

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年10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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので平成28年 4月12日付をもって提出しました有価証券届出書（平成28年6月24日付で有価証券届出書の訂正届出書を提出済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。また、原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」に「中間財務諸表」の記載事項が追加されます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

1

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

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

2

7つの資産は、それぞれの分野に強みをもつスペシャリストが運用します。

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

3

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

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

*最終的な運用アドバイザーの決定は、日興GWに加えて日興アセットマネジメントアメリカズ・インク(NAMアメリカズ)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。



[基本ポートフォリオ]
2016年10月13日現在



分散投資効果をもとめるため、日本株式を大型・小型に分類し、海外株式を地域分割するなど、投資対象資産を7つに細分化しています。

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

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

株式や債券などの資産には、値動きがあります。

株式は景気上昇期に値上がりする傾向があるのに対し、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	
株 式	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
債 券	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 アメリカズからの情報提供や助言をもとに、日興アセットマネジメントが行ないます。

日興GW：日興グローバルラップ株式会社

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

NAM アメリカズ：日興アセットマネジメント アメリカズ・インク

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

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

運用アドバイザーについて

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

●JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社

世界最大級の総合金融サービスグループの資産運用会社

「JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーの資産運用部門」「JPモルガン・アセット・マネジメント」グループの一員で、グループ全体での運用資産総額は約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)。

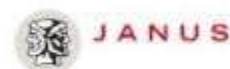


北米株式グローバル・ラップマザーファンド

●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、米国投信の差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

●ウェリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー

機関投資家向け運用サービスに特化した独立系運用会社

自社ブランドでの投信販売は行わず、運用業務に専念。世界の機関投資家に運用サービスを提供し、グループ全体の運用資産額は約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)*1
- 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)*2
- 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)*3
- 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)*3
- 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)*3
- 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)*4
- 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)*3

*1 現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、2017年1月1日付で「ラッセル野村大型インデックス」に変更する予定です。

*2 現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、2017年1月1日付で「ラッセル野村小型インデックス」に変更する予定です。

*3 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。

*4 現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、2017年1月1日付で「NOMURA-BPI総合」に変更する予定です。

※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SMB C日興証券株式会社に帰属します。また、SMB 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。

<2017年1月1日以降>

※ラッセル野村大型インデックスおよびラッセル野村小型インデックスの知的財産権およびその他一切の権利は野村證券株式会社およびFrank Russell Companyに帰属します。なお、野村證券株式会社およびFrank Russell Companyは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

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

情報提供サービスを充実させています。

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



マンスリーレポート
(原則毎月9営業日目作成)



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。

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

委託会社の概況(平成28年7月末現在)

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
昭和34年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
平成11年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<更新後>

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。

* 現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、平成29年1月1日付で「ラッセル野村大型インデックス」に変更する予定です。

<平成29年1月1日以降>

* ラッセル野村大型インデックスの知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社及びFrank Russell Companyに帰属します。なお、野村証券株式会社及びFrank Russell Companyは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

<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。

* 現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、平成29年1月1日付で「ラッセル野村小型インデックス」に変更する予定です。

<平成29年1月1日以降>

* ラッセル野村小型インデックスの知的財産権およびその他一切の権利は野村證券株式会社及びFrank Russell Companyに帰属します。なお、野村證券株式会社及びFrank Russell Companyは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

<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いません。
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。

* 現在のベンチマーク指数の公表停止に伴ない、平成29年1月1日付で「NOMURA BPI総合」に変更する予定です。

<平成29年1月1日以降>

* NOMURA BPI総合は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

<北米株式グローバル・ラップマザーファンド>

(略)

<欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド>

(略)

<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>

(略)

<海外債券グローバル・ラップマザーファンド>

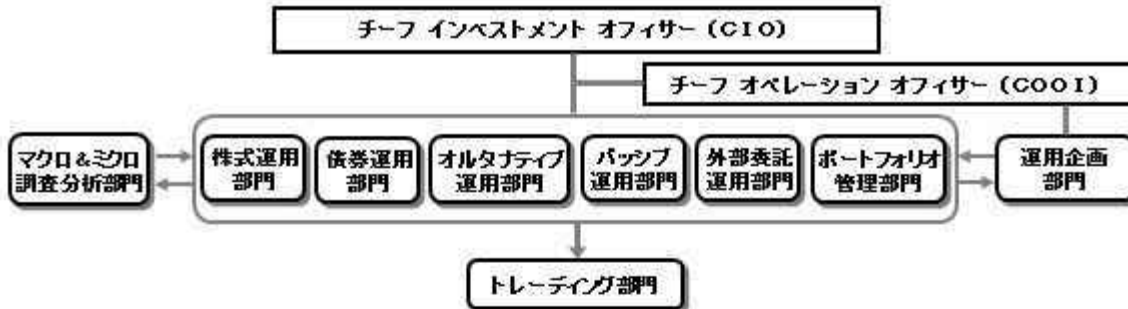
(略)

(3) 【運用体制】

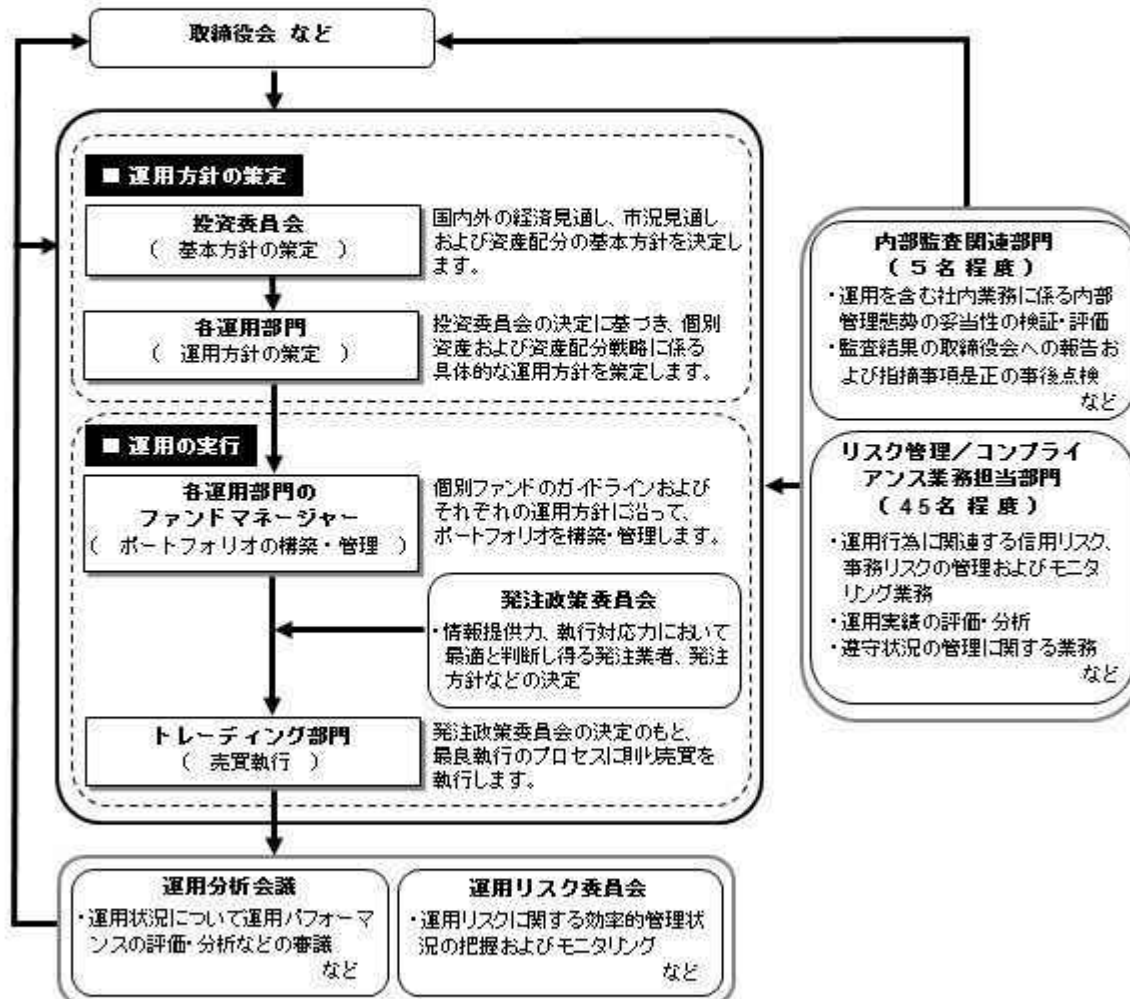
< 更新後 >

< 日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）における運用体制 >

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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

**委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制**

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

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

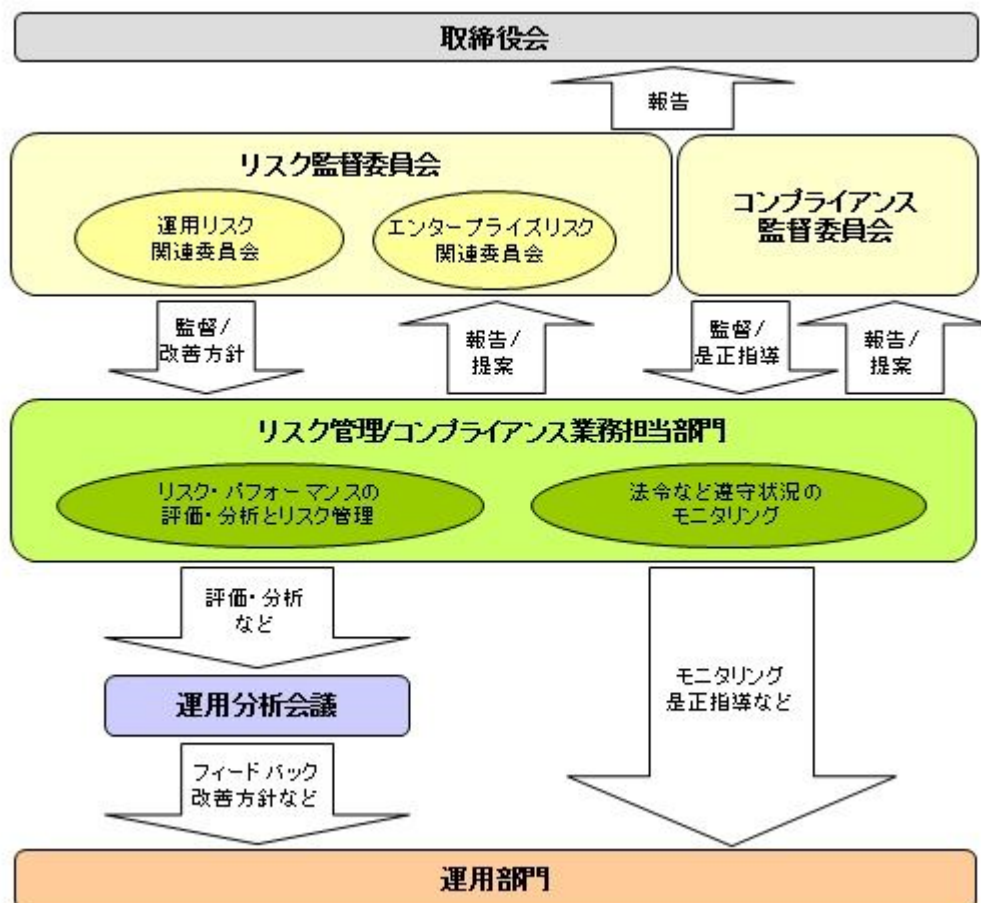
上記体制は平成28年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

