569,900	1.78
日本	株式	マツダ	輸送用機器	268,600	2,403.42	645,558,612	2,148.50	577,087,100	1.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	295,200	2,444.64	721,657,728	1,905.50	562,503,600	1.72
日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	210,200	2,456.10	516,272,671	2,617.50	550,198,500	1.68
日本	株式	協和発酵キリン	医薬品	314,000	1,665.68	523,023,520	1,726.00	541,964,000	1.65
日本	株式	KDDI	情報・通信業	176,200	2,753.98	485,251,276	3,008.00	530,009,600	1.62
日本	株式	味の素	食料品	177,000	2,714.35	480,439,950	2,836.50	502,060,500	1.53
日本	株式	オリックス	その他金融業	296,700	1,753.05	520,129,935	1,686.50	500,384,550	1.53
日本	株式	日本航空	空運業	110,200	3,964.46	436,883,492	4,476.00	493,255,200	1.50
日本	株式	サントリー食品インターナショナル	食料品	87,900	5,130.20	450,944,580	5,520.00	485,208,000	1.48
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	141,100	2,453.58	346,200,138	3,360.00	474,096,000	1.45
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	89,600	6,976.64	625,106,944	5,265.00	471,744,000	1.44
日本	株式	電源開発	電気・ガス業	112,400	3,936.41	442,452,484	4,030.00	452,972,000	1.38
日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	278,700	2,282.80	636,216,360	1,618.00	450,936,600	1.38
日本	株式	住友不動産	不動産業	128,000	4,587.67	587,221,760	3,338.00	427,264,000	1.30
日本	株式	丸井グループ	小売業	224,800	1,576.52	354,401,696	1,892.00	425,321,600	1.30
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	647,900	740.53	479,789,387	650.00	421,135,000	1.28
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	102,700	4,848.92	497,984,084	3,980.00	408,746,000	1.25

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	3.17
		食料品	7.57
		化学	3.85
		医薬品	4.50
		石油・石炭製品	0.24
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	1.56
		非鉄金属	1.34
		金属製品	0.24
		機械	4.00
		電気機器	10.68
		輸送用機器	14.37

	精密機器	1.68
	その他製品	1.25
	電気・ガス業	2.24
	陸運業	3.55
	海運業	0.60
	空運業	1.50
	情報・通信業	7.60
	卸売業	3.91
	小売業	5.20
	銀行業	8.06
	証券、商品先物取引業	1.28
	保険業	1.55
	その他金融業	1.53
	不動産業	2.63
	サービス業	4.05
合 計		98.93

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2016年 1月29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	12,552,806,200	95.91
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		535,510,404	4.09
合計（純資産総額）		13,088,316,604	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	電通国際情報サービス	情報・通信業	128,900	1,204.09	155,207,201	2,394.00	308,586,600	2.36
日本	株式	岡村製作所	その他製品	244,600	934.00	228,456,400	1,086.00	265,635,600	2.03
日本	株式	日本ユニシス	情報・通信業	194,400	1,198.00	232,891,200	1,271.00	247,082,400	1.89
日本	株式	アイチ コーポレーション	機械	305,300	619.00	188,980,700	797.00	243,324,100	1.86
日本	株式	キッツ	機械	452,600	597.16	270,274,616	535.00	242,141,000	1.85
日本	株式	エレコム	電気機器	163,600	1,268.00	207,444,800	1,468.00	240,164,800	1.83
日本	株式	セントラル硝子	化学	372,000	552.63	205,579,887	642.00	238,824,000	1.82
日本	株式	アニコム ホールディングス	保険業	79,300	1,905.00	151,066,500	2,995.00	237,503,500	1.81
日本	株式	萩原工業	その他製品	105,400	2,079.00	219,126,600	2,234.00	235,463,600	1.80
日本	株式	オプテックス	電気機器	77,700	2,517.00	195,570,900	2,998.00	232,944,600	1.78
日本	株式	アネスト岩田	機械	242,600	790.40	191,753,331	941.00	228,286,600	1.74
日本	株式	リロ・ホールディング	サービス業	16,000	10,530.00	168,480,000	14,260.00	228,160,000	1.74
日本	株式	TOWA	機械	324,800	741.15	240,727,469	682.00	221,513,600	1.69
日本	株式	阪和興業	卸売業	443,000	510.00	225,930,000	499.00	221,057,000	1.69
日本	株式	エディオン	小売業	243,500	884.85	215,462,559	898.00	218,663,000	1.67
日本	株式	マクニカ・富士エレホールディングス	卸売業	147,100	1,512.00	222,415,200	1,471.00	216,384,100	1.65
日本	株式	ダイヘン	電気機器	335,000	594.78	199,253,504	627.00	210,045,000	1.60
日本	株式	トーカロ	金属製品	90,600	2,329.00	211,007,400	2,278.00	206,386,800	1.58
日本	株式	トラスコ中山	卸売業	47,100	3,695.00	174,034,500	4,250.00	200,175,000	1.53
日本	株式	エス・エム・エス	サービス業	83,000	1,543.00	128,069,000	2,333.00	193,639,000	1.48
日本	株式	T P R	機械	61,200	3,270.00	200,124,000	3,160.00	193,392,000	1.48
日本	株式	セーレン	繊維製品	151,600	1,088.00	164,940,800	1,239.00	187,832,400	1.44
日本	株式	東リ	化学	596,000	282.00	168,072,000	315.00	187,740,000	1.43
日本	株式	東洋紡	繊維製品	1,164,000	177.11	206,167,286	157.00	182,748,000	1.40
日本	株式	ニチユ三菱フォークリフト	輸送用機器	382,200	650.89	248,773,697	476.00	181,927,200	1.39
日本	株式	ナカノフード建設	建設業	273,500	414.00	113,229,000	662.00	181,057,000	1.38
日本	株式	ヒト・コミュニケーションズ	情報・通信業	100,800	893.99	90,114,533	1,772.00	178,617,600	1.36
日本	株式	オープンハウス	不動産業	79,600	1,452.00	115,579,200	2,232.00	177,667,200	1.36
日本	株式	T O A	電気機器	145,000	1,215.00	176,175,000	1,203.00	174,435,000	1.33
日本	株式	イチネンホールディングス	サービス業	165,100	1,142.00	188,544,200	1,056.00	174,345,600	1.33

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	3.23
		食料品	2.00
		繊維製品	3.65
		化学	5.03
		ゴム製品	1.27
		ガラス・土石製品	1.15

	鉄鋼	0.97
	金属製品	2.29
	機械	12.56
	電気機器	14.26
	輸送用機器	2.91
	精密機器	1.53
	その他製品	5.23
	電気・ガス業	0.46
	陸運業	0.65
	情報・通信業	8.73
	卸売業	10.38
	小売業	4.09
	銀行業	1.65
	保険業	2.57
	その他金融業	0.75
	不動産業	1.98
	サービス業	8.56
合 計		95.91

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2016年 1月29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	15,120,295,000	51.28
地方債証券	日本	529,869,000	1.80
特殊債券	日本	1,007,354,613	3.42
社債券	日本	10,933,093,450	37.08
	アメリカ	200,446,479	0.68
	ドイツ	100,087,000	0.34
	フランス	200,683,000	0.68
	オランダ	200,211,503	0.68

	イギリス	100,699,000	0.34
	スウェーデン	200,234,320	0.68
	韓国	500,760,734	1.70
	小計	12,436,215,486	42.18
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		390,189,007	1.32
合計(純資産総額)		29,483,923,106	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341回利付国債(10年)	3,100,000,000	100.38	3,112,043,000	102.00	3,162,186,000	0.300	2025/12/20	10.73
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	1,600,000,000	100.42	1,606,822,000	100.83	1,613,312,000	0.100	2020/12/20	5.47
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,500,000,000	101.24	1,518,610,000	103.05	1,545,870,000	0.400	2025/9/20	5.24
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,200,000,000	103.38	1,240,666,000	107.14	1,285,788,000	1.200	2035/9/20	4.36
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	500,000,000	110.95	554,780,000	117.97	589,855,000	1.700	2032/9/20	2.00
日本	国債証券	第30回利付国債(30年)	400,000,000	123.00	492,012,000	128.14	512,588,000	2.300	2039/3/20	1.74
日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	400,000,000	119.12	476,493,000	126.89	507,596,000	2.200	2041/3/20	1.72
日本	特殊債券	第109回福岡北九州高速道路債券	500,000,000	101.24	506,229,613	101.24	506,229,613	2.090	2016/9/20	1.72
日本	国債証券	第121回利付国債(20年)	400,000,000	115.01	460,076,000	121.15	484,600,000	1.900	2030/9/20	1.64
日本	国債証券	第133回利付国債(20年)	400,000,000	114.33	457,320,000	119.82	479,316,000	1.800	2031/12/20	1.63
日本	国債証券	第130回利付国債(20年)	400,000,000	115.63	462,528,000	119.80	479,204,000	1.800	2031/9/20	1.63
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	400,000,000	112.44	449,768,000	117.68	470,724,000	1.700	2033/6/20	1.60
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	106.51	426,040,000	106.02	424,088,000	1.606	2020/9/28	1.44
日本	国債証券	第8回利付国債(40年)	400,000,000	95.23	380,920,000	105.60	422,424,000	1.400	2055/3/20	1.43
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	400,000,000	103.73	414,920,000	104.87	419,500,000	0.600	2024/3/20	1.42
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	101.21	404,844,000	101.02	404,092,000	0.850	2017/8/9	1.37
日本	国債証券	第127回利付国債(20年)	300,000,000	117.21	351,630,000	121.22	363,663,000	1.900	2031/3/20	1.23
日本	国債証券	第47回利付国債(30年)	300,000,000	105.52	316,560,000	112.98	338,946,000	1.600	2045/6/20	1.15
日本	国債証券	第48回利付国債(30年)	300,000,000	100.80	302,404,000	107.78	323,361,000	1.400	2045/9/20	1.10

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	100.52	301,560,000	100.53	301,617,000	0.386	2017/9/20	1.02
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	100.03	300,100,520	100.03	300,100,520	0.605	2016/2/26	1.02
日本	特殊債券	第21回道路債券	200,000,000	127.28	254,560,000	130.70	261,400,000	2.750	2033/6/20	0.89
日本	国債証券	第26回利付国債(30年)	200,000,000	124.10	248,200,000	129.14	258,296,000	2.400	2037/3/20	0.88
日本	国債証券	第31回利付国債(30年)	200,000,000	118.40	236,812,000	126.31	252,632,000	2.200	2039/9/20	0.86
日本	国債証券	第146回利付国債(20年)	200,000,000	112.93	225,870,000	117.53	235,074,000	1.700	2033/9/20	0.80
日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	200,000,000	106.17	212,347,000	111.72	223,440,000	1.400	2034/9/20	0.76
日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	200,000,000	106.88	213,760,000	109.21	218,426,000	1.300	2035/6/20	0.74
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	200,000,000	105.94	211,890,000	107.97	215,954,000	1.200	2034/12/20	0.73
日本	社債券	第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	108.14	216,282,000	107.37	214,756,000	2.084	2020/3/4	0.73
日本	社債券	第37回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	107.07	214,144,000	106.60	213,206,000	1.390	2022/5/31	0.72

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	51.28
地方債証券	1.80
特殊債券	3.42
社債券	42.18
合計	98.68

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2016年1月29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	27,661,621,794	85.78

	カナダ	1,310,178,380	4.06
	オランダ	227,221,241	0.70
	アイルランド	460,941,220	1.43
	イギリス	109,150,331	0.34
	スイス	272,008,531	0.84
	バミューダ	203,504,755	0.63
	シンガポール	234,888,830	0.73
	ジャージー	206,986,715	0.64
	小計	30,686,501,797	95.16
投資証券	アメリカ	773,917,111	2.40
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		788,239,870	2.44
合計（純資産総額）		32,248,658,778	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		7,253,186	0.02
	売建		158,124	0.00

(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	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	13,140	69,476.07	912,915,639	88,351.13	1,160,933,917	3.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	76,926	9,498.02	730,645,353	10,385.15	798,888,080	2.48
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	57,036	15,141.38	863,604,029	11,372.65	648,650,939	2.01
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	46,859	10,421.41	488,336,917	13,188.12	617,982,382	1.92
アメリカ	株式	AMGEN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	29,881	19,815.42	592,104,798	17,931.06	535,798,138	1.66
アメリカ	株式	BAKER HUGHES INC	エネルギー	102,697	7,100.16	729,165,615	5,211.91	535,247,973	1.66
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	6,791	47,478.94	322,429,514	76,794.75	521,513,178	1.62
アメリカ	株式	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,837	7,897.64	535,752,598	7,392.40	501,478,863	1.56
アメリカ	株式	LOWE'S COS INC	小売	58,419	8,977.01	524,428,234	8,367.83	488,840,267	1.52
アメリカ	株式	PHILLIPS 66	エネルギー	50,360	9,523.90	479,624,022	9,512.46	479,047,939	1.49

アメリカ	株式	NRG ENERGY INC	公益事業	390,649	1,282.43	500,983,898	1,220.78	476,899,221	1.48
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	67,631	7,328.34	495,623,511	6,923.43	468,238,738	1.45
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,122	6,917.39	464,309,058	6,750.58	453,113,068	1.41
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	53,782	8,215.53	441,847,844	8,379.91	450,688,701	1.40
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	67,878	7,003.20	475,363,739	6,540.27	443,940,834	1.38
アメリカ	株式	ANADARKO PETROLEUM CORP	エネルギー	96,816	9,367.89	906,962,041	4,502.40	435,905,085	1.35
カナダ	株式	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	運輸	28,580	19,284.95	551,163,970	14,554.49	415,967,524	1.29
アメリカ	株式	KROGER CO	食品・生活必需品小売り	88,713	4,652.28	412,718,275	4,571.30	405,534,039	1.26
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	75,891	4,968.96	377,099,776	5,145.43	390,492,276	1.21
アメリカ	株式	STARBUCKS CORP	消費者サービス	54,028	6,077.34	328,346,720	7,165.77	387,152,651	1.20
アメリカ	株式	ALTRIA GROUP INC	食品・飲料・タバコ	53,467	6,269.52	335,212,795	7,207.47	385,362,232	1.19
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	33,555	13,016.49	436,768,332	11,304.97	379,338,305	1.18
アメリカ	株式	AMPHENOL CORP-CL A	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	64,672	6,902.83	446,419,959	5,857.36	378,807,199	1.17
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	36,788	11,005.21	404,859,795	10,084.18	370,976,965	1.15
アメリカ	株式	BOSTON SCIENTIFIC CORP	ヘルスケア機器・サービス	176,145	2,141.81	377,270,250	2,042.70	359,811,920	1.12
アメリカ	株式	BLACKROCK INC	各種金融	9,793	44,138.09	432,244,393	36,160.67	354,121,519	1.10
アメリカ	株式	AMDOCS LTD	ソフトウェア・サービス	54,255	6,566.86	356,285,375	6,516.10	353,531,098	1.10
アメリカ	株式	SYNCHRONY FINANCIAL	各種金融	103,672	3,830.37	397,102,150	3,383.15	350,738,062	1.09
アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	33,308	9,987.48	332,663,253	10,215.93	340,272,276	1.06
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC		14,883	23,379.88	347,962,814	22,577.30	336,018,064	1.04

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	8.21
		素材	3.27
		資本財	5.95
		商業・専門サービス	1.32
		運輸	2.18
		自動車・自動車部品	0.64
		耐久消費財・アパレル	2.27
		消費者サービス	3.61
		メディア	2.91
		小売	5.65

	食品・生活必需品小売り	2.02
	食品・飲料・タバコ	3.69
	家庭用品・パーソナル用品	0.84
	ヘルスケア機器・サービス	3.65
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	11.10
	銀行	4.73
	各種金融	5.33
	不動産	1.60
	ソフトウェア・サービス	17.23
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.53
	電気通信サービス	0.63
	公益事業	1.48
	半導体・半導体製造装置	1.32
投資証券		2.40
合計		97.56

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	買建	60,013.13	7,123,318	7,253,186	0.02
	米ドル	売建	1,308.33	155,070	158,124	0.00

(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2016年 1月29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	ドイツ	1,729,144,819	7.21
	イタリア	980,867,569	4.09
	フランス	2,859,703,557	11.93
	オランダ	1,230,334,342	5.13
	スペイン	475,516,802	1.98
	ベルギー	418,331,205	1.74
	オーストリア	124,598,182	0.52

	アイルランド	401,691,720	1.68
	ギリシャ	89,653,449	0.37
	ポルトガル	424,531,524	1.77
	イギリス	7,886,932,490	32.89
	スイス	4,487,368,600	18.72
	スウェーデン	547,564,895	2.28
	ノルウェー	131,966,100	0.55
	デンマーク	636,775,717	2.66
	バミューダ	349,783,610	1.46
	ジャージー	787,121,682	3.28
	小計	23,561,886,263	98.27
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		415,500,723	1.73
合計（純資産総額）		23,977,386,986	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		135,380,538	0.56
	売建		141,862,626	0.59

(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	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	136,747	8,955.20	1,224,597,012	8,726.90	1,193,377,941	4.98
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	33,615	32,319.72	1,086,427,704	30,770.68	1,034,356,476	4.31
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	94,900	11,596.75	1,100,532,374	9,233.58	876,267,596	3.65
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,059,795	588.95	624,168,143	639.51	677,758,682	2.83
フランス	株式	DANONE	食品・飲料・タバコ	79,555	8,331.36	662,802,020	8,099.37	644,345,985	2.69
イギリス	株式	BETFAIR GROUP PLC	消費者サービス	87,045	4,000.11	348,190,213	7,394.08	643,617,868	2.68
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	54,383	10,345.06	562,595,805	10,631.16	578,154,510	2.41
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	689,273	1,017.28	701,186,381	829.05	571,446,677	2.38