< 更新後 >

(2) リスク管理体制

<日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制>



全社的リスク管理

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

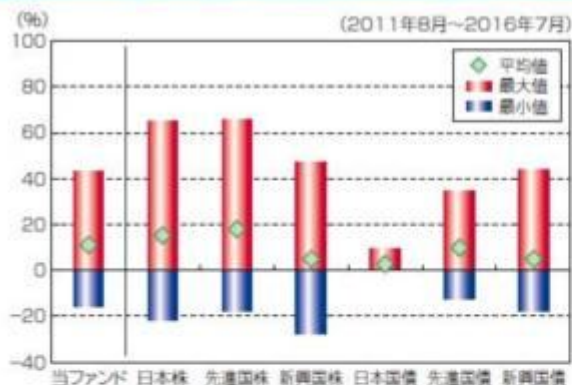
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は平成28年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<更新後>

(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	11.1%	15.2%	18.0%	5.0%	2.8%	9.9%	4.9%
最大値	42.9%	65.0%	65.7%	47.4%	9.3%	34.9%	43.7%
最小値	-16.0%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	0.4%	-12.3%	-17.4%

※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8月から2016年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・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)を再投資したもとして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8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)を再投資したもとして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-BPI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・ティバー・シファイド(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-BPI国債

当指数は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、上場株式等の譲渡益、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)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)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、未成年者少額投資非課税制度(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

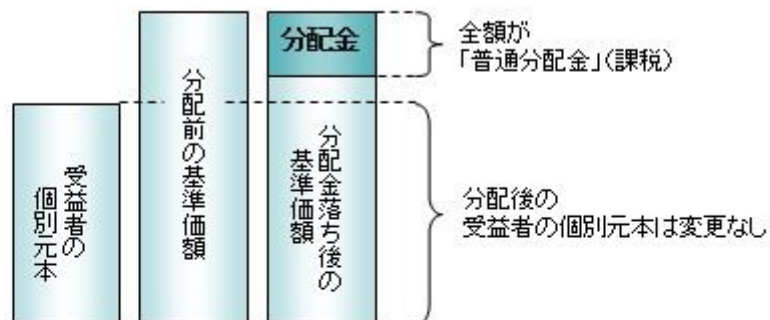
値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

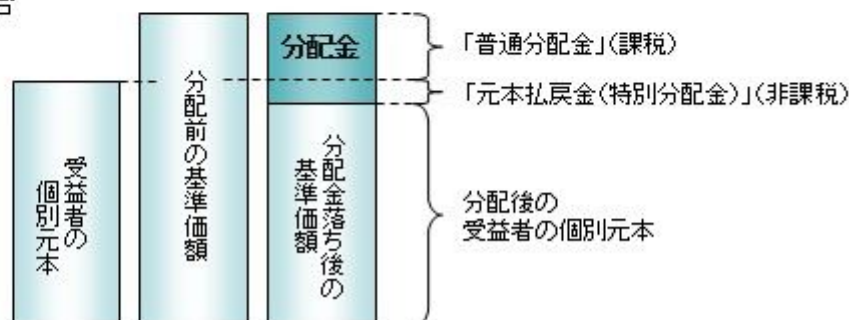
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - 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10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7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	64,331,565,079	99.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		643,601,978	0.99
合計(純資産総額)		64,975,167,057	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	8,933,056,704	1.7599	15,721,286,494	1.6924	15,118,305,165	23.27
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	6,395,047,508	2.0151	12,886,660,234	2.0220	12,930,786,061	19.90
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	8,041,141,123	1.3261	10,663,357,244	1.3987	11,247,144,088	17.31
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	3,784,063,539	2.7208	10,295,680,077	2.5525	9,658,822,183	14.87
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	2,858,730,761	2.4553	7,019,041,638	2.3255	6,647,978,384	10.23
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	1,362,725,268	3.9708	5,411,109,495	4.0620	5,535,390,038	8.52
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	634,024,812	4.7993	3,042,875,281	5.0363	3,193,139,160	4.91

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第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 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	
	2月末日	66,558		0.9758	
	3月末日	68,918		1.0150	
	4月末日	68,208		1.0118	
	5月末日	68,795		1.0295	
	6月末日	62,707		0.9478	
	7月末日	64,975		0.9903	

【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
当中間期	2016年 1月13日～2016年 7月12日	

【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
当中間期	2016年 1月13日～2016年 7月12日	4.51

(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
当中間期	2016年 1月13日～2016年 7月12日	1,539,703,233	3,521,399,585

（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 7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	33,039,821,880	98.92
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		360,373,061	1.08
合計（純資産総額）		33,400,194,941	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	261,200	6,013.56	1,570,741,872	5,894.00	1,539,512,800	4.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	289,900	4,909.51	1,423,268,400	4,881.00	1,415,001,900	4.24
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,242,600	528.59	1,185,415,934	522.00	1,170,637,200	3.50
日本	株式	日本電産	電気機器	108,300	8,024.77	869,082,591	9,435.00	1,021,810,500	3.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	305,300	3,049.79	931,100,887	2,841.50	867,509,950	2.60
日本	株式	キーエンス	電気機器	11,500	60,285.89	693,287,735	72,920.00	838,580,000	2.51
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	163,700	4,188.74	685,697,863	4,894.00	801,147,800	2.40
日本	株式	ソニー	電気機器	236,600	2,913.23	689,270,218	3,282.00	776,521,200	2.32
日本	株式	協和発酵キリン	医薬品	384,600	1,816.72	698,712,120	1,803.00	693,433,800	2.08
日本	株式	スズキ	輸送用機器	216,200	2,978.42	643,934,404	3,188.00	689,245,600	2.06
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	113,100	5,623.68	636,038,208	5,703.00	645,009,300	1.93
日本	株式	ダイキン工業	機械	67,800	8,367.98	567,349,044	9,012.00	611,013,600	1.83
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	148,800	4,633.80	689,509,440	4,025.00	598,920,000	1.79
日本	株式	電通	サービス業	116,800	5,536.78	646,695,904	4,950.00	578,160,000	1.73
日本	株式	三菱商事	卸売業	324,200	1,949.38	631,988,996	1,778.50	576,589,700	1.73
日本	株式	オリンパス	精密機器	146,300	4,219.78	617,355,184	3,580.00	523,754,000	1.57
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	54,000	10,009.65	540,521,100	9,485.00	512,190,000	1.53
日本	株式	オリックス	その他金融業	343,900	1,593.14	547,880,846	1,464.00	503,469,600	1.51
日本	株式	味の素	食料品	184,100	2,682.53	493,853,773	2,638.50	485,747,850	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	145,200	3,483.55	505,811,460	3,308.00	480,321,600	1.44
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	163,500	3,197.21	522,743,835	2,899.00	473,986,500	1.42
日本	株式	ニトリホールディングス	小売業	37,000	10,018.34	370,678,580	12,740.00	471,380,000	1.41
日本	株式	KDDI	情報・通信業	147,500	3,100.56	457,332,600	3,145.00	463,887,500	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	111,400	3,527.38	392,950,132	4,040.00	450,056,000	1.35
日本	株式	日立製作所	電気機器	882,000	521.87	460,289,340	476.50	420,273,000	1.26
日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	164,200	2,289.36	375,912,912	2,528.50	415,179,700	1.24
日本	株式	日本航空	空運業	127,800	4,118.16	526,300,848	3,196.00	408,448,800	1.22
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	112,600	3,533.94	397,922,754	3,601.00	405,472,600	1.21
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	60,700	7,932.25	481,487,778	6,510.00	395,157,000	1.18
日本	株式	ディー・エヌ・エー	サービス業	148,000	2,005.40	296,800,609	2,648.00	391,904,000	1.17

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	3.32
		食料品	5.99

化学	4.94
医薬品	5.94
ゴム製品	1.21
ガラス・土石製品	0.72
鉄鋼	1.01
非鉄金属	2.06
機械	3.56
電気機器	11.84
輸送用機器	11.48
精密機器	2.07
その他製品	1.32
電気・ガス業	1.67
陸運業	3.64
海運業	0.44
空運業	1.22
情報・通信業	9.37
卸売業	3.45
小売業	5.58
銀行業	7.00
証券、商品先物取引業	0.33
保険業	2.35
その他金融業	1.51
不動産業	2.30
サービス業	4.59
合 計	98.92

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 7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	11,781,364,300	96.54
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		422,118,154	3.46