フランス	株式	L'OREAL	家庭用品・パーソナル用品	24,408	22,595.46	551,510,057	20,195.57	492,933,619	2.06
オランダ	株式	AKZO NOBEL	素材	61,942	9,054.87	560,876,765	7,626.20	472,382,638	1.97
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	34,565	18,625.54	643,791,910	13,474.73	465,754,094	1.94
ジャージー	株式	MPP PLC	メディア	181,385	2,730.00	495,182,113	2,544.53	461,540,699	1.92
ドイツ	株式	LINDE AG	素材	26,883	25,078.86	674,195,057	16,170.99	434,724,980	1.81
イギリス	株式	LLOYDS BANKING GROUP PLC	銀行	3,873,380	146.00	565,526,299	111.20	430,744,253	1.80
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,117,858	388.80	434,623,603	373.69	417,739,297	1.74
アイルランド	株式	PADDY POWER PLC	消費者サービス	22,536	10,528.16	237,262,778	17,824.44	401,691,720	1.68
スイス	株式	UBS GROUP AG-REG	各種金融	203,562	2,122.12	431,983,866	1,973.09	401,646,350	1.68
スイス	株式	TEMENOS GROUP AG-REG	ソフトウェア・サービス	66,205	4,197.55	277,898,890	5,734.48	379,651,381	1.58
オランダ	株式	RELX NV	メディア	193,831	2,010.52	389,702,296	1,950.16	378,003,081	1.58
ドイツ	株式	SYMRISE AG	素材	49,000	7,801.33	382,265,623	7,664.53	375,562,377	1.57
フランス	株式	LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	19,525	21,941.60	428,409,914	18,992.82	370,834,986	1.55
イギリス	株式	DOMINO'S PIZZA GROUP PLC	消費者サービス	216,904	1,391.21	301,760,455	1,674.08	363,115,223	1.51
イタリア	株式	ENEL SPA	公益事業	737,033	550.73	405,906,305	485.32	357,702,928	1.49
バミューダ	株式	HISCOX LTD	保険	208,185	1,620.03	337,265,959	1,680.15	349,783,610	1.46
イギリス	株式	IG GROUP HOLDINGS PLC	各種金融	278,264	1,294.56	360,230,130	1,246.23	346,781,668	1.45
イタリア	株式	ENI SPA	エネルギー	195,921	1,670.98	327,380,078	1,740.67	341,035,551	1.42
スウェーデン	株式	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	家庭用品・パーソナル用品	97,699	2,975.45	290,699,188	3,454.45	337,496,408	1.41
ジャージー	株式	BEAZLEY PLC	保険	508,896	513.76	261,454,073	639.77	325,580,983	1.36
イギリス	株式	WHITBREAD PLC	消費者サービス	45,721	9,168.03	419,171,882	6,856.01	313,463,862	1.31
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SE	資本財	48,321	8,844.70	427,385,168	6,395.04	309,014,990	1.29

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	5.79
		素材	8.69
		資本財	4.87
		商業・専門サービス	2.00
		運輸	1.18
		自動車・自動車部品	0.64
		耐久消費財・アパレル	4.13
		消費者サービス	8.08
		メディア	4.16
		小売	1.68
		食品・生活必需品小売り	2.12

	食品・飲料・タバコ	7.66
	家庭用品・パーソナル用品	5.87
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.91
	銀行	12.45
	各種金融	3.74
	保険	2.82
	不動産	0.71
	ソフトウェア・サービス	3.43
	電気通信サービス	5.30
	公益事業	2.56
	半導体・半導体製造装置	0.48
合 計		98.27

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	121,713.00	15,689,510	16,086,807	0.07
	デンマーククローネ	買建	6,735,953.24	116,336,150	119,293,731	0.50
	英ポンド	売建	817,369.65	138,240,391	141,862,626	0.59

(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2016年 1月29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	138,864,141	1.85
	アイルランド	187,973,207	2.51
	イギリス	58,584,062	0.78
	ケイマン	298,416,355	3.98
	オーストラリア	4,085,478,856	54.48
	バミューダ	149,463,007	1.99
	香港	1,443,974,044	19.25
	シンガポール	732,351,796	9.77
	中国	146,322,891	1.95

	小計	7,241,428,359	96.56
投資証券	オーストラリア	84,691,461	1.13
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		173,498,762	2.31
合計（純資産総額）		7,499,618,582	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 (%)
香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	758,200	742.76	563,167,293	655.29	496,846,564	6.62
オーストラリア	株式	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	177,622	3,192.87	567,124,493	2,321.38	412,329,224	5.50
オーストラリア	株式	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	55,753	7,919.56	441,539,712	6,666.91	371,700,668	4.96
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	39,747	8,127.42	323,040,594	9,177.61	364,782,560	4.86
オーストラリア	株式	WESTPAC BANKING CORP	銀行	120,794	3,267.09	394,645,247	2,610.91	315,383,084	4.21
オーストラリア	株式	BRAMBLES LTD	商業・専門サービス	321,430	984.23	316,362,142	949.96	305,348,664	4.07
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	210,306	2,388.19	502,250,928	1,293.46	272,023,661	3.63
オーストラリア	株式	AUST AND NZ BANKING GROUP	銀行	122,648	3,085.47	378,427,117	2,059.26	252,564,905	3.37
オーストラリア	株式	WESFARMERS LTD	食品・生活必需品小売り	64,477	3,704.79	238,874,068	3,593.43	231,694,038	3.09
シンガポール	株式	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	電気通信サービス	687,620	356.98	245,468,668	294.79	202,704,050	2.70
オーストラリア	株式	WOOLWORTHS LTD	食品・生活必需品小売り	90,314	2,429.65	219,431,483	2,096.95	189,384,556	2.53
アイルランド	株式	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	素材	135,961	1,327.73	180,519,499	1,382.55	187,973,207	2.51
ケイマン	株式	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	資本財	127,272	1,553.28	197,689,729	1,465.69	186,541,934	2.49
オーストラリア	株式	AGL ENERGY LTD	公益事業	103,435	1,292.25	133,664,673	1,570.14	162,408,238	2.17
香港	株式	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	不動産	218,100	898.06	195,867,780	738.51	161,070,274	2.15
香港	株式	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	耐久消費財・アパレル	337,500	416.82	140,677,697	464.52	156,777,019	2.09
オーストラリア	株式	TELSTRA CORPORATION LTD	電気通信サービス	313,107	537.32	168,238,875	478.83	149,927,968	2.00
バミューダ	株式	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	資本財	46,400	4,206.27	195,171,206	3,221.18	149,463,007	1.99
アメリカ	株式	RESMED INC-CDI	ヘルスケア機器・サービス	198,909	778.18	154,787,453	698.12	138,864,141	1.85
シンガポール	株式	UNITED OVERSEAS BANK LTD	銀行	92,992	1,914.44	178,028,162	1,488.35	138,405,080	1.85
オーストラリア	株式	RIO TINTO LTD	素材	41,490	4,865.22	201,858,056	3,334.74	138,358,520	1.84

オーストラリア	株式	ASX LTD	各種金融	36,834	3,635.40	133,906,436	3,561.74	131,193,234	1.75
オーストラリア	株式	MEDIBANK PRIVATE LTD	保険	571,667	203.50	116,339,633	214.14	122,422,488	1.63
香港	株式	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	電気通信サービス	642,000	167.58	107,591,494	181.15	116,302,665	1.55
シンガポール	株式	COMFORTDELGRO CORP LTD	運輸	477,800	255.89	122,265,814	240.57	114,947,404	1.53
ケイマン	株式	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	不動産	183,772	875.17	160,832,191	608.76	111,874,421	1.49
オーストラリア	株式	COMPUTERSHARE LTD	ソフトウェア・サービス	122,464	1,105.55	135,390,656	910.56	111,511,530	1.49
オーストラリア	株式	QBE INSURANCE GROUP LTD	保険	117,806	1,122.43	132,229,813	913.13	107,572,853	1.43
オーストラリア	株式	RECALL HOLDINGS LTD	商業・専門サービス	180,730	656.88	118,719,113	562.78	101,712,350	1.36
オーストラリア	株式	WOODSIDE PETROLEUM LTD	エネルギー	43,723	2,993.81	130,898,660	2,258.85	98,763,882	1.32

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	1.32
		素材	11.26
		資本財	5.37
		商業・専門サービス	5.43
		運輸	1.53
		耐久消費財・アパレル	2.09
		消費者サービス	0.92
		食品・生活必需品小売り	5.61
		ヘルスケア機器・サービス	1.85
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.86
		銀行	23.02
		各種金融	1.75
		保険	10.62
		不動産	8.33
		ソフトウェア・サービス	2.51
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.32
電気通信サービス	6.60		
公益事業	2.17		
投資証券			1.13
合計			97.69

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。

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2016年 1月29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	4,290,140,079	26.97
	カナダ	218,147,996	1.37
	メキシコ	171,462,938	1.08
	ドイツ	684,223,810	4.30
	イタリア	1,651,121,454	10.38
	フランス	1,448,598,686	9.11
	オランダ	371,177,404	2.33
	スペイン	959,235,585	6.03
	ベルギー	443,980,738	2.79
	オーストリア	282,832,715	1.78
	フィンランド	128,758,194	0.81
	アイルランド	161,091,736	1.01
	イギリス	1,549,173,377	9.74
	スイス	34,809,259	0.22
	スウェーデン	80,218,745	0.50
	ノルウェー	45,333,992	0.28
	デンマーク	204,994,755	1.29
	ポーランド	78,950,794	0.50
	オーストラリア	189,356,213	1.19
	シンガポール	83,268,385	0.52
マレーシア	78,118,938	0.49	
南アフリカ	53,081,969	0.33	
小計		13,208,077,762	83.03
特殊債券	アメリカ	30,346,257	0.19
	ドイツ	193,419,524	1.22
	イギリス	52,300,112	0.33
	国際機関	115,220,072	0.72
	小計		391,285,965
社債券	アメリカ	1,218,935,866	7.66
	カナダ	36,967,981	0.23
	ルクセンブルク	53,957,515	0.34
	アイルランド	24,411,980	0.15

	イギリス	129,780,711	0.82
	スウェーデン	60,757,874	0.38
	英ヴァージン諸島	62,229,376	0.39
	小計	1,587,041,303	9.98
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		720,894,668	4.53
合計（純資産総額）		15,907,299,698	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	1,027,276,960	6.46
	買建	カナダ	98,234,680	0.62
	買建	ドイツ	139,708,976	0.88
	買建	イギリス	62,198,809	0.39
	買建	オーストラリア	238,453,875	1.50
	売建	ドイツ	63,679,506	0.40
その他先物取引	買建	イギリス	172,094,655	1.08
	売建	アメリカ	60,051,237	0.38
	売建	イギリス	171,504,517	1.08

(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		2,194,733,654	13.80
	売建		2,234,344,916	14.05

(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	5,390,000	12,155.89	655,202,956	12,113.44	652,914,432	0.875	2016/12/31	4.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,315,000	12,078.53	641,974,353	12,114.38	643,879,541	1.375	2020/4/30	4.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,485,000	12,257.35	427,168,909	12,252.25	426,990,979	1.500	2018/8/31	2.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,365,000	12,742.34	428,779,808	12,650.74	425,697,577	2.500	2024/5/15	2.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,855,000	13,171.20	376,037,872	13,087.01	373,634,147	3.125	2021/5/15	2.35
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,595,000	13,488.21	350,019,123	13,566.24	352,043,981	0.500	2019/11/25	2.21
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,220,000	14,623.02	324,631,143	14,597.51	324,064,788	1.500	2022/9/4	2.04
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,185,000	12,512.09	273,389,197	13,039.66	284,916,734	0.500	2025/5/25	1.79
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,170,000	23,888.43	279,494,737	23,425.40	274,077,213	4.750	2030/12/7	1.72

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,025,000	13,692.30	277,269,170	12,944.42	262,124,536	3.125	2043/2/15	1.65
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,425,000	18,023.14	256,829,794	18,105.52	258,003,743	2.000	2020/7/22	1.62
イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,385,000	17,762.94	246,016,747	17,905.45	247,990,529	1.750	2019/7/22	1.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,020,000	12,022.93	242,863,366	12,040.72	243,222,734	0.625	2017/11/30	1.53
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,335,000	17,371.36	231,907,755	17,077.81	227,988,868	5.500	2022/9/1	1.43
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,430,000	16,317.70	233,343,227	15,819.44	226,217,999	3.500	2030/3/1	1.42
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000	16,060.24	224,843,375	15,807.64	221,306,984	3.750	2024/9/1	1.39
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,295,000	16,909.43	218,977,161	16,486.22	213,496,613	5.500	2021/4/30	1.34
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,380,000	15,400.44	212,526,188	15,140.86	208,943,958	2.250	2024/5/25	1.31
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,525,000	13,855.64	211,298,593	13,469.31	205,407,016	3.750	2016/8/1	1.29
イギリス	国債証券	UK TREASURY	860,000	23,684.52	203,686,894	23,439.41	201,578,956	3.750	2052/7/22	1.27
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,410,000	14,262.46	201,100,752	14,214.80	200,428,701	2.500	2019/5/1	1.26
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	965,000	22,089.87	213,167,298	20,468.37	197,519,791	4.750	2035/4/25	1.24
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	8,975,000	2,122.72	190,514,174	2,052.58	184,219,863	4.000	2019/11/15	1.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,897.66	178,465,028	12,159.71	182,395,662	1.750	2022/4/30	1.15
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,285,000	13,741.05	176,572,512	13,747.09	176,650,109	1.000	2019/5/25	1.11
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	11,960.85	173,432,395	12,100.22	175,453,190	2.000	2025/8/15	1.10
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	910,000	20,221.67	184,017,265	19,221.78	174,918,202	6.000	2029/1/31	1.10
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,195,000	13,225.98	158,050,551	13,396.72	160,090,907	0.700	2020/5/1	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	12,220.37	155,198,709	12,580.86	159,777,013	3.000	2045/5/15	1.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,220,000	13,376.68	163,195,532	12,700.79	154,949,674	3.000	2042/5/15	0.97

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	83.03
特殊債券	2.46
社債券	9.98
合計	95.47

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 1603	買建	14	米ドル	3,045,089.28	368,059,941	3,057,906.32	369,609,137	2.32
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TNOTE5Y 1603	買建	35	米ドル	4,199,818.37	507,632,046	4,212,304.6	509,141,257	3.20
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TNOTE10Y1603	買建	2	米ドル	257,449.4	31,117,909	258,062.5	31,192,014	0.20

アメリカ	シカゴ商品取引所	TBOND20Y1603	買建	4米ドル	614,319.08	74,252,747	640,250	77,387,017	0.49
アメリカ	シカゴ商品取引所	TBOND30Y1603	買建	2米ドル	330,020.7	39,889,602	330,500	39,947,535	0.25
カナダ	モントリオール取引所	CAN 10Y 1603	買建	8加ドル	1,138,863.09	97,999,169	1,141,600	98,234,680	0.62
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BOBL5Y 1603	買建	8ユーロ	1,049,168.47	138,668,596	1,057,040	139,708,976	0.88
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUXL30Y 1603	売建	3ユーロ	458,434.1	60,591,235	481,800	63,679,506	0.40
オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR03Y1603	買建	3豪ドル	335,057.92	28,701,061	335,517.15	28,740,399	0.18
オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR10Y1603	買建	19豪ドル	2,437,208.92	208,771,316	2,448,207.76	209,713,476	1.32
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT10Y 1603	買建	3英ポンド	357,956.1	62,130,440	358,350	62,198,809	0.39
その他先物取引	アメリカシカゴ商業取引所	90DEURO 1603	売建	2米ドル	496,670.86	60,032,606	496,825	60,051,237	0.38
	イギリスロンドン国際金融先物オプション取引所	90DSTRLN1706	買建	8英ポンド	988,957.4	171,653,336	991,500	172,094,655	1.08
	イギリスロンドン国際金融先物オプション取引所	90DSTRLN1806	売建	8英ポンド	985,542.6	171,060,629	988,100	171,504,517	1.08

(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	11,096,198.67	1,305,272,820	1,340,446,484	8.43
	加ドル	買建	1,774,000.00	147,611,605	152,546,260	0.96
	ユーロ	買建	2,629,000.00	336,525,958	347,501,220	2.18
	英ポンド	買建	230,000.00	38,688,871	39,900,400	0.25
	スウェーデンクローナ	買建	3,174,000.00	43,569,280	45,102,540	0.28
	ノルウェークローネ	買建	6,625,000.00	90,226,790	92,750,000	0.58
	チェココルナ	買建	16,690,000.00	78,815,909	81,614,100	0.51
	ポーランドズロチ	買建	1,495,000.00	42,653,027	44,252,000	0.28
	豪ドル	買建	5,000.00	411,792	427,400	0.00
	シンガポールドル	買建	475,000.00	39,417,336	40,189,750	0.25
	南アフリカランド	買建	1,350,000.00	9,611,506	10,003,500	0.06
	米ドル	売建	7,909,845.37	933,605,027	955,547,212	6.01
	加ドル	売建	1,130,000.00	94,719,500	97,168,700	0.61
	メキシコペソ	売建	2,994,000.00	18,862,200	19,670,580	0.12
	ユーロ	売建	1,010,000.00	129,415,500	133,501,800	0.84
	英ポンド	売建	2,723,000.00	456,821,170	472,386,040	2.97
	スイスフラン	売建	900,000.00	104,910,000	107,361,000	0.67

ノルウェークロネ	売建	7,399,980.30	100,157,180	103,636,674	0.65
デンマーククロネ	売建	5,799,000.00	99,220,890	102,700,290	0.65
豪ドル	売建	446,000.00	36,821,760	38,124,080	0.24
シンガポールドル	売建	2,414,000.00	198,744,620	204,248,540	1.28

(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

2016年1月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,281円

純資産総額…………… 706.12億円

※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。
 ※分配金再投資基準価額は、2006年1月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資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)

2012年1月	2013年1月	2014年1月	2015年1月	2016年1月	設定来累計
30円	30円	350円	700円	300円	7,750円

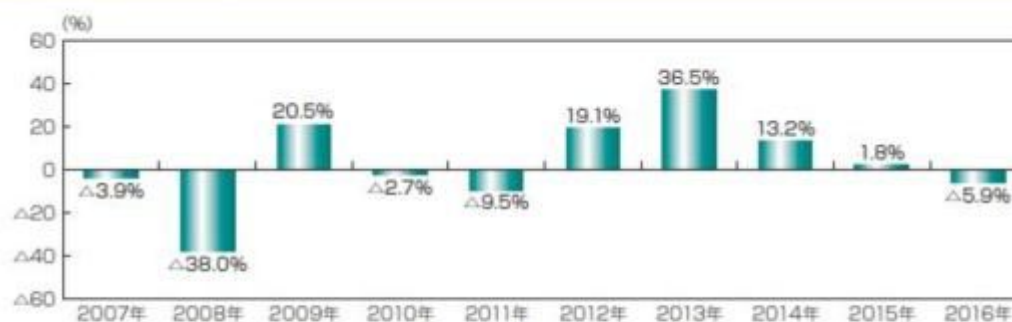
主要な資産の状況

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	20.7%	トヨタ自動車	輸送用機器	7.7%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4.0%
		日本電信電話	情報・通信業	3.6%
日本小型株式 グローバル・ラップ マザーファンド	8.3%	電通国際情報サービス	情報・通信業	2.4%
		岡村製作所	その他製品	2.0%
		日本ユニシス	情報・通信業	1.9%
日本債券 グローバル・ラップ マザーファンド	19.2%	第341回利付国債(10年)	国債証券	10.7%
		第126回利付国債(5年)	国債証券	5.5%
		第340回利付国債(10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	20.6%	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	3.6%
		CHEVRON CORP	エネルギー	2.5%
		APPLE INC	テクノロジー・ハードウェア	2.0%
欧州先進国株式 グローバル・ラップ マザーファンド	14.8%	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	5.0%
		ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー	4.3%
		NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー	3.7%
アジア太平洋株式 グローバル・ラップ マザーファンド	4.4%	AIA GROUP LTD	保険	6.6%
		NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	5.5%
		COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	5.0%
海外債券 グローバル・ラップ マザーファンド	11.0%	US TREASURY N/B	国債証券	4.1%
		US TREASURY N/B	国債証券	4.1%
		US TREASURY N/B	国債証券	2.7%
現金その他	1.0%			

※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。

※2016年は、2016年1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】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(5) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(6) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(7) 申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

(8) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

(9) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(10) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

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。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。

・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

販売会社によっては、買取請求による換金が可能となる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

3 【資産管理等の概要】

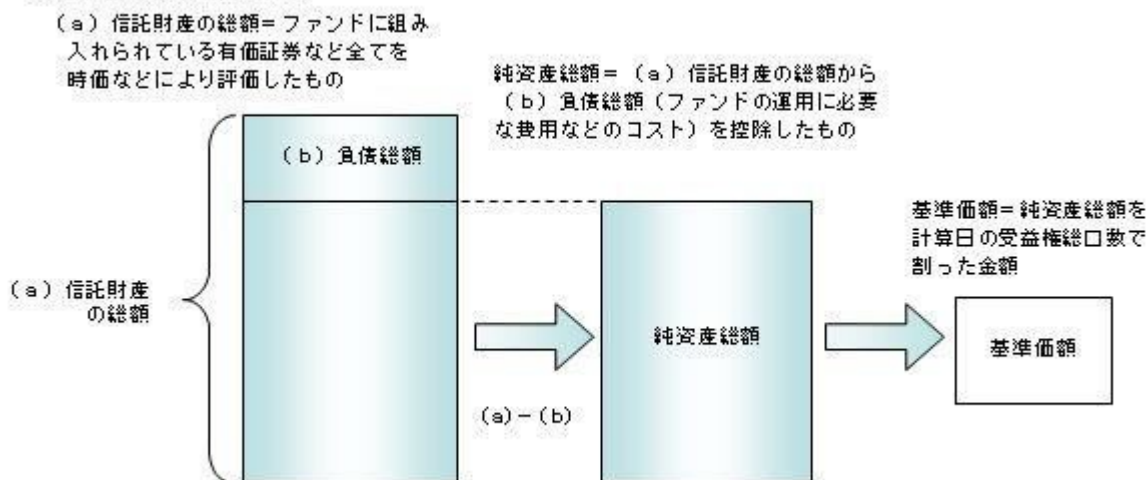
(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

・基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

- 信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

^{*}外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

- 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（平成15年2月28日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年1月11日から翌年1月10日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 第3計算期間の終了日の翌営業日以降、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
 - ロ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ハ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ニ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - ホ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

 - ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日まで)から受益者に支払います。
 - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

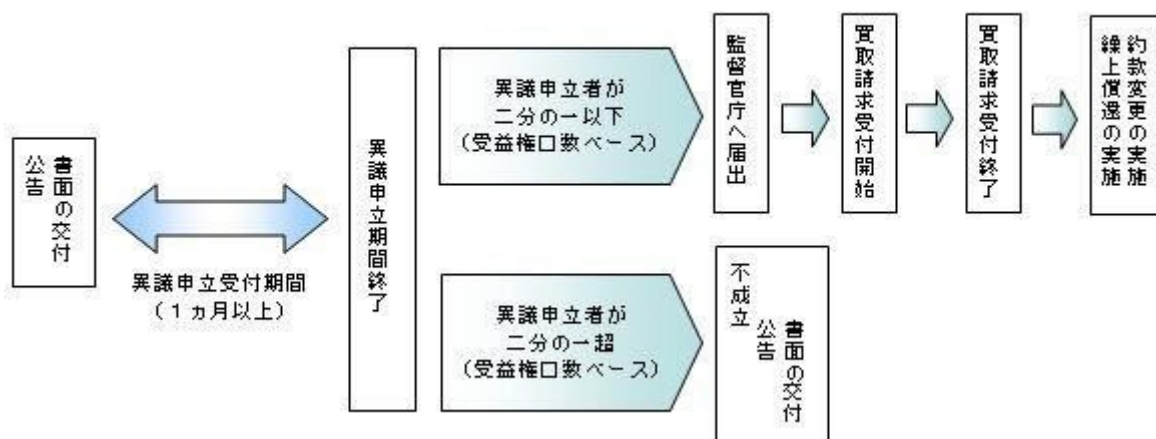
信託約款の変更

 - 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
 - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

 - 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
 - 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

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。
- ・交付運用報告書は、原則として知っ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/>

関係法人との契約について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・投資顧問会社とのマザーファンドにおける運用の指図に関する権限の委託契約または当ファンドにおける投資顧問契約は、当該ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

(3) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(平成27年1月14日から平成28年1月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【GW7つの卵】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 平成27年 1月13日現在	第13期 平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,486,034,937	1,524,737,335
親投資信託受益証券	82,304,588,240	68,200,306,440
未収入金	7,334,406,428	2,034,811,710
未収利息	4,280	2,557
流動資産合計	92,125,033,885	71,759,858,042
資産合計	92,125,033,885	71,759,858,042
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,585,587,353	2,040,656,554
未払解約金	67,018,606	22,180,887
未払受託者報酬	26,334,259	21,603,759
未払委託者報酬	921,701,080	756,133,684
その他未払費用	2,580,698	2,117,112
流動負債合計	6,603,221,996	2,842,691,996
負債合計	6,603,221,996	2,842,691,996
純資産の部		
元本等		
元本	79,794,105,054	68,021,885,165
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,727,706,835	895,280,881
(分配準備積立金)	1,555,823,786	16,513
元本等合計	85,521,811,889	68,917,166,046
純資産合計	85,521,811,889	68,917,166,046
負債純資産合計	92,125,033,885	71,759,858,042

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自	平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
営業収益				
受取利息		784,744		723,051
有価証券売買等損益		11,140,444,074		700,123,870
営業収益合計		11,141,228,818		700,846,921
営業費用				
受託者報酬		53,334,591		44,776,365
委託者報酬		1,866,714,718		1,567,176,981
その他費用		5,184,631		4,387,977
営業費用合計		1,925,233,940		1,616,341,323
営業利益又は営業損失（ ）		9,215,994,878		915,494,402
経常利益又は経常損失（ ）		9,215,994,878		915,494,402
当期純利益又は当期純損失（ ）		9,215,994,878		915,494,402
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,014,826,223		1,154,502,928
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,845,794,154		5,727,706,835
剰余金増加額又は欠損金減少額		295,964,008		470,463,165
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		295,964,008		470,463,165
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,029,632,629		1,192,235,235
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,029,632,629		1,192,235,235
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		5,585,587,353		2,040,656,554
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,727,706,835		895,280,881

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月11日から翌年1月10日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は平成27年 1月14日から平成28年 1月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第12期 平成27年 1月13日現在	第13期 平成28年 1月12日現在
1.	期首元本額	103,346,324,622円	79,794,105,054円
	期中追加設定元本額	3,998,358,835円	4,685,780,147円
	期中一部解約元本額	27,550,578,403円	16,458,000,036円
2.	受益権の総数	79,794,105,054口	68,021,885,165口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日		第13期 自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日	
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	458,202,994円	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	378,376,826円
2. 分配金の計算過程		2. 分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	1,371,186,831円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	5,770,158,495円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	4,171,883,049円	C 信託約款に定める収益調整金	1,688,535,592円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	65,813円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	1,247,401,843円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	11,313,294,188円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	2,935,937,435円
F 分配対象収益(1万口当たり)	1,417円	F 分配対象収益(1万口当たり)	431円
G 分配金額	5,585,587,353円	G 分配金額	2,040,656,554円
H 分配金額(1万口当たり)	700円	H 分配金額(1万口当たり)	300円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	第13期 自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第12期 平成27年 1月13日現在	第13期 平成28年 1月12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ぬ。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第12期（平成27年 1月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,699,271,941
合計	8,699,271,941

第13期（平成28年 1月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,155,699,911
合計	1,155,699,911

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第12期 平成27年 1月13日現在		第13期 平成28年 1月12日現在	
1口当たり純資産額	1.0718円	1口当たり純資産額	1.0132円
(1万口当たり純資産額)	(10,718円)	(1万口当たり純資産額)	(10,132円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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	7,884,635,614	14,051,997,591	
	日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド	1,399,536,266	5,560,357,584	
	日本債券グローバル・ラップマザーファンド	10,335,251,706	13,657,001,604	
	北米株式グローバル・ラップマザーファンド	7,016,472,184	14,241,333,591	
	欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド	3,696,486,835	10,172,362,121	
	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	613,484,608	2,930,861,366	
	海外債券グローバル・ラップマザーファンド	3,072,533,548	7,586,392,583	
合計		34,018,400,761	68,200,306,440	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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、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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	401,024,027	337,844,380
株式	37,182,673,580	31,453,397,210
未収入金	1,166,897,141	300,644,627

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
未収配当金	40,042,310	47,210,540
未収利息	690	566
流動資産合計	38,790,637,748	32,139,097,323
資産合計	38,790,637,748	32,139,097,323
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,204,745,846	295,196,081
流動負債合計	1,204,745,846	295,196,081
負債合計	1,204,745,846	295,196,081
純資産の部		
元本等		
元本	21,719,991,492	17,867,346,455
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	15,865,900,410	13,976,554,787
元本等合計	37,585,891,902	31,843,901,242
純資産合計	37,585,891,902	31,843,901,242
負債純資産合計	38,790,637,748	32,139,097,323

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
1. 期首	平成26年 1月11日	平成27年 1月14日
期首元本額	26,983,497,381円	21,719,991,492円
期首からの追加設定元本額	505,704,906円	2,871,904,840円
期首からの一部解約元本額	5,769,210,795円	6,724,549,877円
元本の内訳		
GW7つの卵	9,356,825,640円	7,884,635,614円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	331,941,376円	271,839,458円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	755,230,761円	560,045,315円

グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	5,384,632,564円	4,287,413,507円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	2,493,508,486円	1,836,143,395円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	2,182,982,430円	1,836,693,178円
日本大型株式ファンド	111,945,440円	99,813,282円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	43,721,109円	45,703,449円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	121,177,227円	123,080,429円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	169,583,745円	166,980,640円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	395,882,255円	394,457,425円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	372,560,459円	360,540,763円
計	21,719,991,492円	17,867,346,455円
2. 受益権の総数	21,719,991,492口	17,867,346,455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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12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。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	<p>売買目的有価証券</p> <p>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>	<p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>同左</p>

（有価証券に関する注記）

（平成27年 1月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	5,115,189,724
合計	5,115,189,724

（平成28年 1月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,040,248,899
合計	4,040,248,899

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年 1月13日現在		平成28年 1月12日現在	
1口当たり純資産額	1.7305円	1口当たり純資産額	1.7822円
(1万口当たり純資産額)	(17,305円)	(1万口当たり純資産額)	(17,822円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
長谷工コーポレーション	152,700	1,207.00	184,308,900	
鹿島建設	552,000	659.00	363,768,000	
大和ハウス工業	141,100	3,154.00	445,029,400	
日本ハム	150,000	2,212.00	331,800,000	
宝ホールディングス	188,200	855.00	160,911,000	
サントリー食品インターナショナル	87,900	5,130.00	450,927,000	
味の素	177,000	2,646.50	468,430,500	
キューピー	52,400	2,593.00	135,873,200	
日本たばこ産業	180,300	4,083.00	736,164,900	
日本触媒	33,600	7,680.00	258,048,000	
三井化学	382,000	480.00	183,360,000	
住友ベークライト	585,000	457.00	267,345,000	
D I C	848,000	298.00	252,704,000	
ユニ・チャーム	119,100	2,106.50	250,884,150	
協和発酵キリン	314,000	1,806.00	567,084,000	
エーザイ	34,600	7,540.00	260,884,000	
大塚ホールディングス	169,100	4,008.00	677,752,800	
J Xホールディングス	171,500	441.60	75,734,400	
日本特殊陶業	94,000	2,857.00	268,558,000	
新日鐵住金	169,100	2,147.50	363,142,250	
ジェイ エフ イー ホールディングス	94,400	1,694.50	159,960,800	
三菱マテリアル	610,000	347.00	211,670,000	
住友電気工業	142,300	1,519.50	216,224,850	
S U M C O	99,200	784.00	77,772,800	
アマダホールディングス	335,700	1,066.00	357,856,200	
D M G 森精機	304,000	1,202.00	365,408,000	

ダイキン工業	73,100	7,804.00	570,472,400
日立製作所	1,047,000	613.40	642,229,800
マブチモーター	27,500	5,930.00	163,075,000
日本電産	77,700	7,755.00	602,563,500
オムロン	42,900	3,590.00	154,011,000
セイコーエプソン	278,700	1,640.00	457,068,000
ソニー	231,300	2,675.00	618,727,500
アルプス電気	66,100	2,806.00	185,476,600
キーエンス	13,600	56,470.00	767,992,000
川崎重工業	960,000	393.00	377,280,000
日産自動車	675,300	1,121.00	757,011,300
トヨタ自動車	350,600	6,755.00	2,368,303,000
マツダ	268,600	2,113.00	567,551,800
本田技研工業	98,500	3,503.00	345,045,500
ヤマハ発動機	54,200	2,418.00	131,055,600
島津製作所	87,000	1,778.00	154,686,000
オリンパス	62,700	4,380.00	274,626,000
バンダイナムコホールディングス	81,600	2,483.00	202,612,800
凸版印刷	179,000	1,020.00	182,580,000
四国電力	79,500	1,759.00	139,840,500
九州電力	112,400	1,231.00	138,364,400
電源開発	112,400	3,945.00	443,418,000
東日本旅客鉄道	55,700	10,355.00	576,773,500
ヤマトホールディングス	210,200	2,281.50	479,571,300
商船三井	827,000	264.00	218,328,000
日本航空	110,200	4,040.00	445,208,000
コロプラ	41,300	2,089.00	86,275,700
日本電信電話	236,800	4,689.00	1,110,355,200
KDDI	242,400	2,948.50	714,716,400
ソフトバンクグループ	89,600	5,528.00	495,308,800
丸紅	555,200	565.20	313,799,040
三菱商事	295,200	1,861.50	549,514,800
スズケン	97,300	4,260.00	414,498,000
J.フロント リテイリング	109,800	1,610.00	176,778,000
セブン&アイ・ホールディングス	41,500	4,980.00	206,670,000
高島屋	171,000	988.00	168,948,000
丸井グループ	259,900	1,848.00	480,295,200
ニトリホールディングス	24,100	9,080.00	218,828,000
ファーストリテイリング	4,200	37,630.00	158,046,000
サンドラッグ	26,700	7,400.00	197,580,000
ゆうちょ銀行	99,000	1,572.00	155,628,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,173,500	677.00	1,471,459,500