合計(純資産総額)	12,203,482,454	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	エレコム	電気機器	138,300	1,855.00	256,546,500	2,375.00	328,462,500	2.69
日本	株式	TOWA	機械	261,100	718.00	187,469,800	1,129.00	294,781,900	2.42
日本	株式	岡村製作所	その他製品	244,600	1,072.00	262,211,200	1,068.00	261,232,800	2.14
日本	株式	アイチ コーポレーション	機械	305,300	763.00	232,943,900	823.00	251,261,900	2.06
日本	株式	日本ユニシス	情報・通信業	177,900	1,447.00	257,421,300	1,405.00	249,949,500	2.05
日本	株式	阪和興業	卸売業	443,000	486.00	215,298,000	554.00	245,422,000	2.01
日本	株式	トラスコ中山	卸売業	47,100	4,435.00	208,888,500	5,160.00	243,036,000	1.99
日本	株式	オープンハウス	不動産業	79,600	2,078.00	165,408,800	2,949.00	234,740,400	1.92
日本	株式	東洋紡	繊維製品	1,164,000	171.00	199,044,000	195.00	226,980,000	1.86
日本	株式	アネスト岩田	機械	232,600	1,055.00	245,393,000	969.00	225,389,400	1.85
日本	株式	電通国際情報サービス	情報・通信業	109,000	2,259.00	246,231,000	2,023.00	220,507,000	1.81
日本	株式	アニコム ホールディングス	保険業	79,300	3,035.00	240,675,500	2,773.00	219,898,900	1.80
日本	株式	デジタルガレージ	情報・通信業	112,200	1,968.30	220,843,268	1,956.00	219,463,200	1.80
日本	株式	D C Mホールディングス	小売業	246,400	818.16	201,596,205	880.00	216,832,000	1.78
日本	株式	ニチユ三菱フォークリフト	輸送用機器	382,200	459.00	175,429,800	555.00	212,121,000	1.74
日本	株式	エス・エム・エス	サービス業	83,000	2,105.00	174,715,000	2,426.00	201,358,000	1.65
日本	株式	ダイヘン	電気機器	369,000	519.26	191,608,580	533.00	196,677,000	1.61
日本	株式	東リ	化学	596,000	293.00	174,628,000	329.00	196,084,000	1.61
日本	株式	愛知製鋼	鉄鋼	375,000	434.67	163,003,166	515.00	193,125,000	1.58
日本	株式	キッツ	機械	348,100	513.00	178,575,300	554.00	192,847,400	1.58
日本	株式	オプテックス	電気機器	77,700	3,350.00	260,295,000	2,392.00	185,858,400	1.52
日本	株式	トーカロ	金属製品	90,600	2,149.00	194,699,400	2,035.00	184,371,000	1.51
日本	株式	萩原工業	その他製品	72,000	2,266.00	163,152,000	2,555.00	183,960,000	1.51
日本	株式	リログループ	サービス業	11,400	14,690.00	167,466,000	16,080.00	183,312,000	1.50
日本	株式	京三製作所	電気機器	473,000	360.00	170,280,000	364.00	172,172,000	1.41
日本	株式	セントラル硝子	化学	372,000	614.00	228,408,000	446.00	165,912,000	1.36
日本	株式	日特エンジニアリング	機械	127,000	982.00	124,714,000	1,270.00	161,290,000	1.32
日本	株式	ミライト・ホールディングス	建設業	143,300	923.21	132,297,324	1,095.00	156,913,500	1.29
日本	株式	ベネフィット・ワン	サービス業	49,000	2,436.00	119,364,000	3,185.00	156,065,000	1.28
日本	株式	タケエイ	サービス業	171,800	917.00	157,540,600	881.00	151,355,800	1.24

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	水産・農林業	0.31
		建設業	3.30
		食料品	0.98
		繊維製品	3.82
		化学	4.42
		ゴム製品	0.51
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	1.58
		金属製品	2.16
		機械	13.77
		電気機器	12.71
		輸送用機器	2.94
		精密機器	1.06
		その他製品	6.14
		情報・通信業	9.36
		卸売業	11.42
		小売業	4.61
		銀行業	0.66
		保険業	2.50
		その他金融業	1.22
不動産業	2.45		
サービス業	9.88		
合 計			96.54

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 7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	14,177,067,000	57.93
地方債証券	日本	532,544,000	2.18
特殊債券	日本	501,428,271	2.05

社債券	日本	7,944,308,512	32.46
	アメリカ	200,114,693	0.82
	ドイツ	98,904,000	0.40
	フランス	205,155,000	0.84
	韓国	500,447,114	2.04
	小計	8,948,929,319	36.56
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		314,700,652	1.29
合計(純資産総額)		24,474,669,242	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366回利付国債(2年)	1,700,000,000	100.86	1,714,773,000	100.70	1,711,985,000	0.100	2018/7/15	6.99
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,400,000,000	102.27	1,431,848,000	102.89	1,440,530,000	0.100	2026/3/20	5.89
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,300,000,000	103.39	1,344,189,000	102.81	1,336,621,000	0.100	2026/6/20	5.46
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	1,300,000,000	102.09	1,327,170,000	101.78	1,323,140,000	0.100	2021/6/20	5.41
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	600,000,000	106.84	641,076,000	106.96	641,778,000	0.600	2024/6/20	2.62
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	500,000,000	124.32	621,635,000	126.81	634,070,000	1.700	2032/9/20	2.59
日本	国債証券	第50回利付国債(30年)	500,000,000	112.12	560,649,000	115.17	575,860,000	0.800	2046/3/20	2.35
日本	国債証券	第8回利付国債(40年)	400,000,000	127.69	510,760,000	138.80	555,200,000	1.400	2055/3/20	2.27
日本	国債証券	第121回利付国債(20年)	400,000,000	125.96	503,840,000	127.39	509,580,000	1.900	2030/9/20	2.08
日本	国債証券	第130回利付国債(20年)	400,000,000	125.43	501,740,000	127.14	508,580,000	1.800	2031/9/20	2.08
日本	特殊債券	第109回福岡北九州高速道路債券	500,000,000	100.28	501,428,271	100.28	501,428,271	2.090	2016/9/20	2.05
日本	国債証券	第156回利付国債(20年)	400,000,000	103.36	413,474,000	104.46	417,872,000	0.400	2036/3/20	1.71
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	100.88	403,536,000	100.60	402,416,000	0.850	2017/8/9	1.64
日本	国債証券	第157回利付国債(20年)	400,000,000	100.77	403,096,000	100.38	401,532,000	0.200	2036/6/20	1.64
日本	国債証券	第127回利付国債(20年)	300,000,000	126.46	379,392,000	127.98	383,952,000	1.900	2031/3/20	1.57
日本	国債証券	第146回利付国債(20年)	300,000,000	125.07	375,210,000	127.59	382,791,000	1.700	2033/9/20	1.56
日本	国債証券	第51回利付国債(30年)	300,000,000	102.86	308,586,000	101.10	303,327,000	0.300	2046/6/20	1.24
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	100.43	301,302,000	100.43	301,290,000	0.386	2017/9/20	1.23

日本	国債証券	第34回利付国債(30年)	200,000,000	140.23	280,460,000	147.12	294,240,000	2.200	2041/3/20	1.20
日本	国債証券	第30回利付国債(30年)	200,000,000	139.83	279,660,000	145.93	291,878,000	2.300	2039/3/20	1.19
日本	国債証券	第31回利付国債(30年)	200,000,000	138.33	276,674,000	144.54	289,082,000	2.200	2039/9/20	1.18
日本	国債証券	第26回利付国債(30年)	200,000,000	139.51	279,026,000	144.44	288,892,000	2.400	2037/3/20	1.18
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	200,000,000	124.56	249,120,000	127.40	254,818,000	1.700	2033/6/20	1.04
日本	国債証券	第133回利付国債(20年)	200,000,000	125.54	251,080,000	127.39	254,792,000	1.800	2031/12/20	1.04
日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	200,000,000	117.53	235,060,000	121.56	243,124,000	1.300	2035/6/20	0.99
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	200,000,000	107.01	214,020,000	106.63	213,268,000	0.600	2023/12/20	0.87
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	107.44	214,884,000	106.57	213,154,000	2.084	2020/3/4	0.87
日本	社債券	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	102.84	205,698,000	102.66	205,326,000	0.877	2020/3/19	0.84
日本	社債券	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	101.07	202,140,000	101.01	202,030,000	0.387	2020/3/19	0.83
アメリカ	社債券	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	100.05	200,114,693	100.05	200,114,693	0.450	2016/9/20	0.82

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	57.93
地方債証券	2.18
特殊債券	2.05
社債券	36.56
合計	98.71

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7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	24,991,416,580	88.62
	カナダ	1,005,946,007	3.57
	オランダ	192,962,434	0.68
	アイルランド	299,792,690	1.06
	イギリス	181,035,100	0.64
	パミューダ	144,436,467	0.51
	シンガポール	128,925,405	0.46
	ジャージー	180,164,387	0.64
	小計	27,124,679,070	96.18
投資証券	アメリカ	753,476,963	2.67
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		323,997,308	1.15
合計（純資産総額）		28,202,153,341	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		55,438,692	0.20

(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	11,847	76,572.31	907,152,254	77,887.92	922,738,214	3.27
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	80,165	10,060.18	806,474,836	10,628.91	852,066,714	3.02
アメリカ	株式	ANADARKO PETROLEUM CORP	エネルギー	88,422	4,918.08	434,867,059	5,571.85	492,674,227	1.75
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	69,097	6,368.59	440,051,136	7,085.94	489,617,279	1.74
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	36,786	11,822.41	434,899,235	13,052.50	480,149,265	1.70
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	61,400	6,629.99	407,081,929	7,795.99	478,674,228	1.70
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	6,081	62,359.41	379,207,630	78,587.53	477,890,808	1.69
アメリカ	株式	HALLIBURTON CO	エネルギー	103,760	4,082.93	423,645,075	4,466.04	463,396,663	1.64
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	24,692	15,636.30	386,091,760	17,885.05	441,617,842	1.57

アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	50,918	7,687.65	391,439,889	8,659.55	440,926,997	1.56
アメリカ	株式	LOWE'S COS INC	小売	49,175	7,876.62	387,332,977	8,590.63	422,444,397	1.50
アメリカ	株式	BOSTON SCIENTIFIC CORP	ヘルスケア機器・サービス	165,559	1,934.86	320,334,076	2,541.58	420,781,907	1.49
アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP		32,844	10,785.87	354,251,311	12,180.59	400,059,396	1.42
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	48,358	7,778.80	376,167,338	8,269.01	399,873,260	1.42
アメリカ	株式	NRG ENERGY INC	公益事業	266,926	1,395.76	372,565,840	1,471.27	392,722,298	1.39
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	58,657	6,231.86	365,542,485	6,693.32	392,610,189	1.39
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	36,034	10,917.54	393,402,987	10,895.18	392,597,017	1.39
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	62,980	5,975.88	376,361,098	6,178.53	389,123,908	1.38
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	84,266	4,744.67	399,814,941	4,557.93	384,078,782	1.36
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	64,668	5,528.23	357,499,899	5,869.44	379,565,476	1.35
アメリカ	株式	SEMPRA ENERGY	公益事業	31,862	11,040.30	351,766,206	11,630.29	370,564,606	1.31
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	54,588	5,890.57	321,554,593	6,758.06	368,909,110	1.31
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	36,595	9,532.40	348,838,531	10,025.36	366,878,203	1.30
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC		15,105	21,368.98	322,778,466	23,397.38	353,417,567	1.25
アメリカ	株式	IMS HEALTH HOLDINGS INC	ヘルスケア機器・サービス	112,443	2,656.27	298,679,606	3,139.90	353,060,833	1.25
アメリカ	株式	SYNCHRONY FINANCIAL	各種金融	114,188	2,955.85	337,523,653	2,914.36	332,785,191	1.18
カナダ	株式	CANADIAN NATURAL RESOURCES	エネルギー	106,305	2,783.87	295,940,347	3,115.25	331,167,108	1.17
アメリカ	株式	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	資本財	26,959	11,720.50	315,972,993	12,087.65	325,871,204	1.16
アメリカ	株式	ALTRIA GROUP INC	食品・飲料・タバコ	45,960	6,408.13	294,518,073	7,007.62	322,070,500	1.14
アメリカ	株式	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	素材	20,540	14,849.21	305,002,880	15,557.53	319,551,785	1.13

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	7.78
		素材	4.20
		資本財	5.95
		商業・専門サービス	2.21
		運輸	2.65
		自動車・自動車部品	0.64
		耐久消費財・アパレル	1.79
		消費者サービス	3.17

	メディア	2.73
	小売	5.77
	食品・生活必需品小売り	2.73
	食品・飲料・タバコ	3.56
	家庭用品・パーソナル用品	0.88
	ヘルスケア機器・サービス	4.73
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.46
	銀行	3.94
	各種金融	6.39
	不動産	0.94
	ソフトウェア・サービス	17.57
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.62
	電気通信サービス	0.63
	公益事業	2.71
	半導体・半導体製造装置	1.15
投資証券		2.67
合計		98.85

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	531,021.97	55,784,217	55,438,692	0.20

(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 7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	1,695,425,136	7.80
	イタリア	890,620,368	4.10
	フランス	2,927,326,094	13.47
	オランダ	1,150,185,365	5.29
	スペイン	773,022,317	3.56
	ベルギー	444,749,138	2.05
	アイルランド	714,726,912	3.29

	ギリシャ	82,383,450	0.38
	ポルトガル	437,779,951	2.01
	イギリス	6,348,280,664	29.21
	スイス	3,990,571,286	18.36
	スウェーデン	413,640,684	1.90
	ノルウェー	147,955,390	0.68
	デンマーク	507,702,083	2.34
	バミューダ	290,267,030	1.34
	ジャージー	390,224,754	1.80
	小計	21,204,860,622	97.56
	コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	529,246,658	2.44
	合計（純資産総額）	21,734,107,280	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		51,492,526	0.24

(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	138,294	7,596.32	1,050,525,644	8,231.83	1,138,413,528	5.24
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	33,996	25,391.80	863,219,697	26,177.66	889,935,899	4.09
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	95,974	7,700.81	739,078,364	8,562.38	821,766,722	3.78
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,071,784	488.23	523,278,710	586.77	628,892,567	2.89
フランス	株式	DANONE	食品・飲料・タバコ	74,531	7,168.06	534,243,417	7,857.46	585,624,582	2.69
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	54,996	9,291.52	510,996,808	10,229.48	562,580,559	2.59
アイルランド	株式	PADDY POWER BETFAIR PLC	消費者サービス	43,384	12,769.66	553,998,951	11,683.17	506,862,799	2.33
フランス	株式	L'OREAL	家庭用品・パーソナル用品	24,683	18,266.60	450,874,646	20,236.46	499,496,703	2.30
オランダ	株式	AKZO NOBEL	素材	62,642	6,836.09	428,226,788	6,692.66	419,241,996	1.93
ドイツ	株式	LINDE AG	素材	27,186	14,773.37	401,628,902	14,932.99	405,968,456	1.87
ジャージー	株式	MPP PLC	メディア	167,397	2,196.35	367,663,087	2,331.13	390,224,754	1.80

イギリス	株式	ARM HOLDINGS PLC	半導体・半導体製造装置	168,913	1,376.67	232,538,355	2,296.75	387,951,102	1.78
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	34,957	11,668.78	407,905,878	10,908.83	381,340,239	1.75
オランダ	株式	RELX NV	メディア	196,026	1,759.34	344,876,520	1,889.46	370,385,138	1.70
イギリス	株式	IG GROUP HOLDINGS PLC	各種金融	300,848	1,104.36	332,246,272	1,211.63	364,519,260	1.68
ドイツ	株式	SYMRISE AG	素材	49,837	6,777.10	337,750,597	7,313.81	364,498,553	1.68
イギリス	株式	DOMINO'S PIZZA GROUP PLC	消費者サービス	673,649	466.22	314,073,150	530.72	357,524,568	1.64
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,130,505	299.81	338,942,809	315.97	357,211,514	1.64
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	19,746	16,964.16	334,974,346	17,737.99	350,254,439	1.61
イタリア	株式	ENEL SPA	公益事業	745,373	452.26	337,109,623	464.06	345,903,786	1.59
フランス	株式	BNP PARIBAS	銀行	68,787	5,028.17	345,873,067	4,957.03	340,979,762	1.57
スイス	株式	UBS GROUP AG-REG	各種金融	237,738	1,562.12	371,377,543	1,417.11	336,901,539	1.55
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SE	資本財	48,378	6,027.56	291,601,476	6,769.00	327,471,088	1.51
イタリア	株式	ENI SPA	エネルギー	198,137	1,530.31	303,211,845	1,581.20	313,295,988	1.44
イギリス	株式	BEAZLEY PLC/UK	保険	564,073	482.73	272,295,129	545.16	307,515,068	1.41
ドイツ	株式	GEA GROUP AG	資本財	54,828	4,781.79	262,176,410	5,426.65	297,532,808	1.37
イギリス	株式	RIO TINTO PLC	素材	86,754	2,696.96	233,972,354	3,383.92	293,569,086	1.35
パミュータ	株式	HISCOX LTD	保険	199,487	1,314.78	262,282,874	1,455.06	290,267,030	1.34
スペイン	株式	AENA SA	運輸	19,612	13,263.87	260,131,193	14,666.95	287,648,341	1.32
デンマーク	株式	TDC A/S	電気通信サービス	487,595	505.53	246,494,144	544.09	265,297,758	1.22

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	6.05
		素材	9.38
		資本財	5.25
		商業・専門サービス	2.51
		運輸	1.32
		自動車・自動車部品	0.59
		耐久消費財・アパレル	3.51
		消費者サービス	5.08
		メディア	3.50
		小売	1.54
		食品・生活必需品小売り	2.28
		食品・飲料・タバコ	7.93
		家庭用品・パーソナル用品	5.82
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.63
		銀行	8.60
		各種金融	3.73
保険	2.75		

	不動産	0.86
	ソフトウェア・サービス	4.32
	電気通信サービス	6.24
	公益事業	4.39
	半導体・半導体製造装置	2.30
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	英ポンド	売建	374,463.87	51,694,693	51,492,526	0.24

(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 7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	143,306,501	1.91
	アイルランド	214,711,150	2.86
	イギリス	62,906,656	0.84
	ケイマン	294,182,395	3.92
	オーストラリア	4,102,594,961	54.65
	バミューダ	165,197,661	2.20
	香港	1,387,048,127	18.48
	シンガポール	756,148,023	10.07
	中国	192,337,612	2.56
	小計	7,318,433,086	97.48
投資証券	オーストラリア	102,060,790	1.36
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		86,878,398	1.16
合計（純資産総額）		7,507,372,274	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建		9,013,069	0.12

(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 (%)
香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	785,800	567.91	446,266,454	660.21	518,795,376	6.91
オーストラリア	株式	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	183,378	2,078.63	381,176,658	2,072.41	380,034,914	5.06
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	221,728	1,354.29	300,285,730	1,568.84	347,856,465	4.63
オーストラリア	株式	BRAMBLES LTD	商業・専門 サービス	328,493	968.91	318,282,861	1,055.06	346,580,087	4.62
オーストラリア	株式	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	55,124	5,884.39	324,371,449	6,111.96	336,916,124	4.49
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	35,454	8,073.61	286,241,811	9,230.79	327,268,783	4.36
オーストラリア	株式	WESTPAC BANKING CORP	銀行	125,695	2,410.28	302,960,278	2,420.43	304,236,401	4.05
シンガポール	株式	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	電気通信 サービス	755,520	296.07	223,693,997	331.74	250,640,511	3.34
オーストラリア	株式	AUST AND NZ BANKING GROUP	銀行	122,597	1,886.53	231,283,523	2,024.49	248,196,548	3.31
アイルランド	株式	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	素材	123,669	1,410.93	174,489,242	1,736.17	214,711,150	2.86
オーストラリア	株式	WESFARMERS LTD	食品・生活 必需品小売り	63,061	3,304.23	208,368,116	3,363.93	212,133,370	2.83
オーストラリア	株式	ASX LTD	各種金融	46,920	3,298.86	154,782,709	3,891.86	182,606,184	2.43
オーストラリア	株式	RIO TINTO LTD	素材	44,418	3,402.45	151,130,394	3,978.27	176,707,170	2.35
ケイマン	株式	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	資本財	139,272	1,329.70	185,190,978	1,226.20	170,776,162	2.27
オーストラリア	株式	AGL ENERGY LTD	公益事業	107,160	1,451.17	155,507,932	1,582.19	169,548,381	2.26
オーストラリア	株式	WOOLWORTHS LTD	食品・生活 必需品小売り	90,472	1,752.54	158,556,306	1,838.30	166,315,039	2.22
バミューダ	株式	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	資本財	53,000	3,075.32	162,992,191	3,116.93	165,197,661	2.20
オーストラリア	株式	TELSTRA CORPORATION LTD	電気通信 サービス	365,114	421.34	153,838,724	450.93	164,642,463	2.19
シンガポール	株式	UNITED OVERSEAS BANK LTD	銀行	103,892	1,439.52	149,555,628	1,446.07	150,235,208	2.00
香港	株式	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	耐久消費財・アパレル	333,500	417.75	139,322,857	447.54	149,256,258	1.99
香港	株式	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	不動産	213,000	636.96	135,673,502	693.34	147,683,294	1.97
アメリカ	株式	RESMED INC-CDI	ヘルスケア 機器・サービス	211,866	594.58	125,972,011	676.40	143,306,501	1.91
オーストラリア	株式	INCITEC PIVOT LTD	素材	623,152	260.63	162,416,309	229.39	142,948,078	1.90

香港	株式	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	電気通信サービス	752,000	172.36	129,622,076	186.01	139,884,934	1.86
香港	株式	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	消費者サービス	382,000	360.69	137,784,147	347.94	132,913,462	1.77
香港	株式	SWIRE PROPERTIES LTD	不動産	429,800	279.37	120,076,321	298.13	128,140,142	1.71
オーストラリア	株式	MEDIBANK PRIVATE LTD	保険	513,707	224.94	115,556,190	240.39	123,491,875	1.64
ケイマン	株式	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	不動産	162,272	656.17	106,479,582	760.48	123,406,233	1.64
香港	株式	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	銀行	351,000	298.88	104,910,058	347.94	122,127,291	1.63
オーストラリア	株式	QBE INSURANCE GROUP LTD	保険	134,380	862.86	115,951,735	862.58	115,914,683	1.54

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	1.51
		素材	13.99
		資本財	4.48
		商業・専門サービス	4.62
		運輸	1.54
		耐久消費財・アパレル	1.99
		消費者サービス	1.77
		食品・生活必需品小売り	5.04
		ヘルスケア機器・サービス	1.91
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.36
		銀行	22.04
		各種金融	2.43
		保険	11.24
		不動産	7.19
		ソフトウェア・サービス	2.42
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.29
電気通信サービス	7.39		
公益事業	2.26		
投資証券			1.36
合計			98.84