三井住友トラスト・ホールディングス	685,000	412.90	282,836,500	
三井住友フィナンシャルグループ	102,700	4,156.00	426,821,200	
西日本シティ銀行	717,000	286.00	205,062,000	
横浜銀行	367,000	685.10	251,431,700	
北洋銀行	300,100	382.00	114,638,200	
野村ホールディングス	647,900	611.80	396,385,220	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	108,400	3,515.00	381,026,000	
第一生命保険	77,600	1,774.00	137,662,400	
オリックス	296,700	1,569.00	465,522,300	
三井不動産	86,000	2,817.50	242,305,000	
住友不動産	128,000	3,118.00	399,104,000	
イオンモール	48,600	1,885.00	91,611,000	
ディー・エヌ・エー	114,700	1,606.00	184,208,200	
電通	100,700	6,130.00	617,291,000	
オリエンタルランド	21,000	7,137.00	149,877,000	
楽天	110,100	1,212.00	133,441,200	
合 計	20,749,000		31,453,397,210	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	408,083,309	717,061,128
株式	12,121,785,900	12,230,462,600
未収入金	351,556,524	56,076,489
未収配当金	11,245,200	13,513,450
未収利息	702	1,202
流動資産合計	12,892,671,635	13,017,114,869
資産合計	12,892,671,635	13,017,114,869
負債の部		
流動負債		

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
未払金	5,659,203	65,833,388
未払解約金	273,072,468	277,581,218
流動負債合計	278,731,671	343,414,606
負債合計	278,731,671	343,414,606
純資産の部		
元本等		
元本	3,422,404,195	3,189,952,346
剰余金		
剰余金又は欠損金()	9,191,535,769	9,483,747,917
元本等合計	12,613,939,964	12,673,700,263
純資産合計	12,613,939,964	12,673,700,263
負債純資産合計	12,892,671,635	13,017,114,869

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
1. 期首	平成26年 1月11日	平成27年 1月14日
期首元本額	4,822,624,219円	3,422,404,195円
期首からの追加設定元本額	50,191,605円	827,241,999円
期首からの一部解約元本額	1,450,411,629円	1,059,693,848円
元本の内訳		
GW7つの卵	1,472,073,088円	1,399,536,266円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	78,359,169円	73,571,743円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	165,164,124円	123,247,073円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	867,893,968円	773,770,705円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	350,335,316円	301,831,383円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	224,859,316円	241,843,520円
日本小型株式ファンド	66,299,384円	57,444,465円

年金積立	グローバル・ラップ・バランス（安定型）	15,603,509円	16,106,201円
年金積立	グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	28,497,726円	33,636,028円
年金積立	グローバル・ラップ・バランス（成長型）	36,874,150円	36,822,518円
年金積立	グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	64,187,460円	71,832,886円
年金積立	グローバル・ラップ・バランス（積極型）	52,256,985円	60,309,558円
	計	3,422,404,195円	3,189,952,346円
2.	受益権の総数	3,422,404,195口	3,189,952,346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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12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。	同左
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。	(1)有価証券 同左

	(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。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成27年 1月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,995,562,829
合計	1,995,562,829

（平成28年 1月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	349,411,862
合計	349,411,862

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額	3.6857円	1口当たり純資産額	3.9730円
(1万口当たり純資産額)	(36,857円)	(1万口当たり純資産額)	(39,730円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
ナカノフード建設	273,500	681.00	186,253,500	
青木あすなる建設	93,700	738.00	69,150,600	
日成ビルド工業	288,000	364.00	104,832,000	
新興プランテック	70,600	909.00	64,175,400	
フィード・ワン	964,900	126.00	121,577,400	
S Foods	57,700	2,006.00	115,746,200	
東洋紡	1,164,000	158.00	183,912,000	
セーレン	151,600	1,240.00	187,984,000	
ヤマトインターナショナル	266,200	403.00	107,278,600	
セントラル硝子	372,000	570.00	212,040,000	
藤倉化成	161,800	519.00	83,974,200	
デクセリアルズ	108,100	1,200.00	129,720,000	
三光合成	190,000	374.00	71,060,000	
東リ	596,000	307.00	182,972,000	
ニッタ	54,600	2,867.00	156,538,200	
アジアパイルホールディングス	206,400	484.00	99,897,600	
品川リフラクトリーズ	200,000	242.00	48,400,000	
愛知製鋼	275,000	480.00	132,000,000	
宮地エンジニアリンググループ	531,000	172.00	91,332,000	
トーカロ	90,600	2,216.00	200,769,600	
富士機械製造	50,300	1,088.00	54,726,400	
日特エンジニアリング	127,000	1,003.00	127,381,000	
日精エー・エス・ビー機械	55,700	1,849.00	102,989,300	
TOWA	324,800	676.00	219,564,800	
アイチ コーポレーション	305,300	772.00	235,691,600	
アネスト岩田	242,600	904.00	219,310,400	
キトー	68,700	986.00	67,738,200	
T P R	61,200	2,928.00	179,193,600	
ユーシン精機	76,000	2,129.00	161,804,000	
キッツ	452,600	507.00	229,468,200	
シンフォニアテクノロジー	844,000	174.00	146,856,000	
山洋電気	140,000	672.00	94,080,000	

ダイヘン	335,000	611.00	204,685,000
ミマキエンジニアリング	146,400	452.00	66,172,800
アイホン	69,200	1,774.00	122,760,800
京三製作所	473,000	334.00	157,982,000
エレコム	163,600	1,500.00	245,400,000
タムラ製作所	361,000	314.00	113,354,000
ヨコオ	122,900	534.00	65,628,600
TOA	145,000	1,130.00	163,850,000
三社電機製作所	105,600	680.00	71,808,000
オブテックス	77,700	2,639.00	205,050,300
芝浦電子	42,000	1,662.00	69,804,000
日本ケミコン	455,000	188.00	85,540,000
ニチユ三菱フォークリフト	382,200	460.00	175,812,000
ファルテック	49,700	1,467.00	72,909,900
プレス工業	261,300	470.00	122,811,000
日機装	88,500	838.00	74,163,000
愛知時計電機	414,000	318.00	131,652,000
東京ボード工業	47,600	1,229.00	58,500,400
フルヤ金属	44,500	1,516.00	67,462,000
萩原工業	105,400	2,200.00	231,880,000
岡村製作所	244,600	1,097.00	268,326,200
イーレックス	54,100	1,653.00	89,427,300
アルプス物流	65,900	1,331.00	87,712,900
東北新社	132,400	787.00	104,198,800
ヒト・コミュニケーションズ	50,400	2,711.00	136,634,400
電通国際情報サービス	129,100	2,145.00	276,919,500
デジタルガレージ	30,400	2,025.00	61,560,000
日本ユニシス	194,400	1,232.00	239,500,800
カドカワ	70,900	1,659.00	117,623,100
TKC	40,000	2,921.00	116,840,000
トシン・グループ	13,000	2,320.00	30,160,000
マクニカ・富士エレホールディングス	147,100	1,388.00	204,174,800
ラクト・ジャパン	42,400	1,527.00	64,744,800
シップヘルスケアホールディングス	22,200	2,800.00	62,160,000
コンドーテック	166,100	711.00	118,097,100
ドウシシャ	50,000	2,370.00	118,500,000
第一実業	239,000	494.00	118,066,000
阪和興業	443,000	463.00	205,109,000
PALTAC	51,000	2,016.00	102,816,000
ヤマタネ	747,000	175.00	130,725,000
トラスコ中山	47,100	4,180.00	196,878,000
エディオン	243,500	885.00	215,497,500

D C Mホールディングス	176,900	813.00	143,819,700
パルコ	161,500	1,004.00	162,146,000
武蔵野銀行	31,100	3,990.00	124,089,000
北日本銀行	32,200	3,170.00	102,074,000
ライフネット生命保険	225,500	426.00	96,063,000
アニコム ホールディングス	79,300	2,740.00	217,282,000
ジャックス	244,000	392.00	95,648,000
オープンハウス	79,600	2,000.00	159,200,000
インテリックス	88,300	895.00	79,028,500
タケエイ	171,800	935.00	160,633,000
エス・エム・エス	83,000	2,353.00	195,299,000
ベネフィット・ワン	49,000	2,400.00	117,600,000
バリューHR	41,700	1,769.00	73,767,300
ベルシステム24ホールディングス	60,000	1,229.00	73,740,000
リロ・ホールディング	16,000	13,310.00	212,960,000
イチネンホールディングス	165,100	1,030.00	170,053,000
西尾レントオール	28,900	2,967.00	85,746,300
合 計	17,711,000		12,230,462,600

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	407,532,532	902,434,203
国債証券	17,197,076,000	15,027,533,000
地方債証券	118,665,000	525,616,000
特殊債券	2,133,528,000	1,738,202,666
社債券	15,211,617,592	12,406,183,617
未収入金	2,424,472,500	1,381,168,000
未収利息	68,956,200	66,017,683
前払費用	20,861,796	9,537,837

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
流動資産合計	37,582,709,620	32,056,693,006
資産合計	37,582,709,620	32,056,693,006
負債の部		
流動負債		
未払金	316,002,000	1,024,781,000
未払解約金	2,168,372,105	1,010,502,493
流動負債合計	2,484,374,105	2,035,283,493
負債合計	2,484,374,105	2,035,283,493
純資産の部		
元本等		
元本	26,896,082,692	22,719,601,114
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,202,252,823	7,301,808,399
元本等合計	35,098,335,515	30,021,409,513
純資産合計	35,098,335,515	30,021,409,513
負債純資産合計	37,582,709,620	32,056,693,006

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 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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
1. 期首	平成26年 1月11日	平成27年 1月14日
期首元本額	32,427,240,890円	26,896,082,692円
期首からの追加設定元本額	665,966,841円	1,594,163,806円
期首からの一部解約元本額	6,197,125,039円	5,770,645,384円
元本の内訳		
GW7つの卵	12,348,565,871円	10,335,251,706円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	1,943,237,216円	1,657,100,776円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	2,707,725,755円	2,153,303,705円

グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	7,142,525,064円	5,739,748,375円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	355,106,821円	270,761,196円
日本債券ファンド	49,519,201円	43,885,966円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	460,172,590円	508,704,207円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	700,246,075円	763,444,603円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	598,273,734円	649,760,368円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	536,734,225円	543,204,949円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	53,976,140円	54,435,263円
計	26,896,082,692円	22,719,601,114円
2. 受益権の総数	26,896,082,692口	22,719,601,114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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12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。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	<p>売買目的有価証券</p> <p>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>	<p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>同左</p>

（有価証券に関する注記）

（平成27年 1月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	603,202,000
地方債証券	3,944,000
特殊債券	139,069,000
社債券	53,598,892
合計	799,813,892

（平成28年 1月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	296,196,000
地方債証券	2,965,000
特殊債券	8,297,756
社債券	14,262,601
合計	293,196,155

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年 1月13日現在		平成28年 1月12日現在	
1口当たり純資産額	1.3050円	1口当たり純資産額	1.3214円
(1万口当たり純資産額)	(13,050円)	(1万口当たり純資産額)	(13,214円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位 : 円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第125回利付国債(5年)	200,000,000	200,842,000	
	第8回利付国債(40年)	400,000,000	408,788,000	
	第329回利付国債(10年)	100,000,000	105,473,000	
	第333回利付国債(10年)	400,000,000	416,052,000	
	第340回利付国債(10年)	3,200,000,000	3,262,336,000	
	第341回利付国債(10年)	3,100,000,000	3,125,606,000	
	第26回利付国債(30年)	200,000,000	254,266,000	
	第29回利付国債(30年)	100,000,000	127,773,000	
	第30回利付国債(30年)	400,000,000	504,008,000	
	第31回利付国債(30年)	200,000,000	248,090,000	
	第34回利付国債(30年)	400,000,000	497,544,000	
	第35回利付国債(30年)	100,000,000	119,944,000	
	第38回利付国債(30年)	200,000,000	230,254,000	

	第41回利付国債(30年)	100,000,000	112,699,000	
	第47回利付国債(30年)	300,000,000	330,045,000	
	第48回利付国債(30年)	300,000,000	314,853,000	
	第49回利付国債(30年)	100,000,000	104,866,000	
	第121回利付国債(20年)	400,000,000	477,248,000	
	第123回利付国債(20年)	100,000,000	122,315,000	
	第127回利付国債(20年)	300,000,000	358,239,000	
	第130回利付国債(20年)	400,000,000	471,844,000	
	第133回利付国債(20年)	400,000,000	471,512,000	
	第140回利付国債(20年)	500,000,000	580,760,000	
	第145回利付国債(20年)	400,000,000	463,576,000	
	第146回利付国債(20年)	200,000,000	231,468,000	
	第150回利付国債(20年)	200,000,000	219,682,000	
	第153回利付国債(20年)	200,000,000	214,650,000	
	第154回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,052,800,000	
国債証券 合計		13,900,000,000	15,027,533,000	
地方債証券	第698回東京都公募公債	100,000,000	105,243,000	
	第742回東京都公募公債	100,000,000	100,813,000	
	平成27年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,948,000	
	平成27年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,152,000	
	第1回札幌市公募公債(20年)	100,000,000	117,460,000	
地方債証券 合計		500,000,000	525,616,000	
特殊債券	第44回韓国産業銀行円貨債券(2014)	100,000,000	100,009,576	
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	378,018,000	
	第7回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,786,000	
	第21回道路債券	400,000,000	515,756,000	
	第11回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,955,000	
	第109回福岡北九州高速道路債券	500,000,000	506,678,090	
特殊債券 合計		1,500,000,000	1,738,202,666	
社債券	第4回ノルデア・バンク・アクツィエボラーグ・ブリクト円貨社債(2013)	200,000,000	200,265,889	
	第4回新韓銀行円貨社債(2014)	100,000,000	99,921,926	
	第4回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	100,000,000	100,745,000	
	第12回株式会社ポスコ円貨社債(2013)	100,000,000	100,227,778	
	第23回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション円貨社債(2013)	200,000,000	200,477,470	

第9回ドイツ銀行円貨社債(2015)	100,000,000	100,000,000	
第17回ルノー円貨社債(2015)	100,000,000	100,016,000	
第11回現代キャピタル・サービス・インク円貨社債(2015)	100,000,000	99,999,000	
第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債(2012)	200,000,000	202,410,000	
第20回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ポエレンリーバンク・ピー・エー(ラボバンク・ネーダールランド)円貨社債(2013)	200,000,000	200,241,304	
第7回ロイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2015)	100,000,000	100,408,000	
第5回株式会社ケーティ円貨社債(2015)	100,000,000	100,047,000	
第6回釜山銀行円貨社債(2015)	100,000,000	99,948,000	
第34回大成建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,733,000	
第10回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,780,000	
第40回鹿島建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,123,000	
第41回鹿島建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,168,000	
第5回西松建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,394,634	
第7回西松建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,245,000	
第2回五洋建設株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,299,000	
第1回GLP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)	100,000,000	100,720,000	
第9回関西ペイント無担保社債	100,000,000	100,426,000	
第25回太平洋セメント株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,790,000	
第3回ニチアス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,603,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,582,000	
第3回株式会社森精機製作所無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,306,000	
第1回株式会社小森コーポレーション無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,770,000	
第8回株式会社荏原製作所無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,646,000	

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	301,380,000	
第4回日本電気株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,741,000	
第8回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	105,576,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	200,620,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	200,000,000	201,098,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,314,000	
第15回三井造船株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,337,000	
第38回川崎重工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,240,000	
第38回株式会社IHI無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	103,027,000	
第41回株式会社IHI無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,768,000	
第1回明治安田生命2011基金特定目的会社特定社債(一般担保付)	200,000,000	200,837,120	
第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債(一般担保付)	100,000,000	100,485,345	
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	403,584,000	
第1回日本生命2015基金特定目的会社特定社債(一般担保付)	100,000,000	100,312,000	
第5回ドン・キホーテ無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,213,247	
第2回株式会社トブコン無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,606,000	
第2回三菱商事利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,755,000	
第24回阪和興業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,172,000	
第26回阪和興業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,338,000	
第28回株式会社丸井グループ無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,912,000	
第47回株式会社クレディセゾン無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,269,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,162,000	

第37回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	213,188,000	
第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ無担保社債(実質破綻時免除特約及び劣後特約付)	100,000,000	100,513,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	214,136,000	
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	422,556,000	
第3回株式会社武蔵野銀行期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,893,000	
第3回株式会社大垣共立銀行期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	101,060,000	
第9回三菱UFJ信託銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,927,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(実質破綻時免除特約および劣後特約付)	100,000,000	100,826,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,166,000	
第20回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,813,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社期限前償還条項付無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,500,000	
第62回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,116,136	
第63回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,993,000	
第64回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,462,000	
第68回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,801,000	
第69回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,661,000	
第71回アコム株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,551,000	
第12回株式会社ジャックス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,277,000	
第13回株式会社ジャックス無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,577,000	
第3回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,631,000	
第4回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,637,000	