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	豪ドル	売建	114,772.31	9,049,338	9,013,069	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2016年 7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	3,954,898,112	29.51
	カナダ	190,685,652	1.42
	メキシコ	109,199,527	0.81
	ドイツ	693,474,073	5.18
	イタリア	1,385,084,089	10.34
	フランス	1,308,348,078	9.76
	オランダ	294,050,105	2.19
	スペイン	746,557,964	5.57
	ベルギー	403,012,419	3.01
	オーストリア	240,501,088	1.79
	フィンランド	135,702,164	1.01
	アイルランド	114,231,721	0.85
	イギリス	954,865,605	7.13
	スイス	31,225,262	0.23
	スウェーデン	64,622,532	0.48
	ノルウェー	45,473,049	0.34
	デンマーク	150,835,287	1.13
	ポーランド	94,619,015	0.71
	オーストラリア	167,553,609	1.25
	ニュージーランド	97,977,865	0.73
シンガポール	81,291,519	0.61	
マレーシア	75,291,087	0.56	
南アフリカ	60,041,046	0.45	
	小計	11,399,540,868	85.07
特殊債券	アメリカ	23,856,103	0.18
	ドイツ	175,613,455	1.31
	イギリス	41,365,241	0.31
	国際機関	39,709,055	0.30
	小計	280,543,854	2.09
社債券	アメリカ	852,747,391	6.36
	カナダ	75,184,696	0.56
	オランダ	38,742,551	0.29
	ルクセンブルク	47,138,783	0.35
	アイルランド	21,838,894	0.16

	イギリス	41,759,475	0.31
	スウェーデン	53,299,236	0.40
	ケイマン	39,922,186	0.30
	小計	1,170,633,212	8.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		549,276,218	4.10
合計（純資産総額）		13,399,994,152	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	1,087,134,579	8.11
	買建	ドイツ	254,118,314	1.90
	買建	オーストラリア	253,493,764	1.89
	売建	アメリカ	15,189,846	0.11
	売建	カナダ	246,722,899	1.84
	売建	ドイツ	19,364,314	0.14
	売建	イギリス	503,266,279	3.76

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,466,292,431	10.94
	売建		1,446,233,076	10.79

(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	4,920,000	10,472.99	515,271,585	10,601.89	521,613,142	1.375	2020/4/30	3.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,950,000	10,459.94	413,167,914	10,463.21	413,296,807	0.875	2016/12/31	3.08
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,360,000	11,306.59	379,901,679	11,437.25	384,291,705	3.125	2021/5/15	2.87
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,430,000	10,571.72	362,610,297	10,889.04	373,494,349	2.000	2025/8/15	2.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,150,000	10,988.11	346,125,673	11,292.85	355,725,085	2.500	2024/5/15	2.65
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,745,000	11,752.23	322,598,811	12,071.14	331,353,003	0.500	2025/5/25	2.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	10,578.13	296,187,754	10,606.78	296,990,058	1.500	2018/8/31	2.22
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,070,000	11,896.65	246,260,852	11,947.84	247,320,360	0.500	2019/11/25	1.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,915,000	11,152.05	213,561,872	12,166.56	232,989,653	3.000	2045/5/15	1.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,040,000	10,611.68	216,478,323	10,671.23	217,693,184	1.625	2019/3/31	1.62
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,660,000	12,862.50	213,517,567	12,995.52	215,725,707	1.500	2022/9/4	1.61
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,335,000	15,033.93	200,703,004	14,996.30	200,200,678	5.500	2022/9/1	1.49

イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,675,000	11,785.53	197,407,793	11,823.70	198,047,121	0.700	2020/5/1	1.48
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	930,000	18,721.12	174,106,501	20,152.85	187,421,567	4.750	2035/4/25	1.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,440,000	11,456.96	164,980,258	12,473.29	179,615,452	3.125	2043/2/15	1.34
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,525,000	11,718.29	178,704,019	11,570.88	176,456,019	3.750	2016/8/1	1.32
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,140,000	14,136.03	161,150,750	14,447.20	164,698,150	3.500	2030/3/1	1.23
イギリス	国債証券	UK TREASURY	735,000	18,951.86	139,296,230	22,367.48	164,401,050	3.750	2052/7/22	1.23
イギリス	国債証券	UK TREASURY	805,000	18,774.22	151,132,473	20,336.97	163,712,660	4.750	2030/12/7	1.22
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,305,000	11,673.33	152,336,965	11,770.08	153,599,642	0.000	2020/5/25	1.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,220,000	11,232.49	137,036,403	12,218.77	149,069,013	3.000	2042/5/15	1.11
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,250,000	11,000.40	137,505,028	10,955.12	136,939,080	2.125	2021/8/15	1.02
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	935,000	14,461.06	135,210,943	14,506.45	135,635,340	5.500	2021/4/30	1.01
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,045,000	12,875.47	134,548,726	12,963.48	135,468,407	2.500	2024/12/1	1.01
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	950,000	13,986.81	132,874,756	14,067.14	133,637,852	3.750	2024/9/1	1.00
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,085,000	11,849.21	128,563,955	12,218.45	132,570,255	1.600	2025/4/30	0.99
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	735,000	17,012.74	125,043,666	17,815.41	130,943,289	6.000	2029/1/31	0.98
デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	7,290,000	1,797.89	131,066,253	1,786.15	130,210,389	4.000	2019/11/15	0.97
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,065,000	12,076.96	128,619,728	12,134.07	129,227,892	1.400	2020/1/31	0.96
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,035,000	12,517.75	129,558,743	12,376.74	128,099,328	4.500	2018/1/31	0.96

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	85.07
特殊債券	2.09
社債券	8.74
合計	95.90

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 1609	買建	5	米ドル	1,089,541.2	113,769,893	1,093,828.15	114,217,536	0.85
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TNOTE5Y 1609	買建	18	米ドル	2,191,394.56	228,825,420	2,190,656.34	228,748,335	1.71
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TNOTE10Y1609	買建	37	米ドル	4,906,276.49	512,313,391	4,904,812.5	512,160,521	3.82
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TBOND20Y1609	買建	3	米ドル	488,675.96	51,027,543	520,031.25	54,301,663	0.41

アメリカ	シカゴ商品取引所	TNOUL10Y1609	売建	1	米ドル	142,716.99	14,902,507	145,468.75	15,189,846	0.11
アメリカ	シカゴ商品取引所	TBOND30Y1609	買建	9	米ドル	1,695,706.91	177,065,715	1,701,843.75	177,706,524	1.33
カナダ	モントリオール取引所	CAN 10Y 1609	売建	21	加ドル	3,102,024.32	246,331,751	3,106,950	246,722,899	1.84
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	FBTP10Y 1609	買建	1	ユーロ	143,870.85	16,641,541	144,460	16,709,688	0.12
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SCHATZ2Y1609	買建	13	ユーロ	1,457,899.95	168,635,287	1,455,935	168,408,001	1.26
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BOBL5Y 1609	買建	3	ユーロ	399,799.95	46,244,860	400,650	46,343,185	0.35
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1609	売建	1	ユーロ	167,467.82	19,371,002	167,410	19,364,314	0.14
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUXL30Y 1609	買建	1	ユーロ	190,817.69	22,071,882	195,880	22,657,440	0.17
オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR03Y1609	買建	3	豪ドル	339,936.24	26,705,391	340,214.79	26,727,274	0.20
オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR10Y1609	買建	21	豪ドル	2,863,843.03	224,983,508	2,886,538.83	226,766,490	1.69
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT10Y 1609	売建	28	英ポンド	3,619,372.59	497,772,312	3,659,320	503,266,279	3.76

(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	9,092,832.41	964,275,419	948,413,031	7.08
	加ドル	買建	380,000.00	30,359,934	30,141,600	0.22
	メキシコペソ	買建	18,423,000.00	105,955,715	100,958,040	0.75
	ユーロ	買建	2,324,000.00	271,265,575	268,793,840	2.01
	英ポンド	買建	348,000.00	49,322,162	47,818,680	0.36
	スウェーデンクローナ	買建	664,000.00	8,298,596	8,027,760	0.06
	豪ドル	買建	793,000.00	62,406,329	62,139,480	0.46
	米ドル	売建	5,120,459.45	542,202,693	533,962,395	3.98
	加ドル	売建	701,000.00	56,611,770	55,603,320	0.41
	ユーロ	売建	3,270,458.77	381,357,659	378,261,261	2.82
	英ポンド	売建	381,000.00	53,099,090	52,353,210	0.39
	スイスフラン	売建	335,000.00	36,411,150	35,731,100	0.27
	スウェーデンクローナ	売建	149,000.00	1,856,540	1,801,410	0.01
	ノルウェークローネ	売建	1,145,000.00	14,438,450	13,946,100	0.10
	デンマーククローネ	売建	3,882,000.00	61,607,340	60,365,100	0.45
	ポーランドズロチ	売建	817,000.00	22,091,680	21,585,140	0.16

豪ドル	売建	919,000.00	72,854,570	72,012,840	0.54
ニュージーランドドル	売建	2,510,000.00	187,514,700	185,639,600	1.39
シンガポールドル	売建	453,000.00	35,782,470	34,971,600	0.26

(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7月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………9,903円

純資産総額……………649.75億円

※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7月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金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