第3回株式会社アプラスフィナンシャル無担保社債 (社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,752,000	
第182回オリックス株式会社無担保社債(社債間 限定同順位特約付)	100,000,000	99,672,000	
第2回野村ホールディングス劣後無担保社債	100,000,000	113,283,000	
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	300,152,200	
第2回ソニーフィナンシャルホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,539,000	
第5回NECキャピタルソリューション株式会社無 担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,327,000	
第16回東京建物株式会社無担保社債(社債間限定 同順位特約付)	100,000,000	101,182,000	
第3回京阪神ビルディング株式会社無担保社債	100,000,000	100,832,000	
第87回住友不動産株式会社無担保社債(社債間限 定同順位特約付)	200,000,000	204,076,000	
第102回住友不動産株式会社無担保社債(社債間 限定同順位特約付)	100,000,000	98,774,000	
第7回日本リテールファンド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)	100,000,000	104,113,000	
第7回グローバル・ワン不動産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)	100,000,000	101,348,000	
第15回ユナイテッド・アーバン投資法人無担保投 資法人債(特定投資法人債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,216,000	
第35回南海電気鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,579,000	
第499回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,548,000	
第490回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,193,568	
第492回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,863,000	
第494回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,645,000	
第497回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,901,000	
第467回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,249,000	
第469回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,639,000	
第420回九州電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	202,330,000	
第422回九州電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	206,904,000	
第315回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,165,000	
第316回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	207,132,000	
第29回電源開発株式会社無担保社債(社債間限定 同順位特約付)	100,000,000	104,322,000	
第1回株式会社イチネンホールディングス無担保社 債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,005,000	

	第2回ファーストリテイリング無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,118,000	
社債券 合計		12,200,000,000	12,406,183,617	
	合計	28,100,000,000	29,697,535,283	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,806,685,608	346,375,085
コール・ローン	16,754,195	1,692,721
出資金	1,770,550,373	-
株式	36,838,893,977	30,744,487,082
投資証券	1,059,439,589	802,985,331
派生商品評価勘定	19,450,262	46,017
未収入金	-	274,770,906
未収配当金	32,102,859	23,381,115
未収利息	28	2
流動資産合計	41,543,876,891	32,193,738,259
資産合計	41,543,876,891	32,193,738,259
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	65,787	109
未払金	-	312,076,075
未払解約金	1,514,470,498	26,368,089
流動負債合計	1,514,536,285	338,444,273
負債合計	1,514,536,285	338,444,273
純資産の部		
元本等		
元本	18,862,942,341	15,694,668,271
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	21,166,398,265	16,160,625,715
元本等合計	40,029,340,606	31,855,293,986

平成27年 1月13日現在

平成28年 1月12日現在

純資産合計	40,029,340,606	31,855,293,986
負債純資産合計	41,543,876,891	32,193,738,259

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
1.	期首	平成26年 1月11日	平成27年 1月14日
	期首元本額	27,661,790,414円	18,862,942,341円
	期首からの追加設定元本額	202,119,058円	2,775,982,371円
	期首からの一部解約元本額	9,000,967,131円	5,944,256,441円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	8,113,084,309円	7,016,472,184円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	293,098,090円	248,703,979円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	642,816,694円	508,875,546円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	4,742,924,068円	3,752,292,198円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	1,966,441,357円	1,510,611,252円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	2,092,870,253円	1,643,378,196円
	北米株式ファンド	62,721,353円	56,704,018円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	48,728,564円	52,857,648円

年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	107,827,571円	112,917,511円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	146,916,831円	152,782,101円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	351,060,656円	344,948,425円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	294,452,595円	294,125,213円
計	18,862,942,341円	15,694,668,271円
2. 受益権の総数	18,862,942,341口	15,694,668,271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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12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ぬ。	同左
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	(1)有価証券 同左 (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。	同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成27年 1月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
出資金	209,097,246
株式	1,587,360,672
投資証券	142,287,178
合計	1,520,550,604

（平成28年 1月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,144,899,668
投資証券	55,221,252
合計	3,200,120,920

（注） 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（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27年 1月13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	7,542,147	-	7,476,360	65,787
	米ドル	7,542,147	-	7,476,360	65,787
	売建	1,606,607,447	-	1,587,157,185	19,450,262
	米ドル	1,606,607,447	-	1,587,157,185	19,450,262
	合計	1,614,149,594	-	1,594,633,545	19,384,475

（平成28年 1月12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	898,723	-	899,493	770
	米ドル	898,723	-	899,493	770
	売建	26,368,089	-	26,322,951	45,138
	米ドル	26,368,089	-	26,322,951	45,138
	合計	27,266,812	-	27,222,444	45,908

（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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年 1月13日現在		平成28年 1月12日現在	
1口当たり純資産額	2,122円	1口当たり純資産額	2,029円
(1万口当たり純資産額)	(21,221円)	(1万口当たり純資産額)	(20,297円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	96,816	37.75	3,654,804.00	
	BAKER HUGHES INC	102,697	41.51	4,262,952.47	
	CHEVRON CORP	76,926	80.77	6,213,313.02	
	PHILLIPS 66	50,360	76.18	3,836,424.80	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	23,175	119.49	2,769,180.75	
	CROWN HOLDINGS INC	43,373	46.58	2,020,314.34	
	PPG INDUSTRIES INC	24,206	94.45	2,286,256.70	
	VULCAN MATERIALS CO	18,926	85.86	1,624,986.36	
	DOVER CORP	28,570	56.97	1,627,632.90	
	FASTENAL CO	40,848	38.89	1,588,578.72	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,196	98.42	2,775,050.32	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	12,383	188.11	2,329,366.13	
	REXNORD CORP	74,444	15.65	1,165,048.60	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	9,323	173.47	1,617,260.81	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	59,610	39.40	2,348,634.00	
	SMITH (A.O.) CORP	20,182	65.48	1,321,517.36	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	19,473	90.50	1,762,306.50	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	19,271	44.99	867,002.29	
	VERISK ANALYTICS INC	36,830	74.04	2,726,893.20	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	51,410	51.62	2,653,784.20	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	26,699	75.84	2,024,852.16		

CARTER'S INC	7,441	92.08	685,167.28
MATTEL INC	52,199	26.70	1,393,713.30
NIKE INC -CL B	37,524	59.55	2,234,554.20
POLARIS INDUSTRIES INC	23,586	80.10	1,889,238.60
ARAMARK	31,731	31.87	1,011,266.97
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	957	411.10	393,422.70
DUNKIN' BRANDS GROUP INC	26,980	38.68	1,043,586.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	55,723	19.24	1,072,110.52
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	39,653	56.00	2,220,568.00
SERVICEMASTER GLOBAL HOLDING	31,611	38.92	1,230,300.12
STARBUCKS CORP	54,028	57.82	3,123,898.96
COMCAST CORP-CLASS A	67,878	54.72	3,714,284.16
THE WALT DISNEY CO.	33,555	99.92	3,352,815.60
TIME WARNER CABLE	5,410	183.30	991,653.00
AMAZON.COM INC	6,791	617.74	4,195,072.34
AUTOZONE INC	1,537	718.69	1,104,626.53
DOLLAR TREE INC	26,493	77.36	2,049,498.48
LOWE'S COS INC	58,419	72.68	4,245,892.92
PRICELINE GROUP INC/THE	1,383	1,136.28	1,571,475.24
TRACTOR SUPPLY COMPANY	24,048	82.65	1,987,567.20
KROGER CO	88,713	41.28	3,662,072.64
SYSCO CORP	51,519	40.12	2,066,942.28
ALTRIA GROUP INC	53,467	59.46	3,179,147.82
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,114	93.90	855,804.60
COCA-COLA CO/THE	75,891	41.58	3,155,547.78
HERSHEY CO/THE	29,335	84.25	2,471,473.75
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,209	62.81	1,457,757.29
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,751	82.88	725,282.88
ATHENAHEALTH INC	13,826	154.08	2,130,310.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	176,145	17.13	3,017,363.85
DIPLOMAT PHARMACY INC	46,243	31.82	1,471,452.26
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	31,499	85.97	2,707,969.03
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	12,584	114.46	1,440,364.64
ABBVIE INC	67,122	53.88	3,616,533.36
ALDER BIOPHARMACEUTICALS INC	41,848	27.30	1,142,450.40

AMGEN INC	29,881	147.69	4,413,124.89
BIOGEN INC	9,850	278.54	2,743,619.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	67,837	62.98	4,272,374.26
CELGENE CORP	27,306	103.03	2,813,337.18
ELI LILLY & CO	33,077	80.27	2,655,090.79
ENDO INTERNATIONAL PLC	41,799	53.74	2,246,278.26
IRONWOOD PHARMACEUTICALS INC	116,228	10.60	1,232,016.80
MALLINCKRODT PLC	26,469	65.17	1,724,984.73
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,362	480.82	2,578,156.84
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	14,878	85.45	1,271,325.10
CITIGROUP INC	70,151	46.85	3,286,574.35
JPMORGAN CHASE & CO	70,426	58.83	4,143,161.58
MGIC INVESTMENT CORP	262,392	7.81	2,049,281.52
PACWEST BANCORP	55,006	38.39	2,111,680.34
US BANCORP	74,409	39.86	2,965,942.74
AMERICAN EXPRESS CO	35,497	64.05	2,273,582.85
BLACKROCK INC	10,328	308.32	3,184,328.96
E*TRADE FINANCIAL CORP	115,408	26.66	3,076,777.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	10,107	252.64	2,553,432.48
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	59,836	39.25	2,348,563.00
SYNCHRONY FINANCIAL	108,732	28.70	3,120,608.40
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	60,867	28.81	1,753,578.27
JONES LANG LASALLE INC	21,597	142.31	3,073,469.07
ADOBE SYSTEMS INC	33,308	89.38	2,977,069.04
ALPHABET INC-CL C	13,140	716.03	9,408,634.20
AMDOCS LTD	54,255	51.81	2,810,951.55
ANSYS INC	14,796	85.27	1,261,654.92
CADENCE DESIGN SYS INC	75,750	19.28	1,460,460.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,841	56.12	1,337,956.92
COSTAR GROUP INC	5,471	180.12	985,436.52
FACEBOOK INC-A	46,859	97.51	4,569,221.09
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	34,987	58.94	2,062,133.78
LINKEDIN CORP - A	3,602	210.93	759,769.86
MASTERCARD INC-CLASS A	40,238	90.58	3,644,758.04
NETSUITE INC	17,931	77.14	1,383,197.34

	SERVICENOW INC	29,778	78.53	2,338,466.34	
	TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	4,837	87.13	421,447.81	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	5,375	160.57	863,063.75	
	ULTIMATE SOFTWARE GROUP INC	8,728	176.50	1,540,492.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	56,150	73.92	4,150,608.00	
	WORKDAY INC-CLASS A	7,327	70.25	514,721.75	
	AMPHENOL CORP-CL A	59,814	46.27	2,767,593.78	
	APPLE INC	57,036	98.53	5,619,757.08	
	COMMSCOPE HOLDING CO INC	47,901	23.28	1,115,135.28	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	27,148	64.37	1,747,516.76	
	NATIONAL INSTRUMENTS CORP	42,983	27.87	1,197,936.21	
	TE CONNECTIVITY LTD	40,258	57.92	2,331,743.36	
	T-MOBILE US INC	43,245	39.68	1,715,961.60	
	NRG ENERGY INC	390,649	10.23	3,996,339.27	
	ATMEL CORP	113,828	7.86	894,688.08	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,378	128.04	1,968,999.12	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	30,863	51.21	1,580,494.23	
米ドル小計		4,852,850		253,404,841.18 (29,851,090,291)	
加ドル	CANADIAN NATURAL RESOURCES	126,948	25.81	3,276,527.88	
	MEG ENERGY CORP	161,108	6.27	1,010,147.16	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	28,580	159.30	4,552,794.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,752	516.00	1,936,032.00	
加ドル小計		320,388		10,775,501.04 (893,396,791)	
合計		5,173,238		30,744,487,082 (30,744,487,082)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	29,346	2,772,610.08	
		LEXINGTON REALTY TRUST	147,933	1,121,332.14	

	SIMON PROPERTY GROUP INC	15,653	2,922,571.63	
米ドル小計		192,932	6,816,513.85 (802,985,331)	
	合計		802,985,331 (802,985,331)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 108銘柄	97.4%		94.7%
	投資証券 3銘柄		2.6%	2.5%
加ドル	株式 4銘柄	100.0%		2.8%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,634,966,841	869,204,474
コール・ローン	27,056,987	25,612,404
株式	33,318,586,232	22,639,596,526
派生商品評価勘定	8,624,375	-
未収入金	28,400,354	-
未収配当金	77,031,355	23,936,771
未収利息	46	42
流動資産合計	35,094,666,190	23,558,350,217

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産合計	35,094,666,190	23,558,350,217
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	45,733	99,465
未払解約金	1,040,883,935	75,345,968
流動負債合計	1,040,929,668	75,445,433
負債合計	1,040,929,668	75,445,433
純資産の部		
元本等		
元本	12,297,586,503	8,533,495,513
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	21,756,150,019	14,949,409,271
元本等合計	34,053,736,522	23,482,904,784
純資産合計	34,053,736,522	23,482,904,784
負債純資産合計	35,094,666,190	23,558,350,217

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</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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
1. 期首	平成26年 1月11日	平成27年 1月14日
期首元本額	15,629,328,362円	12,297,586,503円
期首からの追加設定元本額	275,823,122円	1,136,650,602円
期首からの一部解約元本額	3,607,564,981円	4,900,741,592円

元本の内訳		
GW7つの卵	5,158,140,169円	3,696,486,835円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	164,181,652円	110,935,274円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	408,297,882円	258,194,730円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	2,977,255,853円	1,978,075,153円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	1,331,461,373円	835,171,362円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	1,619,232,097円	1,120,155,974円
欧州先進国株式ファンド	43,689,103円	40,093,281円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	25,003,107円	23,663,082円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	59,807,095円	50,203,534円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	92,484,069円	76,722,032円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	219,086,673円	181,627,936円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	198,947,430円	162,166,320円
計	12,297,586,503円	8,533,495,513円
2. 受益権の総数	12,297,586,503口	8,533,495,513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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12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。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（平成27年 1月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,869,616,563
合計	1,869,616,563

（平成28年 1月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,996,699,967
合計	1,996,699,967

（注） 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（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27年 1月13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	5,571,225	-	5,525,492	45,733
	英ポンド	5,571,225	-	5,525,492	45,733
	売建	1,039,381,723	-	1,030,757,348	8,624,375
	英ポンド	1,039,381,723	-	1,030,757,348	8,624,375
	合計	1,044,952,948	-	1,036,282,840	8,578,642

(平成28年 1月12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	85,921	-	85,380	541
	英ポンド	85,921	-	85,380	541
	売建	69,829,585	-	69,928,509	98,924
	英ポンド	69,829,585	-	69,928,509	98,924
	合計	69,915,506	-	70,013,889	99,465

(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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年 1月13日現在		平成28年 1月12日現在	
1口当たり純資産額	2.7691円	1口当たり純資産額	2.7519円
(1万口当たり純資産額)	(27,691円)	(1万口当たり純資産額)	(27,519円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	149,243	9.35	1,395,571.29	
	TECHNIP SA	16,368	37.98	621,656.64	
	AKZO NOBEL	61,942	57.63	3,569,717.46	
	LINDE AG	26,883	124.00	3,333,492.00	
	SYMRISE AG	49,000	57.16	2,800,840.00	
	BRENTAG AG	1,871	45.97	86,019.22	
	GEA GROUP AG	54,216	33.67	1,825,723.80	
	LEGRAND SA	35,969	48.91	1,759,423.63	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	48,321	48.70	2,353,474.30	
	APPLUS SERVICES SA	66,804	7.73	516,728.94	
	AENA SA	15,409	102.80	1,584,045.20	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	19,525	135.20	2,639,780.00	
	PADDY POWER PLC	22,536	124.00	2,794,464.00	
	RELX NV	193,831	14.66	2,842,531.61	
	VIVENDI	59,819	18.72	1,119,811.68	
	D'IETEREN SA/NV	42,659	29.75	1,269,105.25	
	JERONIMO MARTINS	130,241	12.08	1,573,962.48	
	DANONE	79,555	58.74	4,673,060.70	
	L'OREAL	24,408	148.50	3,624,588.00	
	BAYER AG	34,565	102.80	3,553,282.00	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	105,797	19.65	2,078,911.05		
BNP PARIBAS	53,034	47.90	2,540,328.60		
ERSTE GROUP BANK AG	35,865	26.57	953,112.37		
INTESA SANPAOLO	791,843	2.85	2,263,087.29		
KBC GROEP NV	38,535	54.02	2,081,660.70		