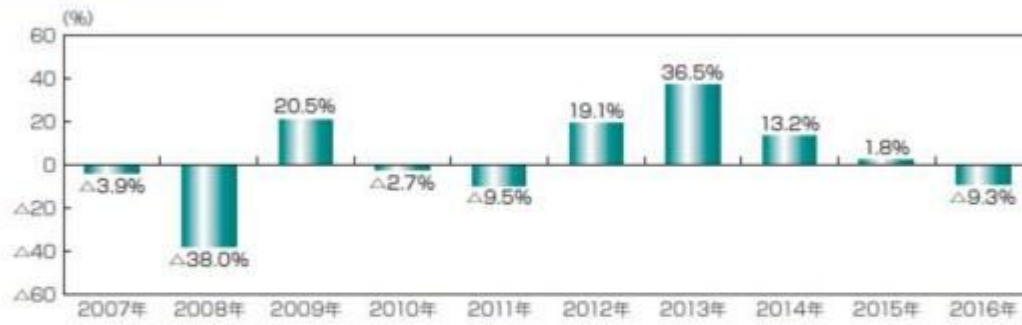
主要な資産の状況

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	23.3%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.6%
		日本電信電話	情報・通信業	4.2%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.5%
日本小型株式 グローバル・ラップ マザーファンド	8.5%	エレコム	電気機器	2.7%
		TOWA	機械	2.4%
		岡村製作所	その他製品	2.1%
日本債券 グローバル・ラップ マザーファンド	17.3%	第366回利付国債(2年)	国債証券	7.0%
		第342回利付国債(10年)	国債証券	5.9%
		第343回利付国債(10年)	国債証券	5.5%
北米株式 グローバル・ラップ マザーファンド	19.9%	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	3.3%
		CHEVRON CORP	エネルギー	3.0%
		ANADARKO PETROLEUM CORP	エネルギー	1.7%
欧州先進国株式 グローバル・ラップ マザーファンド	14.9%	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	5.2%
		ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー	4.1%
		NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー	3.8%
アジア太平洋株式 グローバル・ラップ マザーファンド	4.9%	AIA GROUP LTD	保険	6.9%
		NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	5.1%
		BHP BILLITON LTD	素材	4.6%
海外債券 グローバル・ラップ マザーファンド	10.2%	US TREASURY N/B	国債証券	3.9%
		US TREASURY N/B	国債証券	3.1%
		US TREASURY N/B	国債証券	2.9%
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7月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成28年 1月13日から平成28年 7月12日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【GW7つの卵】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成28年 1月12日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,524,737,335	569,359,692
親投資信託受益証券	68,200,306,440	63,282,275,243
未収入金	2,034,811,710	61,240,628
未収利息	2,557	-
流動資産合計	71,759,858,042	63,912,875,563
資産合計	71,759,858,042	63,912,875,563
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,040,656,554	-
未払解約金	22,180,887	18,798,906
未払受託者報酬	21,603,759	92,436
未払委託者報酬	756,133,684	3,235,279
未払利息	-	634
その他未払費用	2,117,112	9,058
流動負債合計	2,842,691,996	22,136,313
負債合計	2,842,691,996	22,136,313
純資産の部		
元本等		
元本	68,021,885,165	66,040,188,813
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	895,280,881	2,149,449,563
（分配準備積立金）	16,513	15,673
元本等合計	68,917,166,046	63,890,739,250
純資産合計	68,917,166,046	63,890,739,250
負債純資産合計	71,759,858,042	63,912,875,563

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 平成27年 1月14日 至 平成27年 7月13日	当中間計算期間 自 平成28年 1月13日 至 平成28年 7月12日
営業収益		
受取利息	373,286	42,318
有価証券売買等損益	7,837,786,298	2,430,348,214

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	平成27年 1月14日 至 平成27年 7月13日	自	平成28年 1月13日 至 平成28年 7月12日
営業収益合計		7,838,159,584		2,430,305,896
営業費用				
支払利息		-		148,023
受託者報酬		23,538,332		18,006,004
委託者報酬		823,843,725		630,212,024
その他費用		2,306,706		1,767,156
営業費用合計		849,688,763		650,133,207
営業利益又は営業損失（ ）		6,988,470,821		3,080,439,103
経常利益又は経常損失（ ）		6,988,470,821		3,080,439,103
中間純利益又は中間純損失（ ）		6,988,470,821		3,080,439,103
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		796,475,819		70,477,811
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,727,706,835		895,280,881
剰余金増加額又は欠損金減少額		313,609,307		11,373,108
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		313,609,307		11,373,108
剰余金減少額又は欠損金増加額		797,696,460		46,142,260
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		797,696,460		46,142,260
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		11,435,614,684		2,149,449,563

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

		前計算期間末 平成28年 1月12日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月12日現在
1.	期首元本額	79,794,105,054円	68,021,885,165円
	期中追加設定元本額	4,685,780,147円	1,539,703,233円
	期中一部解約元本額	16,458,000,036円	3,521,399,585円
2.	受益権の総数	68,021,885,165口	66,040,188,813口
3.	元本の欠損		
	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	- 円	2,149,449,563円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成27年 1月14日 至 平成27年 7月13日	当中間計算期間 自 平成28年 1月13日 至 平成28年 7月12日
---	---

信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 199,777,705円	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 152,567,091円
---	---

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 平成28年 1月12日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月12日現在
中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(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

（1口当たり情報）

	前計算期間末 平成28年 1月12日現在	当中間計算期間末 平成28年 7月12日現在
1口当たり純資産額	1.0132円	0.9675円
(1万口当たり純資産額)	(10,132円)	(9,675円)

当ファンドは、「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通り

です。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	337,844,380	467,245,099
株式	31,453,397,210	32,257,630,060
未収入金	300,644,627	419,359,673
未収配当金	47,210,540	56,309,400
未収利息	566	-
流動資産合計	32,139,097,323	33,200,544,232
資産合計		
32,139,097,323		
負債の部		
流動負債		
未払金	-	587,875,197
未払解約金	295,196,081	-
未払利息	-	520
流動負債合計	295,196,081	587,875,717
負債合計		
295,196,081		
純資産の部		
元本等		
元本	17,867,346,455	19,865,899,240
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	13,976,554,787	12,746,769,275
元本等合計	31,843,901,242	32,612,668,515
純資産合計		
31,843,901,242		
負債純資産合計		
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28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1.	期首	平成27年 1月14日	平成28年 1月13日
	期首元本額	21,719,991,492円	17,867,346,455円
	期首からの追加設定元本額	2,871,904,840円	5,680,048,343円
	期首からの一部解約元本額	6,724,549,877円	3,681,495,558円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	7,884,635,614円	9,009,784,420円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	271,839,458円	318,165,771円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	560,045,315円	647,587,135円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	4,287,413,507円	4,553,915,451円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	1,836,143,395円	1,895,210,977円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	1,836,693,178円	2,005,122,355円
	日本大型株式ファンド	99,813,282円	99,585,723円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	45,703,449円	64,797,951円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	123,080,429円	164,859,076円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	166,980,640円	212,552,431円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	394,457,425円	469,669,958円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	360,540,763円	424,647,992円
	計	17,867,346,455円	19,865,899,240円
2.	受益権の総数	17,867,346,455口	19,865,899,240口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7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 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	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
-------------------------	---	----

（1口当たり情報）

平成28年 1月12日現在		平成28年 7月12日現在	
1口当たり純資産額	1.7822円	1口当たり純資産額	1.6416円
(1万口当たり純資産額)	(17,822円)	(1万口当たり純資産額)	(16,416円)

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	717,061,128	202,719,550
株式	12,230,462,600	11,681,081,700
未収入金	56,076,489	138,955,695
未収配当金	13,513,450	15,726,800
未収利息	1,202	-
流動資産合計	13,017,114,869	12,038,483,745
資産合計	13,017,114,869	12,038,483,745
負債の部		
流動負債		
未払金	65,833,388	14,418,991
未払解約金	277,581,218	10,251,837
未払利息	-	225
流動負債合計	343,414,606	24,671,053
負債合計	343,414,606	24,671,053
純資産の部		
元本等		
元本	3,189,952,346	3,007,174,442
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,483,747,917	9,006,638,250
元本等合計	12,673,700,263	12,013,812,692
純資産合計	12,673,700,263	12,013,812,692
負債純資産合計	13,017,114,869	12,038,483,745

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28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1.	期首	平成27年 1月14日	平成28年 1月13日
	期首元本額	3,422,404,195円	3,189,952,346円
	期首からの追加設定元本額	827,241,999円	323,254,570円
	期首からの一部解約元本額	1,059,693,848円	506,032,474円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	1,399,536,266円	1,364,056,253円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	73,571,743円	70,925,023円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	123,247,073円	117,611,767円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	773,770,705円	689,512,701円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	301,831,383円	262,832,253円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	241,843,520円	221,444,642円
	日本小型株式ファンド	57,444,465円	57,138,952円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	16,106,201円	18,488,975円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	33,636,028円	36,753,961円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	36,822,518円	38,610,512円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	71,832,886円	71,081,786円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	60,309,558円	58,717,617円
	計	3,189,952,346円	3,007,174,442円
2.	受益権の総数	3,189,952,346口	3,007,174,442口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7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 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

(1口当たり情報)

平成28年 1月12日現在		平成28年 7月12日現在	
1口当たり純資産額	3.9730円	1口当たり純資産額	3.9951円
(1万口当たり純資産額)	(39,730円)	(1万口当たり純資産額)	(39,951円)

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位 : 円)

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	902,434,203	648,928,548
国債証券	15,027,533,000	14,453,086,000
地方債証券	525,616,000	537,157,000
特殊債券	1,738,202,666	501,876,748
社債券	12,406,183,617	8,880,402,318
未収入金	1,381,168,000	801,895,000
未収利息	66,017,683	49,297,926
前払費用	9,537,837	2,123,004
流動資産合計	32,056,693,006	25,874,766,544
資産合計	32,056,693,006	25,874,766,544

平成28年 1月12日現在

平成28年 7月12日現在

負債の部		
流動負債		
未払金	1,024,781,000	1,064,692,000
未払解約金	1,010,502,493	53,011,266
未払利息	-	723
流動負債合計	2,035,283,493	1,117,703,989
負債合計	2,035,283,493	1,117,703,989
純資産の部		
元本等		
元本	22,719,601,114	17,505,174,178
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,301,808,399	7,251,888,377
元本等合計	30,021,409,513	24,757,062,555
純資産合計	30,021,409,513	24,757,062,555
負債純資産合計	32,056,693,006	25,874,766,544

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28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1.	期首	平成27年 1月14日	平成28年 1月13日
	期首元本額	26,896,082,692円	22,719,601,114円
	期首からの追加設定元本額	1,594,163,806円	2,696,008,896円
	期首からの一部解約元本額	5,770,645,384円	7,910,435,832円
	元本の内訳		
	GW 7つの卵	10,335,251,706円	8,044,190,808円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	1,657,100,776円	1,346,042,399円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	2,153,303,705円	1,691,424,439円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	5,739,748,375円	4,064,067,696円

グローバル・ラップ・バランス 積極型	270,761,196円	147,167,544円
日本債券ファンド	43,885,966円	43,604,243円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	508,704,207円	476,236,236円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	763,444,603円	689,655,528円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	649,760,368円	548,677,103円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	543,204,949円	421,176,784円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	54,435,263円	32,931,398円
計	22,719,601,114円	17,505,174,178円
2. 受益権の総数	22,719,601,114口	17,505,174,178口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7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 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

（1口当たり情報）

平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1口当たり純資産額	1.3214円
(1万口当たり純資産額)	(13,214円)
	1.4143円
	(14,143円)

北米株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	346,375,085	2,601,929,023
コール・ローン	1,692,721	1,578,741
株式	30,744,487,082	25,875,066,825
投資証券	802,985,331	730,559,081
派生商品評価勘定	46,017	187,134
未収入金	274,770,906	209,165,325
未収配当金	23,381,115	17,466,461
未収利息	2	-
流動資産合計	32,193,738,259	29,435,952,590
資産合計	32,193,738,259	29,435,952,590
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	109	474,067
未払金	312,076,075	1,796,680,784
未払解約金	26,368,089	66,157,886
未払利息	-	1
流動負債合計	338,444,273	1,863,312,738
負債合計	338,444,273	1,863,312,738
純資産の部		
元本等		
元本	15,694,668,271	14,111,266,550
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,160,625,715	13,461,373,302
元本等合計	31,855,293,986	27,572,639,852
純資産合計	31,855,293,986	27,572,639,852
負債純資産合計	32,193,738,259	29,435,952,590