	CERVED INFORMATION SOLUTIONS	19,986	7.19	143,699.34
	LEG IMMOBILIEN AG	17,938	71.18	1,276,826.84
	AMADEUS IT HOLDING SA	42,872	38.82	1,664,291.04
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	86,964	8.80	765,283.20
	ENEL SPA	615,039	3.74	2,303,936.09
	ENGIE	108,162	15.05	1,628,378.91
	ASM INTERNATIONAL NV	25,045	32.88	823,604.82
ユーロ小計		3,074,245		62,460,398.45 (7,986,186,545)
英ポンド	BG GROUP PLC	284,441	9.17	2,610,315.05
	CAIRN ENERGY PLC	263,404	1.34	354,541.78
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	148,235	13.54	2,007,101.90
	BHP BILLITON PLC	135,091	6.36	859,313.85
	CRODA INTERNATIONAL PLC	54,125	28.29	1,531,196.25
	RIO TINTO PLC	85,783	16.97	1,455,737.51
	IMI PLC	50,542	7.87	398,018.25
	SIG PLC	274,085	1.40	385,911.68
	BABCOCK INTL GROUP PLC	112,204	9.42	1,056,961.68
	MITIE GROUP PLC	484,461	2.99	1,451,929.61
	STAGECOACH GROUP PLC	220,586	2.82	622,052.52
	GKN PLC	317,503	2.78	884,880.86
	BELLWAY PLC	57,838	27.74	1,604,426.12
	BURBERRY GROUP PLC	75,561	10.84	819,081.24
	BETFAIR GROUP PLC	87,045	39.68	3,453,945.60
	COMPASS GROUP PLC	104,814	11.33	1,187,542.62
	DOMINO'S PIZZA GROUP PLC	207,113	10.40	2,153,975.20
	WHITBREAD PLC	45,721	41.99	1,919,824.79
	WPP PLC	181,385	14.53	2,635,524.05
	NEXT PLC	15,265	67.85	1,035,730.25
	BOOKER GROUP PLC	875,171	1.71	1,503,543.77
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,383	59.77	3,250,471.91
	BARCLAYS PLC	930,086	1.99	1,857,381.74
	HSBC HOLDINGS PLC	689,273	4.97	3,431,200.99
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,873,380	0.68	2,669,920.83
	IG GROUP HOLDINGS PLC	278,264	7.92	2,205,242.20
	BEAZLEY PLC	508,896	3.77	1,921,591.29
	HISCOX LTD	208,185	10.25	2,133,896.25
	FIDESSA GROUP PLC	41,438	18.89	782,763.82
	JUST EAT PLC	157,495	4.76	750,148.68
	BT GROUP PLC	334,179	4.63	1,547,248.77
	VODAFONE GROUP PLC	1,117,858	2.20	2,468,230.46
	CENTRICA PLC	278,189	2.06	573,625.71

英債券小計		12,551,999		53,523,277.23 (9,175,495,415)
スイスフラン	SIKA AG-BR	286	3,488.00	997,568.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,286	152.00	1,259,472.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	25,144	65.00	1,634,360.00
	NESTLE SA-REG	136,747	70.25	9,606,476.75
	NOVARTIS AG-REG	94,900	80.70	7,658,430.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	33,615	261.00	8,773,515.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,450	44.23	1,125,653.50
	UBS GROUP AG-REG	203,562	17.53	3,568,441.86
	TEMENOS GROUP AG-REG	66,205	46.80	3,098,394.00
スイスフラン小計		594,195		37,722,311.11 (4,434,257,670)
スウェーデンクローナ	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	97,699	228.10	22,285,141.90
	COM HEM HOLDING AB	193,273	73.85	14,273,211.05
スウェーデンクローナ小計		290,972		36,558,352.95 (504,139,687)
デンマーククローネ	JYSKE BANK-REG	37,114	294.10	10,915,227.40
	SYDBANK A/S	46,973	205.50	9,652,951.50
	TDC A/S	316,843	34.43	10,908,904.49
デンマーククローネ小計		400,930		31,477,083.39 (539,517,209)
合 計		16,912,341		22,639,596,526 (22,639,596,526)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
ユーロ	株式 32銘柄	100.0%	35.3%
英債券	株式 33銘柄	100.0%	40.5%
スイスフラン	株式 9銘柄	100.0%	19.6%
スウェーデンクローナ	株式 2銘柄	100.0%	2.2%
デンマーククローネ	株式 3銘柄	100.0%	2.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

	(単位：円)	
	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	421,258,167	221,423,014
株式	11,536,720,270	6,967,896,944
投資証券	139,186,369	83,087,085
派生商品評価勘定	-	118,080
未収入金	108,360,707	27,487,851
未収配当金	7,622,255	5,323,672
未収利息	725	371
流動資産合計	12,213,148,493	7,305,337,017
資産合計	12,213,148,493	7,305,337,017
負債の部		
流動負債		
未払金	33,767,566	-
未払解約金	292,755,018	128,758,251
流動負債合計	326,522,584	128,758,251
負債合計	326,522,584	128,758,251
純資産の部		
元本等		
元本	2,074,036,902	1,502,203,581
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,812,589,007	5,674,375,185
元本等合計	11,886,625,909	7,176,578,766
純資産合計	11,886,625,909	7,176,578,766
負債純資産合計	12,213,148,493	7,305,337,017

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</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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「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。

（貸借対照表に関する注記）

		平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
1.	期首	平成26年 1月11日	平成27年 1月14日
	期首元本額	2,740,286,860円	2,074,036,902円
	期首からの追加設定元本額	50,164,651円	260,866,177円
	期首からの一部解約元本額	716,414,609円	832,699,498円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	856,822,249円	613,484,608円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	22,830,139円	19,140,071円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	58,632,426円	46,819,638円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	507,264,712円	337,360,025円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	216,671,427円	171,165,224円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	293,603,493円	203,734,817円
	アジア太平洋先進国株式ファンド	23,155,162円	18,359,499円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	4,219,889円	4,652,964円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	8,201,378円	8,638,839円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	12,946,095円	13,986,929円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	37,266,892円	31,225,131円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	32,423,040円	33,635,836円
	計	2,074,036,902円	1,502,203,581円
2.	受益権の総数	2,074,036,902口	1,502,203,581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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12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。	同左
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>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</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。	同左

(有価証券に関する注記)

(平成27年 1月13日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	399,523,068
投資証券	39,683,281
合計	439,206,349

(平成28年 1月12日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,396,300,449
投資証券	15,076,456
合計	1,411,376,905

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(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27年 1月13日現在)

該当事項はありません。

(平成28年 1月12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	24,390,080	-	24,272,000	118,080
	香港ドル	24,390,080	-	24,272,000	118,080
	合計	24,390,080	-	24,272,000	118,080

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年 1月13日現在		平成28年 1月12日現在	
1口当たり純資産額	5.7312円	1口当たり純資産額	4.7774円
(1万口当たり純資産額)	(57,312円)	(1万口当たり純資産額)	(47,774円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,800	48.15	520,020.00	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	46,400	25.75	1,194,800.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	218,100	6.47	1,411,107.00	
米ドル小計		275,300		3,125,927.00 (368,234,200)	
豪ドル	WOODSIDE PETROLEUM LTD	54,193	27.63	1,497,352.59	
	BHP BILLITON LTD	198,739	15.55	3,090,391.45	
	DULUXGROUP LTD	119,054	6.26	745,278.04	
	INCITEC PIVOT LTD	323,888	3.51	1,136,846.88	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	135,961	15.83	2,152,262.63	
	ORICA LIMITED	66,490	14.04	933,519.60	
	RIO TINTO LTD	41,490	40.50	1,680,345.00	
	SOUTH32 LTD	182,808	0.90	165,441.24	

	BRAMBLES LTD	321,430	10.83	3,481,086.90	
	RECALL HOLDINGS LTD	180,730	6.46	1,167,515.80	
	WESFARMERS LTD	64,477	39.75	2,562,960.75	
	WOOLWORTHS LTD	86,479	22.87	1,977,774.73	
	RESMED INC-CDI	198,909	7.45	1,481,872.05	
	CSL LTD	39,747	102.90	4,089,966.30	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	122,648	25.15	3,084,597.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	54,653	78.64	4,297,911.92	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	174,401	27.42	4,782,075.42	
	WESTPAC BANKING CORP	117,963	30.56	3,604,949.28	
	ASX LTD	36,834	39.06	1,438,736.04	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	544,925	2.13	1,160,690.25	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	110,025	11.27	1,239,981.75	
	COMPUTERSHARE LTD	122,464	10.85	1,328,734.40	
	TELSTRA CORPORATION LTD	296,684	5.31	1,575,392.04	
	AGL ENERGY LTD	98,406	17.70	1,741,786.20	
豪ドル小計		3,693,398		50,417,468.46 (4,157,424,449)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	122,272	97.95	11,976,542.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	337,500	29.40	9,922,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	189,000	21.40	4,044,600.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	253,500	21.90	5,551,650.00	
	HANG SENG BANK LTD	24,800	135.10	3,350,480.00	
	HSBC HOLDINGS PLC	62,400	56.35	3,516,240.00	
	AIA GROUP LTD	747,000	42.30	31,598,100.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	169,200	27.10	4,585,320.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	183,772	46.50	8,545,398.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	114,000	23.45	2,673,300.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	189,000	19.38	3,662,820.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	43,000	79.50	3,418,500.00	
	SWIRE PACIFIC LTD-B	152,500	14.76	2,250,900.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	265,000	21.00	5,565,000.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	34,900	138.00	4,816,200.00	
	HKBN LTD	811,500	9.56	7,757,940.00	
		3,699,344		113,235,490.40	

香港ドル小計				(1,718,914,744)
シンガポールドル	COMFORTDELGRO CORP LTD	477,800	2.92	1,395,176.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	45,038	15.38	692,684.44
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	92,992	18.27	1,698,963.84
	CITY DEVELOPMENTS LTD	41,000	7.50	307,500.00
	UOL GROUP LTD	165,200	5.71	943,292.00
	VENTURE CORP LTD	139,400	7.97	1,111,018.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	662,720	3.52	2,332,774.40
	STARHUB LTD	92,900	3.54	328,866.00
シンガポールドル小計		1,717,050		8,810,274.68 (723,323,551)
合計		9,385,092		6,967,896,944 (6,967,896,944)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
豪ドル	投資証券	LENDLEASE GROUP	75,646	1,007,604.72	
豪ドル小計			75,646	1,007,604.72 (83,087,085)	
		合計		83,087,085 (83,087,085)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 3銘柄	100.0%		5.2%
豪ドル	株式 24銘柄	98.0%		58.9%
	投資証券 1銘柄		2.0%	1.2%
香港ドル	株式 16銘柄	100.0%		24.4%

シンガポールドル	株式	8銘柄	100.0%		10.3%
----------	----	-----	--------	--	-------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	700,312,775	404,054,802
コール・ローン	10,154,388	11,097,002
国債証券	13,946,795,151	13,115,419,259
特殊債券	506,889,962	379,924,693
社債券	1,969,942,077	1,563,846,230
派生商品評価勘定	171,669,437	105,857,206
未収入金	393,530,624	-
未収利息	138,042,738	122,858,986
前払費用	9,031,671	11,203,039
差入委託証拠金	344,445,969	347,239,324
流動資産合計	18,190,814,792	16,061,500,541
資産合計	18,190,814,792	16,061,500,541
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	131,743,786	91,149,907
未払金	-	43,562,028
未払解約金	970,793,437	284,474,523
流動負債合計	1,102,537,223	419,186,458
負債合計	1,102,537,223	419,186,458
純資産の部		
元本等		
元本	6,619,810,227	6,335,246,625
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,468,467,342	9,307,067,458
元本等合計	17,088,277,569	15,642,314,083
純資産合計	17,088,277,569	15,642,314,083
負債純資産合計	18,190,814,792	16,061,500,541

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27年 1月13日現在	平成28年 1月12日現在
1.	期首	平成26年 1月11日	平成27年 1月14日
	期首元本額	8,944,447,267円	6,619,810,227円
	期首からの追加設定元本額	106,166,637円	1,143,755,887円
	期首からの一部解約元本額	2,430,803,677円	1,428,319,489円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	3,161,579,532円	3,072,533,548円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	148,609,596円	141,616,086円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	297,237,409円	260,477,491円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	1,871,474,389円	1,670,931,233円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	692,101,098円	672,370,458円
	海外債券ファンド	58,272,737円	52,972,636円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	27,302,034円	32,722,553円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	54,618,657円	64,446,203円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	66,627,290円	78,042,875円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	138,038,613円	156,138,899円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	103,948,872円	132,994,643円

	計	6,619,810,227円	6,335,246,625円
2.	受益権の総数	6,619,810,227口	6,335,246,625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）

金融商品の状況に関する事項

	自 平成26年 1月11日 至 平成27年 1月13日	自 平成27年 1月14日 至 平成28年 1月12日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 1月13日現在	平成28年 1月12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。	同左
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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（平成27年 1月13日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	856,696,898
特殊債券	10,977,820
社債券	5,772,794
合計	873,447,512

（平成28年 1月12日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	335,221,930
特殊債券	6,675,245
社債券	7,440,151
合計	349,337,326

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

（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27年 1月13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	1,986,755,588	-	2,004,139,675	17,384,087
	売建	513,715,404	-	517,316,798	3,601,394
	合計	2,500,470,992	-	2,521,456,473	13,782,693

(平成28年 1月12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	債券先物取引				
	買建	1,470,804,070	-	1,477,041,432	6,237,362
	売建	377,044,432	-	379,252,922	2,208,490
	合計	1,847,848,502	-	1,856,294,354	4,028,872

(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27年 1月13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	8,225,133,815	-	8,113,816,826	111,316,989
	米ドル	4,467,418,760	-	4,444,381,236	23,037,524
	加ドル	572,362,566	-	551,393,990	20,968,576
	メキシコペソ	215,635,963	-	214,307,100	1,328,863
	ユーロ	831,406,575	-	804,112,250	27,294,325
	英ポンド	1,105,314,171	-	1,088,175,540	17,138,631

	スイスフラン	154,076,800	-	148,562,410	5,514,390
	スウェーデンク ローナ	42,699,243	-	39,528,000	3,171,243
	ノルウェークローネ	28,262,707	-	25,534,300	2,728,407
	デンマーククローネ	88,892,412	-	88,247,220	645,192
	ポーランドズロチ	9,496,101	-	9,205,890	290,211
	豪ドル	263,026,036	-	258,925,860	4,100,176
	ニュージーランド ドル	252,441,105	-	250,204,500	2,236,605
	シンガポールドル	154,396,580	-	151,829,060	2,567,520
	南アフリカランド	39,704,796	-	39,409,470	295,326
	売建	9,195,998,093	-	9,058,518,970	137,479,123
	米ドル	4,867,729,333	-	4,836,226,830	31,502,503
	加ドル	353,848,480	-	341,442,800	12,405,680
	メキシコペソ	361,665,590	-	350,351,360	11,314,230
	ユーロ	955,977,820	-	927,633,570	28,344,250
	英ポンド	1,422,276,350	-	1,398,295,890	23,980,460
	スイスフラン	170,300,030	-	163,690,510	6,609,520
	スウェーデンク ローナ	44,264,800	-	40,992,000	3,272,800
	ノルウェークローネ	28,924,400	-	25,534,300	3,390,100
	デンマーククローネ	181,693,560	-	176,494,440	5,199,120
	ポーランドズロチ	4,599,420	-	4,607,880	8,460
	豪ドル	350,860,930	-	344,744,740	6,116,190
	ニュージーランド ドル	252,491,760	-	250,204,500	2,287,260
	シンガポールドル	169,637,560	-	166,311,900	3,325,660
	南アフリカランド	31,728,060	-	31,988,250	260,190
	合計	17,421,131,908	-	17,172,335,796	26,162,134

(平成28年 1月12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	2,412,251,386	-	2,324,069,927	88,181,459
	米ドル	1,448,760,309	-	1,396,821,217	51,939,092

加ドル	146,779,831	-	138,989,760	7,790,071
メキシコペソ	33,100,305	-	30,222,000	2,878,305
ユーロ	372,104,950	-	365,452,460	6,652,490
英ポンド	119,211,947	-	114,139,080	5,072,867
スイスフラン	7,788,614	-	7,642,700	145,914
スウェーデンク ローナ	70,321,279	-	67,708,900	2,612,379
チェココルナ	49,004,873	-	47,631,100	1,373,773
ポーランドズロチ	79,174,691	-	75,231,450	3,943,241
豪ドル	8,358,008	-	7,906,560	451,448
ニュージーランド ドル	66,820,204	-	62,901,700	3,918,504
南アフリカランド	10,826,375	-	9,423,000	1,403,375
売建	2,723,551,754	-	2,624,712,238	98,839,516
米ドル	1,309,752,754	-	1,278,446,028	31,306,726
加ドル	23,901,860	-	23,289,280	612,580
メキシコペソ	45,195,040	-	42,632,730	2,562,310
ユーロ	196,253,080	-	193,595,180	2,657,900
英ポンド	566,795,200	-	532,134,900	34,660,300
スイスフラン	78,638,960	-	75,251,200	3,387,760
スウェーデンク ローナ	24,026,240	-	23,939,440	86,800
ノルウェークローネ	51,684,750	-	48,831,900	2,852,850
デンマーククローネ	103,342,950	-	99,394,860	3,948,090
豪ドル	46,986,590	-	44,227,320	2,759,270
ニュージーランド ドル	57,417,530	-	54,720,620	2,696,910
シンガポールドル	219,556,800	-	208,248,780	11,308,020
合計	5,135,803,140	-	4,948,782,165	10,658,057

(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27年 1月13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	382,458,609	-	382,477,785	19,176
合計		382,458,609	-	382,477,785	19,176

(平成28年 1月12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				
	買建	169,535,699	169,535,699	169,715,700	180,001
	売建	344,445,142	168,952,837	344,604,773	159,631
合計		513,980,841	338,488,536	514,320,473	20,370