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>
--------------------	---

2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。
	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28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1.	期首	平成27年 1月14日	平成28年 1月13日
	期首元本額	18,862,942,341円	15,694,668,271円
	期首からの追加設定元本額	2,775,982,371円	2,417,228,108円
	期首からの一部解約元本額	5,944,256,441円	4,000,629,829円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	7,016,472,184円	6,476,807,792円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	248,703,979円	241,189,553円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	508,875,546円	491,794,372円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	3,752,292,198円	3,272,097,821円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	1,510,611,252円	1,270,927,940円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	1,643,378,196円	1,336,830,040円
	北米株式ファンド	56,704,018円	56,028,021円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	52,857,648円	60,275,814円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	112,917,511円	124,266,681円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	152,782,101円	160,493,106円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	344,948,425円	336,760,109円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	294,125,213円	283,795,301円
	計	15,694,668,271円	14,111,266,550円
2.	受益権の総数	15,694,668,271口	14,111,266,550口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7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 「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 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>	同左

(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

(平成28年 7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	18,939,496	-	19,126,630	187,134
	加ドル	18,939,496	-	19,126,630	187,134

	売建	85,097,382	-	85,571,449	474,067
	米ドル	85,097,382	-	85,571,449	474,067
	合計	104,036,878	-	104,698,079	286,933

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成28年 1月12日現在		平成28年 7月12日現在	
1口当たり純資産額	2.0297円	1口当たり純資産額	1.9539円
(1万口当たり純資産額)	(20,297円)	(1万口当たり純資産額)	(19,539円)

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	869,204,474	999,085,055
コール・ローン	25,612,404	20,039,152
株式	22,639,596,526	20,602,440,850
派生商品評価勘定	-	355,700
未収入金	-	7,117,138
未収配当金	23,936,771	23,715,554
未収利息	42	-
流動資産合計	23,558,350,217	21,652,753,449
資産合計	23,558,350,217	21,652,753,449
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	99,465	417,240
未払金	-	481,177,472
未払解約金	75,345,968	-
未払利息	-	22

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
流動負債合計	75,445,433	481,594,734
負債合計	75,445,433	481,594,734
純資産の部		
元本等		
元本	8,533,495,513	8,655,015,207
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	14,949,409,271	12,516,143,508
元本等合計	23,482,904,784	21,171,158,715
純資産合計	23,482,904,784	21,171,158,715
負債純資産合計	23,558,350,217	21,652,753,449

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28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1. 期首	平成27年 1月14日	平成28年 1月13日
期首元本額	12,297,586,503円	8,533,495,513円
期首からの追加設定元本額	1,136,650,602円	2,055,106,863円
期首からの一部解約元本額	4,900,741,592円	1,933,587,169円
元本の内訳		
GW 7つの卵	3,696,486,835円	3,849,660,180円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	110,935,274円	118,930,779円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	258,194,730円	275,914,947円

グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	1,978,075,153円	1,945,787,460円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	835,171,362円	792,988,423円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	1,120,155,974円	1,070,668,184円
欧州先進国株式ファンド	40,093,281円	39,512,971円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	23,663,082円	31,001,574円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	50,203,534円	61,624,853円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	76,722,032円	90,561,807円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	181,627,936円	200,683,445円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	162,166,320円	177,680,584円
計	8,533,495,513円	8,655,015,207円
2. 受益権の総数	8,533,495,513口	8,655,015,207口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7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

（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	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

(平成28年 7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	18,660,067	-	19,015,767	355,700
	ユーロ	18,660,067	-	19,015,767	355,700
	売建	18,660,067	-	19,077,307	417,240
	英ポンド	18,660,067	-	19,077,307	417,240
	合計	37,320,134	-	38,093,074	61,540

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成28年 1月12日現在		平成28年 7月12日現在	
1口当たり純資産額	2.7519円	1口当たり純資産額	2.4461円
(1万口当たり純資産額)	(27,519円)	(1万口当たり純資産額)	(24,461円)

アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	-	46,801,571
コール・ローン	221,423,014	137,860,572
株式	6,967,896,944	6,903,502,200
投資証券	83,087,085	91,669,838
派生商品評価勘定	118,080	-
未収入金	27,487,851	-
未収配当金	5,323,672	7,314,588
未収利息	371	-
流動資産合計	7,305,337,017	7,187,148,769
資産合計	7,305,337,017	7,187,148,769
負債の部		
流動負債		
未払解約金	128,758,251	4,257,876
未払利息	-	153
流動負債合計	128,758,251	4,258,029
負債合計	128,758,251	4,258,029
純資産の部		
元本等		
元本	1,502,203,581	1,512,564,275
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,674,375,185	5,670,326,465
元本等合計	7,176,578,766	7,182,890,740
純資産合計	7,176,578,766	7,182,890,740
負債純資産合計	7,305,337,017	7,187,148,769

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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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) 金融商品取引所等の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28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1.	期首	平成27年 1月14日	平成28年 1月13日
	期首元本額	2,074,036,902円	1,502,203,581円
	期首からの追加設定元本額	260,866,177円	331,866,479円
	期首からの一部解約元本額	832,699,498円	321,505,785円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	613,484,608円	643,440,987円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	19,140,071円	20,720,178円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	46,819,638円	48,590,009円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	337,360,025円	325,240,046円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	171,165,224円	160,269,290円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	203,734,817円	194,535,107円
	アジア太平洋先進国株式ファンド	18,359,499円	17,868,022円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	4,652,964円	6,003,836円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	8,638,839円	10,725,919円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	13,986,929円	15,932,891円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	31,225,131円	33,522,375円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	33,635,836円	35,715,615円
	計	1,502,203,581円	1,512,564,275円
2.	受益権の総数	1,502,203,581口	1,512,564,275口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7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 「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 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 該当事項はありません。</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>

（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。

（平成28年 7月12日現在）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成28年 1月12日現在		平成28年 7月12日現在	
1口当たり純資産額	4.7774円	1口当たり純資産額	4.7488円
(1万口当たり純資産額)	(47,774円)	(1万口当たり純資産額)	(47,488円)

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	404,054,802	214,728,457
コール・ローン	11,097,002	725,809,409
国債証券	13,115,419,259	11,208,332,048
特殊債券	379,924,693	276,467,537
社債券	1,563,846,230	1,042,516,709
派生商品評価勘定	105,857,206	60,649,157
未収利息	122,858,986	84,123,573
前払費用	11,203,039	3,392,530
差入委託証拠金	347,239,324	177,275,824
流動資産合計	16,061,500,541	13,793,295,244
資産合計	16,061,500,541	13,793,295,244
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	91,149,907	49,178,619
未払金	43,562,028	545,651,399
未払解約金	284,474,523	14,822,164
未払利息	-	809
流動負債合計	419,186,458	609,652,991
負債合計	419,186,458	609,652,991
純資産の部		
元本等		
元本	6,335,246,625	5,766,221,955
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,307,067,458	7,417,420,298
元本等合計	15,642,314,083	13,183,642,253
純資産合計	15,642,314,083	13,183,642,253
負債純資産合計	16,061,500,541	13,793,295,244

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28年 1月12日現在	平成28年 7月12日現在
1.	期首	平成27年 1月14日	平成28年 1月13日
	期首元本額	6,619,810,227円	6,335,246,625円
	期首からの追加設定元本額	1,143,755,887円	1,176,530,863円
	期首からの一部解約元本額	1,428,319,489円	1,745,555,533円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	3,072,533,548円	2,859,566,076円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	141,616,086円	136,467,877円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	260,477,491円	244,178,840円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	1,670,931,233円	1,444,993,953円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	672,370,458円	565,239,783円
	海外債券ファンド	52,972,636円	52,767,830円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	32,722,553円	37,084,222円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	64,446,203円	70,570,936円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	78,042,875円	79,981,972円

年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	156,138,899円	148,913,234円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	132,994,643円	126,457,232円
計	6,335,246,625円	5,766,221,955円
2. 受益権の総数	6,335,246,625口	5,766,221,955口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 1月12日現在	平成28年 7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

（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

(平成28年 7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	1,596,544,412	-	1,608,427,692	11,883,280
	売建	544,443,059	-	552,824,103	8,381,044
	合計	2,140,987,471	-	2,161,251,795	3,502,236

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(平成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

(平成28年 7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	3,269,613,082	-	3,285,629,099	16,016,017
	米ドル	2,030,746,443	-	2,038,848,410	8,101,967
	加ドル	30,922,077	-	30,527,697	394,380
	メキシコペソ	102,875,178	-	102,063,420	811,758
	ユーロ	580,541,791	-	590,687,143	10,145,352
	英ポンド	316,088,888	-	313,086,830	3,002,058

スウェーデンク ローナ	48,112,516	-	47,887,840	224,676
ノルウェークロー ネ	30,864,476	-	30,572,100	292,376
豪ドル	111,443,296	-	113,779,109	2,335,813
ニュージーランド ドル	18,018,417	-	18,176,550	158,133
売建	2,519,943,691	-	2,527,960,606	8,016,915
米ドル	1,272,446,657	-	1,284,850,258	12,403,601
加ドル	26,672,650	-	26,574,400	98,250
ユーロ	466,482,895	-	471,860,503	5,377,608
英ポンド	245,668,220	-	239,293,780	6,374,440
スイスフラン	34,890,600	-	34,937,150	46,550
スウェーデンク ローナ	46,836,510	-	46,512,440	324,070
ノルウェークロー ネ	42,855,700	-	41,908,500	947,200
デンマーククロー ネ	62,073,180	-	59,239,320	2,833,860
ポーランドズロチ	21,277,590	-	20,923,370	354,220
豪ドル	130,247,049	-	131,768,385	1,521,336
ニュージーランド ドル	122,843,150	-	123,155,400	312,250
シンガポールドル	47,649,490	-	46,937,100	712,390
合計	5,789,556,773	-	5,813,589,705	7,999,102

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(金利関連)

(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

(平成28年 7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				
	売建	76,432,682	-	76,463,482	30,800
合計		76,432,682	-	76,463,482	30,800

(注) 1. 時価の算定方法

金利先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 金利先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成28年 1月12日現在		平成28年 7月12日現在	
1口当たり純資産額	2.4691円	1口当たり純資産額	2.2864円
(1万口当たり純資産額)	(24,691円)	(1万口当たり純資産額)	(22,864円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2016年 7月29日現在です。

【GW7つの卵】

【純資産額計算書】

資産総額	65,102,129,286円
負債総額	126,962,229円
純資産総額（ - ）	64,975,167,057円
発行済口数	65,609,862,937口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9903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	33,426,879,597円
負債総額	26,684,656円
純資産総額（ - ）	33,400,194,941円
発行済口数	19,735,078,539口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6924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	12,205,465,742円
負債総額	1,983,288円
純資産総額（ - ）	12,203,482,454円
発行済口数	3,004,334,061口
1口当たり純資産額（ / ）	4.0620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	24,574,669,593円
------	-----------------