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成27年 1月13日現在		平成28年 1月12日現在	
1口当たり純資産額	2.5814円	1口当たり純資産額	2.4691円
(1万口当たり純資産額)	(25,814円)	(1万口当たり純資産額)	(24,691円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-0.875%-16/12/31	5,390,000.00	5,396,316.40	
		US TREASURY N/B-0.875%-17/04/30	880,000.00	880,412.50	
		US TREASURY N/B-0.625%-17/11/30	2,020,000.00	2,007,375.00	
		US TREASURY N/B-0.75%-17/12/31	825,000.00	821,390.62	
		US TREASURY N/B-1.5%-18/08/31	3,485,000.00	3,517,944.12	
		US TREASURY N/B-1.625%-19/03/31	690,000.00	697,439.06	
		US TREASURY N/B-1.375%-20/04/30	5,315,000.00	5,287,179.29	
		US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	3,755,000.00	4,031,344.53	
		US TREASURY N/B-1.75%-22/04/30	1,500,000.00	1,490,859.37	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	600,000.00	632,812.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,365,000.00	3,472,522.26	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	770,000.00	760,916.40	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	1,450,000.00	1,429,156.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	100,000.00	129,781.25	
		US TREASURY N/B-3.0%-42/05/15	1,220,000.00	1,242,684.37	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	660,000.00	638,653.12	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	2,025,000.00	2,101,491.21	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	735,000.00	725,869.92	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	470,000.00	535,836.71	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,270,000.00	1,278,929.68	
		36,525,000.00	37,078,914.56		

国債証券小計			(4,367,896,135)
特殊債券	FNGT 2004-T3 1A1-6.0%-44/02/25	24,618.44	28,041.90
	FNR 1999-37 F-0.822%-29/06/25	7,477.03	7,489.42
	FNR 2000-13 F-1.072%-23/09/25	11,653.65	11,728.11
	FNW 2004-W2 5AF-0.772%-44/03/25	24,393.16	24,255.91
	FNW 2004-W8 2A-6.5%-44/06/25	50,161.98	57,051.69
	FSPC T-21 A-0.782%-29/10/25	24,949.56	24,646.22
	FSPC T-61 1A1-1.643%-44/07/25	98,726.12	101,919.38
特殊債券小計		241,979.94	255,132.63 (30,054,623)
社債券	ACTAVIS FUNDING SCS-2.35%-18/03/12	445,000.00	445,201.36
	AIG GLOBAL FUNDING-1.65%-17/12/15	400,000.00	399,223.60
	BANK OF AMERICA CORP-7.625%-19/06/01	400,000.00	463,159.48
	BARCLAYS PLC-3.25%-21/01/12	370,000.00	372,054.12
	BAT INTL FINANCE PLC-2.75%-20/06/15	385,000.00	390,468.15
	CDP FINANCIAL-3.15%-24/07/24	300,000.00	302,174.40
	CHEVRON CORP-1.104%-17/12/05	525,000.00	522,591.77
	CITIGROUP INC-2.05%-18/12/07	500,000.00	497,231.40
	CNOOC FINANCE 2013 LTD-1.125%-16/05/09	515,000.00	514,743.01
	CVS HEALTH CORP-2.8%-20/07/20	321,000.00	324,995.16
	GE CAPITAL INTL FUNDING-2.342%-20/11/15	202,000.00	201,272.19
	GENERAL ELEC CAP CORP-4.65%-21/10/17	72,000.00	79,747.25
	GENERAL ELECTRIC CO-5.25%-17/12/06	500,000.00	535,749.00
	HESS CORP-1.3%-17/06/15	150,000.00	146,362.50
	HJ HEINZ CO-2.8%-20/07/02	140,000.00	140,523.58
	JACKSON NATL LIFE GLOBAL-2.6%-20/12/09	400,000.00	405,062.00
	MET LIFE GLOB FUNDING I-1.3%-17/04/10	600,000.00	600,090.60
	MORGAN STANLEY-2.2%-18/12/07	320,000.00	320,922.04
	NEW YORK LIFE GLOBAL FDG-1.55%-18/11/02	400,000.00	397,242.80
	NGN 2011-R3 1A-0.595%-20/03/11	375,648.67	376,397.03
	NORTHEAST UTILITIES-1.45%-18/05/01	375,000.00	370,461.37
	PEPSICO INC-2.5%-16/05/10	540,000.00	542,925.66
	PHILIP MORRIS INTL INC-2.5%-16/05/16	575,000.00	578,412.45

		PRICOA GLOBAL FUNDING 1-1.35%- 17/08/18	500,000.00	498,238.75	
		PRINCIPAL LFE GLB FND II-2.2%- 20/04/08	251,000.00	249,215.64	
		REYNOLDS AMERICAN INC-2.3%-18/06/12	505,000.00	508,891.12	
		SANTANDER UK GROUP HLDGS-3.125%- 21/01/08	310,000.00	311,316.63	
		SKANDINAVISKA ENSKILDA-2.375%- 19/03/25	500,000.00	502,783.85	
		TRANS-CANADA PIPELINES-0.75%-16/01/15	700,000.00	699,982.43	
		UNITEDHEALTH GROUP INC-1.9%-18/07/16	320,000.00	322,175.87	
		VISA INC-2.8%-22/12/14	350,000.00	353,443.54	
		WM WRIGLEY JR CO-1.4%-16/10/21	180,000.00	180,234.00	
		社債券小計	12,426,648.67	12,553,292.75	(1,478,777,885)
		米ドル小計	49,193,628.61	49,887,339.94	(5,876,728,643)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-19/09/01	295,000.00	307,980.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	895,000.00	987,158.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	660,000.00	994,626.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	170,000.00	233,580.00	
		国債証券小計	2,020,000.00	2,523,344.75	(209,210,513)
	社債券	BANK OF AMERICA CORP-5.15%-17/05/30	440,000.00	460,482.00	
		社債券小計	440,000.00	460,482.00	(38,178,562)
		加ドル小計	2,460,000.00	2,983,826.75	(247,389,075)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-19/12/11	16,416,600.00	16,352,780.46	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	5,368,900.00	5,874,784.60	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	2,759,600.00	3,739,223.50	
		メキシコペソ小計	24,545,100.00	25,966,788.56	(171,121,136)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.5%-17/06/28	690,000.00	728,864.25	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-19/09/28	230,000.00	256,845.60	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	580,000.00	682,608.38	

BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	705,000.00	699,282.45
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	510,000.00	787,424.70
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	115,000.00	160,693.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-16/04/30	1,000,000.00	1,009,950.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.5%-18/01/31	1,035,000.00	1,128,150.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-20/01/31	740,000.00	765,274.69
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%-21/04/30	1,295,000.00	1,606,892.07
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	235,000.00	255,654.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	490,000.00	485,724.99
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	910,000.00	1,298,570.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	105,000.00	128,463.63
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	390,000.00	512,229.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-22/09/04	2,220,000.00	2,424,231.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%-23/08/15	840,000.00	951,524.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	610,000.00	993,613.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	300,000.00	479,467.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	630,000.00	802,114.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-16/08/01	1,525,000.00	1,557,200.37
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.15%-17/05/15	515,000.00	523,180.26
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-19/05/01	1,410,000.00	1,515,016.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-19/08/01	745,000.00	776,978.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.7%-20/05/01	1,195,000.00	1,206,953.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%-	1,335,000.00	1,717,214.90

22/09/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,400,000.00	1,662,556.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	440,000.00	478,266.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,430,000.00	1,689,974.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	635,000.00	792,353.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	355,000.00	501,526.60	
FINNISH GOVERNMENT-4.375%-19/07/04	525,000.00	608,339.18	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-23/04/15	335,000.00	360,918.95	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-19/05/25	1,285,000.00	1,334,391.15	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-19/11/25	2,595,000.00	2,653,629.09	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-20/05/25	445,000.00	445,221.56	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	1,380,000.00	1,560,642.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,185,000.00	2,119,341.83	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	965,000.00	1,457,690.97	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	340,000.00	437,414.51	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	240,000.00	368,050.80	
FRENCH TREASURY NOTE-1.0%-17/07/25	500,000.00	510,295.35	
IRISH TREASURY-4.5%-18/10/18	660,000.00	745,239.00	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	360,000.00	432,952.81	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	40,000.00	38,730.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.25%-19/01/15	1,085,000.00	1,134,063.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	830,000.00	930,901.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	230,000.00	341,092.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	240,000.00	361,878.47	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-17/02/20	435,000.00	452,127.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.15%-18/10/19	455,000.00	473,024.05	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.65%-22/04/20	465,000.00	564,473.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	450,000.00	487,646.18	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	170,000.00	248,924.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	80,000.00	106,380.32	
国債証券小計	40,910,000.00	46,752,170.20	(5,977,732,481)

	特殊債券	EUROPEAN UNION-3.25%-18/04/04	500,000.00	538,912.50	
		FMS WERTMANAGEMENT-0.05%-17/09/19	500,000.00	502,425.00	
特殊債券小計			1,000,000.00	1,041,337.50	(133,145,412)
	社債券	MORGAN STANLEY-4.5%-16/02/23	365,000.00	366,727.54	
		社債券小計	365,000.00	366,727.54	(46,889,783)
ユーロ小計			42,275,000.00	48,160,235.24	(6,157,767,676)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.0%-17/09/07	610,000.00	614,941.00	
		UK TREASURY-1.75%-19/07/22	1,385,000.00	1,423,593.02	
		UK TREASURY-2.0%-20/07/22	1,425,000.00	1,479,107.25	
		UK TREASURY-4.0%-22/03/07	675,000.00	783,126.02	
		UK TREASURY-2.25%-23/09/07	165,000.00	173,098.20	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,245,000.00	1,659,361.89	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	385,000.00	496,700.08	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	415,000.00	472,335.32	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	390,000.00	465,322.56	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	860,000.00	1,128,904.97	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	220,000.00	224,456.47	
	国債証券小計			7,775,000.00	8,920,946.78
	特殊債券	NETWORK RAIL INFRA FIN-1.125%-16/12/15	300,000.00	301,620.00	
		特殊債券小計	300,000.00	301,620.00	(51,706,716)
英ポンド小計			8,075,000.00	9,222,566.78	(1,581,024,622)
スイスフラン	国債証券	SWITZERLAND-2.0%-22/05/25	250,000.00	290,637.25	
		国債証券小計	250,000.00	290,637.25	(34,164,408)
	特殊債券	KFW-2.75%-18/10/11	300,000.00	329,925.00	
		特殊債券小計	300,000.00	329,925.00	(38,782,683)
スイスフラン小計			550,000.00	620,562.25	(72,947,091)

スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-4.25%-19/03/12	2,365,000.00	2,703,455.15		
		SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	1,730,000.00	1,836,827.50		
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,065,000.00	1,053,796.20		
スウェーデンクローナ小計			5,160,000.00	5,594,078.85	(77,142,347)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-4.5%-19/05/22	5,130,000.00	5,785,614.00		
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-23/05/24	1,000,000.00	1,059,752.00		
ノルウェークローネ小計			6,130,000.00	6,845,366.00	(90,358,831)	
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-4.0%-19/11/15	8,975,000.00	10,386,767.50		
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	700,000.00	1,126,265.00		
デンマーククローネ小計			9,675,000.00	11,513,032.50	(197,333,377)	
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.5%-19/10/25	1,820,000.00	2,059,148.00		
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	600,000.00	616,440.00		
ポーランドズロチ小計			2,420,000.00	2,675,588.00	(78,555,263)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-6.0%-17/02/15	400,000.00	417,281.60		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-20/04/15	885,000.00	972,603.49		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	560,000.00	564,956.00		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	235,000.00	250,358.19		
	国債証券小計			2,080,000.00	2,205,199.28	(181,840,732)
	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP-6.0%-16/11/09	500,000.00	514,322.00		
		KFW-5.0%-24/03/19	900,000.00	1,016,544.60		
	特殊債券小計			1,400,000.00	1,530,866.60	(126,235,259)
豪ドル小計			3,480,000.00	3,736,065.88	(308,075,991)	
シンガポール ドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-20/09/01	925,000.00	973,537.71		
シンガポールドル小計			925,000.00	973,537.71	(79,927,445)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-5.734%-19/07/30	2,500,000.00	2,685,650.00		

マレーシアリングット小計			2,500,000.00	2,685,650.00 (72,055,989)	
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	8,215,000.00	6,956,162.15	
南アフリカランド小計			8,215,000.00	6,956,162.15 (48,762,696)	
合計				15,059,190,182 (15,059,190,182)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 20銘柄	74.3%	29.0%
	特殊債券 7銘柄	0.5%	0.2%
	社債券 32銘柄	25.2%	9.8%
加ドル	国債証券 4銘柄	84.6%	1.4%
	社債券 1銘柄	15.4%	0.3%
メキシコペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 55銘柄	97.0%	39.8%
	特殊債券 2銘柄	2.2%	0.9%
	社債券 1銘柄	0.8%	0.3%
英ポンド	国債証券 11銘柄	96.7%	10.2%
	特殊債券 1銘柄	3.3%	0.3%
スイスフラン	国債証券 1銘柄	46.8%	0.2%
	特殊債券 1銘柄	53.2%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.6%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	1.3%
ポーランドズロチ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 4銘柄	59.0%	1.2%
	特殊債券 2銘柄	41.0%	0.8%
シンガポールドル	国債証券 1銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 1銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 1銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2016年 1月29日現在です。

【GW7つの卵】

【純資産額計算書】

資産総額	70,715,650,585円
負債総額	103,160,145円
純資産総額(-)	70,612,490,440円
発行済口数	68,685,362,929口
1口当たり純資産額(/)	1.0281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	32,775,332,389円
負債総額	円
純資産総額(-)	32,775,332,389円
発行済口数	18,059,405,810口
1口当たり純資産額(/)	1.8149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	13,093,619,133円
負債総額	5,302,529円
純資産総額(-)	13,088,316,604円
発行済口数	3,200,515,934口
1口当たり純資産額(/)	4.0894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	29,666,712,469円
負債総額	182,789,363円
純資産総額（ - ）	29,483,923,106円
発行済口数	22,105,002,866口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3338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	32,280,965,633円
負債総額	32,306,855円
純資産総額（ - ）	32,248,658,778円
発行済口数	15,910,254,291口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0269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	24,226,983,285円
負債総額	249,596,299円
純資産総額（ - ）	23,977,386,986円
発行済口数	8,582,454,183口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7938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	7,503,606,618円
負債総額	3,988,036円
純資産総額（ - ）	7,499,618,582円
発行済口数	1,527,114,891口
1口当たり純資産額（ / ）	4.9110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	16,026,485,055円
負債総額	119,185,357円
純資産総額（ - ）	15,907,299,698円
発行済口数	6,197,097,686口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5669円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

（5）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

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】

(1) 資本金の額

平成28年1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：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成28年1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28年1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. 運用状況の評価・分析および運用リスク管理、ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、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】

- ・「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28年1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	603	111,670

株式投資信託		548	88,038
単位型		102	2,841
追加型		446	85,196
公社債投資信託		55	23,632
単位型		39	384
追加型		16	23,248

3【委託会社等の経理状況】

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。

また、当社の中間財務諸表は、「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条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第57期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	(単位:百万円)			
	第55期 (平成26年3月31日)		第56期 (平成27年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	17,805	3	14,206
有価証券		234		277
前払費用	3	419	3	509
未収入金		37		3
未収委託者報酬		7,162		8,441
未収収益	3	608	3	1,566
関係会社短期貸付金		240		436
立替金		303		666
繰延税金資産		984		1,446
その他	2	30	2	195
流動資産合計		27,826		27,750
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	47	1	56
器具備品	1	134	1	166
有形固定資産合計		181		222
無形固定資産				
ソフトウェア		91		113
無形固定資産合計		91		113

投資その他の資産		
投資有価証券	7,290	14,184
関係会社株式	21,702	21,702
関係会社長期貸付金	60	60
長期差入保証金	692	740
長期前払費用	-	0
繰延税金資産	525	248
投資その他の資産合計	30,271	36,936
固定資産合計	30,544	37,273
資産合計	58,371	65,023

(単位：百万円)

	第55期 (平成26年3月31日)		第56期 (平成27年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金	329		387
未払金	3,404		5,545
未払収益分配金	6		6
未払償還金	112		112
未払手数料	3	2,743	3
その他未払金		542	
未払費用	3	3,239	3
未払法人税等		2,286	
未払消費税等	4	356	4
賞与引当金		1,935	
役員賞与引当金		150	
その他		-	3
流動負債合計	11,702		14,646
固定負債			
退職給付引当金		1,081	
その他		55	
固定負債合計		1,137	
負債合計	12,840		15,758
純資産の部			
株主資本			
資本金		17,363	
資本剰余金			
資本準備金		5,220	
資本剰余金合計		5,220	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		22,694	
利益剰余金合計		22,694	
自己株式		68	
株主資本合計		45,209	

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	321	1,002
繰延ヘッジ損益	-	88
評価・換算差額等合計	321	913
純資産合計	45,531	49,265
負債純資産合計	58,371	65,023

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,120	63,990
その他営業収益	2,557	3,729
営業収益合計	65,678	67,719
営業費用		
支払手数料	31,207	30,408
広告宣伝費	1,081	1,045
公告費	2	5
調査費	13,405	15,571
調査費	712	747
委託調査費	12,669	14,782
図書費	23	41
委託計算費	465	502
営業雑経費	558	660
通信費	186	199
印刷費	252	263
協会費	43	64
諸会費	11	27
その他	65	106
営業費用計	46,721	48,193
一般管理費		
給料	7,171	7,585
役員報酬	316	289
役員賞与引当金繰入額	150	120
給料・手当	4,719	5,127
賞与	50	59
賞与引当金繰入額	1,935	1,990
交際費	108	163
寄付金	54	36
旅費交通費	448	503
租税公課	209	208
不動産賃借料	755	785
退職給付費用	313	349
退職金	32	16
固定資産減価償却費	109	148
福利費	847	908
諸経費	2,517	2,673
一般管理費計	12,568	13,380
営業利益	6,388	6,146

(単位：百万円)

	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		17		10
受取配当金	1	1,774	1	1,152
有価証券償還益		-		13
時効成立分配金・償還金		4		1
為替差益		26		-
その他		19		107
営業外収益合計		1,842		1,285
営業外費用				
支払利息		19		28
有価証券償還損		-		81
デリバティブ費用		-		269
時効成立後支払分配金・償還金		22		295
支払源泉所得税		57		71
為替差損		-		26
その他		13		21
営業外費用合計		114		795
経常利益		8,116		6,636
特別利益				
投資有価証券売却益		135		270
特別利益合計		135		270
特別損失				
投資有価証券売却損		12		22
関係会社株式評価損		4,500		-
固定資産処分損		0		0
割増退職金		59		243
役員退職一時金		235		-
外国税関連費用		-	2	1,650
特別損失合計		4,807		1,916
税引前当期純利益		3,445		4,991
法人税、住民税及び事業税		3,020		2,356
法人税等調整額		119		466
法人税等合計		2,900		1,890
当期純利益		544		3,101

(3) 【株主資本等変動計算書】

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	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金	利益剰余金合計	自己株式	株主資本合計
				繰越利益剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	23,530	23,530	68	46,045
会計方針の変更による累積的影響額							-
会計方針の変更を反映した当期首残高	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
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	362	362	46,408
会計方針の変更による累積的影響額		-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	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

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27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	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,694	22,694	68	45,209
会計方針の変更による累積的影響額				41	41		41
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,735	22,735	68	45,250
当期変動額							
当期純利益				3,101	3,101		3,101
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							

当期変動額合計	-	-	-	3,101	3,101	-	3,101
当期末残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	321	-	321	45,531
会計方針の変更による累積的影響額			-	41
会計方針の変更を反映した当期首残高	321	-	321	45,572
当期変動額				
当期純利益				3,101
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	680	88	591	591
当期変動額合計	680	88	591	3,692
当期末残高	1,002	88	913	49,265

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(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</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(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～15年 器具備品 4年～20年</p> <p>(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。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p>

	<p>(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、給付算定式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。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>

(会計方針の変更)

<p>第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p>
<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、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について当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を平均残存勤務年数に対応した高格付社債の流通利回りを基礎とする方法から退職給付の支払見込期間及び期間毎の金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更いたしました。</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い、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。</p> <p>この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が63百万円減少、繰延税金資産が22百万円減少、繰越利益剰余金が41百万円増加しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益への影響は軽微であります。なお、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益金額に対する影響額は、軽微であります。</p>

(表示方法の変更)

<p>第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)</p>
<p>(損益計算書関係)</p> <p>前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「福利費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。</p> <p>この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた3,364百万円は、「福利費」847百万円、「諸経費」2,517百万円として組み替えております。</p>

（貸借対照表関係）

第55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,091百万円</p> <p>器具備品 625百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他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。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 6,249百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 74百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 98百万円</p> <p>未払費用 274百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>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</p> <p>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>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,122百万円</p> <p>器具備品 679百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち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。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 4,256百万円</p> <p>前払費用 2百万円</p> <p>未収収益 110百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払手数料 108百万円</p> <p>未払費用 500百万円</p> <p>その他 57百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>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</p> <p>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27百万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842百万円に対して保証を行っております。</p>

（損益計算書関係）

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27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> <p>受取配当金 1,290百万円</p>	<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> <p>受取配当金 719百万円</p> <p>2 外国税関連費用1,650百万円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成21年11月17日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算したものであります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株マザーファンド」及び「中国A株CSI300インデックスマザーファンド」の2ファンドであり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社が負担しております。</p>
--	--

(株主資本等変動計算書関係)

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。

第56期（自 平成26年4月1日 至 平成27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	15,902,700	-	-	15,902,700	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	-	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	5,388,900	-	359,700	5,029,200	-
合計		28,124,300	-	3,314,900	24,809,400	-

- (注) 1 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。なお、当該新株予約権は平成27年2月8日に失効いたしました。
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株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500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

該当事項はありません。

- (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27年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	850	4.32	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(リース取引関係)

第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	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
1年内 751百万円	1年内 841百万円
1年超 77百万円	1年超 3,420百万円
合計 828百万円	合計 4,261百万円

(金融商品関係)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、

当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、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及び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又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。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシドマネ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が、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」4「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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、預金の預入れやデリバティブ取引を行う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、又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、有価証券及び投資有価証券以外の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、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)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・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。

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・維持すること等により、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27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(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	14,206	14,206	-
(2) 未収委託者報酬	8,441	8,441	-
(3) 未収収益	1,566	1,566	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,431	14,431	-
(5) 未払金	(5,545)	(5,545)	-
(6) 未払費用	(4,636)	(4,636)	-
(7) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(25)	(25)	-
ヘッジ会計が適用されているもの デリバティブ取引計	(57) (82)	(57) (82)	- -

(1) 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。

(2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(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。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上、流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額30百万円)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	14,206	-	-	-
未収委託者報酬	8,441	-	-	-
未収収益	1,566	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	277	1,219	3,205	1,232
合計	24,492	1,219	3,205	1,232

(有価証券関係)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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	12,839	11,293	1,546
	小計	12,839	11,293	1,546
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,591	1,656	64
	小計	1,591	1,656	64
合計		14,431	12,949	1,482

(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 30百万円）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
投資信託	3,661	270	22
合計	3,661	270	22

（デリバティブ取引関係）

第55期(平成26年3月31日)

該当事項はありません。

第56期(平成27年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等のうち 1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	2,337	-	25	25
	買建	-	-	-	-
合計		2,337	-	25	25

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理方	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価	2,586	-	68

法	豪ドル	証券	276	-	8
	シンガポールドル		878	-	4
	ユーロ		219	-	1
合計			3,961	-	57

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第55期 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)		第56期 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27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	3,065	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,078
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	7,660	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,396
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,379	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,720

(退職給付関係)

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

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,101
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
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
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
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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、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

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,174
会計方針の変更による累積的影響額	63
会計方針の変更を反映した期首残高	1,110
勤務費用	126
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	47
退職給付の支払額	59
退職給付債務の期末残高	1,233

(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	1,233
未積立退職給付債務	1,233
未認識数理計算上の差異	121
貸借対照表に計上された負債の額	1,111

退職給付引当金	1,111
貸借対照表に計上された負債の額	1,111

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	126
利息費用	7
数理計算上の差異の費用処理額	18
確定給付制度に係る退職給付費用	152

(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 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、196百万円でありました。

（ストックオプション等関係）

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 ストック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56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(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	15,902,700	1,567,500
付与	0	0
失効	0	0
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	5,388,900
付与	0	0
失効	0	359,700
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	5,029,200
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55期 (平成26年 3 月31日)	第56期 (平成27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	689	賞与引当金	658
その他	294	その他	813
小計	984	小計	1,472
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	148	投資有価証券評価損	134
関係会社株式評価損	1,665	関係会社株式評価損	1,510
退職給付引当金	385	退職給付引当金	360
固定資産減価償却費	158	固定資産減価償却費	133
その他	34	その他	73
小計	2,391	小計	2,213
繰延税金資産小計	3,375	繰延税金資産小計	3,685
評価性引当金	1,665	評価性引当金	1,510
繰延税金資産合計	1,710	繰延税金資産合計	2,174
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(流動)	
その他有価証券評価差額金	200	その他有価証券評価差額金	25
繰延税金負債合計	200	小計	25
繰延税金資産の純額	1,510	繰延税金負債(固定)	
		その他有価証券評価差額金	454
		小計	454
		繰延税金負債合計	480
		繰延税金資産の純額	1,694
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	38.0%	法定実効税率	35.6%
(調整)		(調整)	
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	1.3%
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	4.3%
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	3.6%
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	1.7%
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	37.9%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	84.2%		

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)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。

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)の施行に伴い平成26年4月1日に開始する事業年度から、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.3%となります。この結果、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135百万円、繰延ヘッジ損益が4百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が48百万円、法人税等調整額が179百万円、それぞれ増加しております。

(関連当事者情報)

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

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社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 ドル貨 建) (注1)	184 (千 SGD 2,059) (注2)	関係 会社 短期 貸付 金	436 (千 SGD 5,000)
							貸付金 利息 (シンガ ポール ドル貨 建) (注1)	7 (千 SGD 92)	未収 収益	7 (千 SGD 82)

(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184百万円(2,059千 SGD)の内訳は、貸付424百万円(5,000千 SGD)及び返済240百万円(2,940千 SGD)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26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	23,832百万円
負債合計	6,549百万円
純資産合計	17,283百万円
営業収益	15,406百万円
税引前当期純利益	4,977百万円
当期純利益	3,441百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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す。

(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56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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す。

(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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

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。

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	231円23銭	250円20銭
1株当たり当期純利益金額	2円76銭	15円74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55期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	544	3,101
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)	544	3,101
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) 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	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、 平成23年度ストックオプション(1) 5,029,200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55期 (平成26年3月31日)	第56期 (平成27年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	45,531	49,265
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）	45,531	49,265
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。

中間財務諸表等

（1）中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		13,390
金銭の信託		99
有価証券		87
未収委託者報酬		7,326
未収収益		1,121
関係会社短期貸付金		5,925
繰延税金資産		436
その他	2	2,325
流動資産合計		30,712
固定資産		
有形固定資産	1	364
無形固定資産		122
投資その他の資産		
投資有価証券		13,748
関係会社株式		21,702
関係会社長期貸付金		60
長期差入保証金		775
繰延税金資産		546
その他		0
投資その他の資産合計		36,834
固定資産合計		37,321
資産合計		68,033

(単位：百万円)

		第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,051

未払費用		4,163
未払法人税等		52
未払消費税等	3	457
関係会社短期借入金		5,997
賞与引当金		976
役員賞与引当金		115
その他		708
流動負債合計		16,521
固定負債		
退職給付引当金		1,130
固定負債合計		1,130
負債合計		17,652
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		28,043
利益剰余金合計		28,043
自己株式		502
株主資本合計		50,124
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		310
繰延ヘッジ損益		53
評価・換算差額等合計		257
純資産合計		50,381
負債純資産合計		68,033

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第57期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		33,707
その他営業収益		1,944
営業収益合計		35,652
営業費用及び一般管理費	1	32,417
営業利益		3,235
営業外収益	2	2,115
営業外費用	3	1,200
経常利益		4,150
特別利益	4	504

特別損失	5	510
税引前中間純利益		4,145
法人税、住民税及び事業税		60
法人税等調整額		1,026
中間純利益		3,058

(3) 中間株主資本等変動計算書

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		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	25,836	25,836	68	48,351
当中間期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
中間純利益				3,058	3,058		3,058
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計				2,207	2,207	434	1,772
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	28,043	28,043	502	50,124

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有 価証券評 価差額金	繰延 ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,002	88	913	49,265
当中間期変動額				
剰余金の配当				850
中間純利益				3,058
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	692	35	656	656
当中間期変動額合計	692	35	656	1,116
当中間期末残高	310	53	257	50,381

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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

	<p>その他有価証券 時価のあるもの 中間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</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、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。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>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。</p>
4 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
5 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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、当中間会計期間の費用として処理してあります。</p>

(会計方針の変更)

第57期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

（企業結合に関する会計基準等の適用）

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。）及び「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。）等を当中間会計期間から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当中間会計期間の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する中間会計期間の中間財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項（4）及び事業分離等会計基準第57 - 4項（4）に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

第57期中間会計期間 (平成27年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,748百万円
2	信託資産 流動資産のその他のうち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。
3	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。
4	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6百万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779百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	59百万円
	無形固定資産	22百万円
2	営業外収益のうち主要なもの	
	受取利息	25百万円
	受取配当金	1,271百万円
	デリバティブ収益	816百万円
3	営業外費用のうち主要なもの	
	支払利息	63百万円
	デリバティブ費用	907百万円
	支払源泉所得税	119百万円
4	特別利益のうち主要なもの	
	投資有価証券売却益	504百万円
5	特別損失のうち主要なもの	
	特別賞与	348百万円
	割増退職金	91百万円
	役員退職一時金	64百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第57期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	109,600	704,500	-	814,100

（注）自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

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)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
平成21年度ストックオプション(1)	普通株式	15,902,700	-	10,282,800	5,619,900	-
平成21年度ストックオプション(2)	普通株式	1,567,500	-	587,400	980,100	-
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	-	-
平成23年度ストックオプション(1)	普通株式	5,029,200	-	290,400	4,738,800	-
合計		24,809,400	-	13,470,600	11,338,800	-

（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)、平成22年度ストックオプション(1)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 平成21年度ストックオプション(1)5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2)980,100株及び平成23年度ストックオプション(1)4,075,500株は、当中間会計期間末現在、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27年5月25日 取締役会	普通株式	850	4.32	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
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	
1年内	853百万円
1年超	3,047百万円
合計	3,900百万円

(金融商品関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

1 金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日(当中間決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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)

	中間貸借対照表 計上額(1)	時価(1)	差額
(1) 現金・預金	13,390	13,390	-
(2) 未収委託者報酬	7,326	7,326	-
(3) 未収収益	1,121	1,121	-
(4) 金銭の信託	99	99	-
(5) 関係会社短期貸付金	5,925	5,925	-
(6) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,819	13,819	-
(7) 未払金	(4,051)	(4,051)	-
(8) 未払費用	(4,163)	(4,163)	-
(9) 関係会社短期借入金	(5,997)	(5,997)	-
(10) デリバティブ取引(2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(120)	(120)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	169	169	-
デリバティブ取引計	48	48	-

(1) 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。

(2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(5) 関係会社短期貸付金

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

(4) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は金融商品取引所が定める清算指数、為替予約取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(6) 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。

(7) 未払金、(8) 未払費用並びに(9) 関係会社短期借入金

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

(10) デリバティブ取引

（デリバティブ取引関係）注記を参照ください。なお、上記金額は貸借対照表上、流動資産のその他及び流動負債のその他に含まれております。

2 非上場株式等（中間貸借対照表計上額16百万円）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、「(5) 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（中間貸借対照表計上額18,809百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額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。

（有価証券関係）

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
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	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	7,923	7,062	860
	小計	7,923	7,062	860
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	5,896	6,298	402
	小計	5,896	6,298	402
合計		13,819	13,361	458

(注) 1 減損処理にあたっては、中間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。当中間会計期間については、該当ございません。

2 非上場株式等(中間貸借対照表計上額16百万円)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。

(デリバティブ取引関係)

第57期中間会計期間(平成27年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	4,686	-	49	49
合計		4,686	-	49	49

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	為替予約取引 買建 米ドル	5,997	-	170	170
合計		5,997	-	170	170

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ 対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		4,550	-	148
	豪ドル		219	-	21
	シンガポールドル		738	-	57
	ユーロ		194	-	0
	香港ドル		178	-	5
	人民元		2,155	-	63
合計			8,035	-	169

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	3,071百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,269百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,461百万円

(ストックオプション等関係)

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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す。

(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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30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57期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

該当事項はありません。

（ 1 株当たり情報 ）

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1株当たり純資産額	256円79銭
1株当たり中間純利益金額	15円54銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等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株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第57期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
中間純利益（百万円）	3,058
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-
普通株式に係る中間純利益（百万円）	3,058
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,730
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間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) 5,619,900株、平成21年度ストックオプション(2) 980,100株、平成23年度ストックオプション(1) 4,738,800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57期中間会計期間 (平成27年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	50,381
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	50,381
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	196,198

（ 重要な後発事象 ）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)に

において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成27年9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。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成27年9月末現在)	事業の内容
あかつき証券株式会社	3,065百万円	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TT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	
SMB C日興証券株式会社	10,000百万円	
SMB Cフレンド証券株式会社	27,270百万円	
株式会社SBI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	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
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TT証券株式会社	1,575百万円	
日産証券株式会社	1,500百万円	
野村証券株式会社	10,000百万円	
浜銀TT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	1	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	1	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
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		13,016百万円
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

銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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。
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。

(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	802百万米ドル (平成26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27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27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	9億米ドル 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27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27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	5,077万シンガポールドル (平成27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27年9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27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27年9月末現在)	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。

(3) 投資顧問会社

・委託会社から、マザーファンドの運用指図権限の委託を受け当該ファンドの運用(投資一任)を行いません。

JPMorgan・アセット・マネジメント株式会社

スパークス・アセット・マネジメント株式会社

三井住友信託銀行株式会社

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー

MFSインターナショナル(U.K.)リミテッド

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

ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー

- ・各マザーファンドの適切な組入比率の投資助言および投資顧問会社の評価・選定などに関する情報提供や助言などを行ないます。

日興グローバルラップ株式会社

- ・各マザーファンドの投資顧問会社の評価・選定などに関する情報提供や助言などを行ないます。

日興アセットマネジメント アメリカズ・インク

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(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27年9月末現在)

(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27年9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27年9月末現在)

第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を使用します。

- (2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。

請求目論見書の入手方法(ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど)についての記載。

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記

載することがあります。

- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。

投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独立監査人の監査報告書

平成27年6月15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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56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27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注)1.上記は、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。

独立監査人の監査報告書

平成28年2月10日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PWCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定社員 公認会計士 辻村 和之
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27年1月14日から平成28年1月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、GW7つの卵の平成28年1月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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、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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月4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 竹 内 知 明
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27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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、日興アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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。