負債総額	100,000,351円
純資産総額（ - ）	24,474,669,242円
発行済口数	17,497,861,745口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3987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	28,269,858,349円
負債総額	67,705,008円
純資産総額（ - ）	28,202,153,341円
発行済口数	13,947,662,785口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0220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	21,804,196,464円
負債総額	70,089,184円
純資産総額（ - ）	21,734,107,280円
発行済口数	8,514,682,470口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5525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	7,535,498,552円
負債総額	28,126,278円
純資産総額（ - ）	7,507,372,274円
発行済口数	1,490,643,139口
1口当たり純資産額（ / ）	5.0363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	13,467,471,102円
------	-----------------

負債総額	67,476,950円
純資産総額（ - ）	13,399,994,152円
発行済口数	5,762,318,567口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3255円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

(1) 資本金の額

平成28年7月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（平成28年7月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。

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

・監査役会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（平成28年7月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・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】

<更新後>

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。

・委託会社の運用する、平成28年7月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	631	113,737
株式投資信託	581	91,617
単位型	131	4,941
追加型	450	86,676
公社債投資信託	50	22,119
単位型	36	450
追加型	14	21,669

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
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57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

<更新後>

	第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28年3月31日)	
(単位：百万円)				
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	14,206	3	14,308
金銭の信託		-	3	153
有価証券		277		86
前払費用	3	509	3	489
未収入金		3		10
未収委託者報酬		8,441		9,374
未収収益	3	1,566	3	2,280
関係会社短期貸付金		436		5,333
立替金		666		2,960
繰延税金資産		1,446		819
その他	2	195	2,3	428
流動資産合計		27,750		36,243
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	56	1	146
器具備品	1	166	1	210

有形固定資産合計	222	356
無形固定資産		
ソフトウェア	113	140
無形固定資産合計	113	140
投資その他の資産		
投資有価証券	14,184	12,195
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	740	781
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	248	425
投資その他の資産合計	36,936	35,165
固定資産合計	37,273	35,662
資産合計	65,023	71,905

(単位：百万円)

	第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	387	410
未払金	5,545	3,841
未払収益分配金	6	6
未払償還金	112	112
未払手数料	3 3,145	3 3,269
その他未払金	2,282	453
未払費用	3 4,636	3 4,920
未払法人税等	814	354
未払消費税等	4 1,070	4 649
関係会社短期借入金	-	5,631
賞与引当金	1,990	2,080
役員賞与引当金	120	145
その他	3 82	3 278
流動負債合計	14,646	18,312
固定負債		
退職給付引当金	1,111	1,154
固定負債合計	1,111	1,154
負債合計	15,758	19,466
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	25,836	29,948

利益剰余金合計	25,836	29,948
自己株式	68	502
株主資本合計	48,351	52,028
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,002	151
繰延ヘッジ損益	88	258
評価・換算差額等合計	913	410
純資産合計	49,265	52,438
負債純資産合計	65,023	71,905

(2) 【損益計算書】

< 更新後 >

	(単位：百万円)	
	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	63,990	66,339
その他営業収益	3,729	4,382
営業収益合計	67,719	70,722
営業費用		
支払手数料	30,408	30,529
広告宣伝費	1,045	1,098
公告費	5	3
調査費	15,571	17,470
調査費	747	821
委託調査費	14,782	16,600
図書費	41	48
委託計算費	502	505
営業雑経費	660	718
通信費	199	195
印刷費	263	321
協会費	64	65
諸会費	27	22
その他	106	113
営業費用計	48,193	50,327
一般管理費		
給料	7,585	8,138
役員報酬	289	365
役員賞与引当金繰入額	120	145
給料・手当	5,127	5,495
賞与	59	51
賞与引当金繰入額	1,990	2,080
交際費	163	185
寄付金	36	27
旅費交通費	503	503
租税公課	208	258
不動産賃借料	785	875
退職給付費用	349	372

退職金	16	113
固定資産減価償却費	148	196
福利費	908	952
諸経費	2,673	2,952
一般管理費計	13,380	14,577
営業利益	6,146	5,817

(単位：百万円)

	第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		10		91
受取配当金	1	1,152	1	1,330
有価証券償還益		13		-
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		-		32
その他		107		32
営業外収益合計		1,285		1,488
営業外費用				
支払利息		28		242
有価証券償還損		81		-
デリバティブ費用		269		69
時効成立後支払分配金・償還金		295		5
支払源泉所得税		71		119
為替差損		26		-
その他		21		94
営業外費用合計		795		531
経常利益		6,636		6,774
特別利益				
投資有価証券売却益		270		720
その他		-		0
特別利益合計		270		720
特別損失				
投資有価証券売却損		22		100
固定資産処分損		0		6
特別賞与		-		204
割増退職金		243		91
役員退職一時金		-		64
外国税関連費用	2	1,650		-
特別損失合計		1,916		467
税引前当期純利益		4,991		7,027
法人税、住民税及び事業税		2,356		1,359
法人税等調整額		466		706
法人税等合計		1,890		2,065
当期純利益		3,101		4,962

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

< 更新後 >

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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	22,694	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

第57期（自 平成27年4月1日 至 平成28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	利益剰余金合計	自己株式	株主資本合計
				剰余金 繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	25,836	25,836	68	48,351
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	25,836	25,836	68	48,351
当期変動額							
剰余金の配当				850	850		850
当期純利益				4,962	4,962		4,962
自己株式の取得						434	434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,111	4,111	434	3,676
当期末残高	17,363	5,220	5,220	29,948	29,948	502	52,028

	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
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	1,002	88	913	49,265
当期変動額				
剰余金の配当				850
当期純利益				4,962
自己株式の取得				434
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	851	347	503	503
当期変動額合計	851	347	503	3,173
当期末残高	151	258	410	52,438

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1 資産の評価基準及び 評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>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>				
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。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>5年～20年</td> </tr> </table> <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>	建物	3年～15年	器具備品	5年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	5年～20年				
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。</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。</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の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)

第57期
(自 平成27年4月1日
至 平成28年3月31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。）等を当事業年度から適用し、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いたしました。また、当事業年度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事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更いたします。

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、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、当事業年度において、財務諸表及び1株当たり情報に与える影響額はありません。

（未適用の会計基準等）

- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件

（分類2）に該当する企業におけるスケジュールリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

（分類3）に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

（分類4）に係る分類の要件を満たす企業が（分類2）又は（分類3）に該当する場合の取扱い

（2）適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
1 有形固定資産の減価償却累計額	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 1,122百万円	建物 1,170百万円
器具備品 679百万円	器具備品 653百万円
2 信託資産	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。	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 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。	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。
(流動資産)	(流動資産)
現金・預金 4,256百万円	現金・預金 4,072百万円
前払費用 2百万円	金銭の信託 153百万円
未収収益 110百万円	前払費用 2百万円
(流動負債)	未収収益 147百万円
未払手数料 108百万円	その他 193百万円
未払費用 500百万円	(流動負債)
その他 57百万円	未払手数料 93百万円
	未払費用 722百万円
	その他 266百万円

<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務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>	<p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務728百万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689百万円に対して保証を行っております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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 style="text-align: right;">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>	<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 style="text-align: right;">受取配当金 1,193百万円 支払利息 123百万円 デリバティブ費用 889百万円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

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

	新株予約権の目的となる株式の数(株)	当事業
--	--------------------	-----

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	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	年度末残高(百万円)
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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	704,500	-	814,100

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	-	14,140,500	1,762,200	-
平成21年度 ストックオプション (2)	普通株式	1,567,500	-	1,392,600	174,900	-

平成22年度 ストックオプション (1)	普通株式	2,310,000	-	2,310,000	-	-
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	-	18,133,500	6,675,900	-

(注) 1 当事業年度の減少は、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)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2) 174,900株及び平成23年度ストックオプション(1)4,738,800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28年5月30日 取締役会	普通株式	利益 剰余金	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22日

(リース取引関係)

第56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28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	841百万円	1年内	865百万円
1年超	3,420百万円	1年超	2,653百万円
合計	4,261百万円	合計	3,518百万円

(金融商品関係)

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	(57)	(57)	-
デリバティブ取引計	(82)	(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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

(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、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。さらに、外貨建ての関係会社短期借入金に関しては、為替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。

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28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	14,308	14,308	-
(2) 未収委託者報酬	9,374	9,374	-
(3) 未収収益	2,280	2,280	-
(4) 関係会社短期貸付金	5,333	5,333	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	12,265	12,265	-

(6) 未払金	(3,841)	(3,841)	-
(7) 未払費用	(4,920)	(4,920)	-
(8) 関係会社短期借入金	(5,631)	(5,631)	-
(9) 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	(254)	(254)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	170	170	-
デリバティブ取引計	(84)	(84)	-

(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(4) 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。

(5) 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。

(6) 未払金、(7) 未払費用並びに(8) 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。

(9) 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、ヘッジ会計が適用されないものは貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また、ヘッジ会計が適用されるもののうち193百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、23百万円は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、「(4)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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	14,308			
未収委託者報酬	9,374			
未収収益	2,280			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	86	714	1,766	963
合計	26,049	714	1,766	963

(有価証券関係)

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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	5,593	4,872	720
	小計	5,593	4,872	720
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	6,672	7,175	502
	小計	6,672	7,175	502

合計	12,265	12,047	218
----	--------	--------	-----

(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 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。

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	30	17	-
投資信託	5,442	703	100
合計	5,473	720	100

(デリバティブ取引関係)

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)
原則的処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	2,586	-	68
	豪ドル		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。

第57期(平成28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	1,093	-	11	11
	買建	-	-	-	-
合計		1,093	-	11	11

- (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)
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建 米ドル	5,631	-	243	243
合計		5,631	-	243	243

- (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				
	米ドル	投資有価証券	3,943	-	179
	豪ドル		767	-	18
	シンガポールドル		75	-	4
	香港ドル		151	-	5
	人民元		1,948	-	8
ユーロ	173		-	0	
合計			7,060	-	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。

(持分法損益等)

第56期 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	第57期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28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 3,078	(1) 関連会社に対する投資の金額 3,037
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,396	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 9,686
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,720	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,901

(退職給付関係)

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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	1,233
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期首残高	1,233
勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	33
退職給付の支払額	119
退職給付債務の期末残高	1,299

(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	1,299
未積立退職給付債務	1,299
未認識数理計算上の差異	144
貸借対照表に計上された負債の額	1,154
退職給付引当金	1,154
貸借対照表に計上された負債の額	1,154

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	145
利息費用	7
数理計算上の差異の費用処理額	9
確定給付制度に係る退職給付費用	162

(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 0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、209百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第56期(自 平成26年4月1日 至 平成27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	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57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	14,140,500	1,392,600
権利確定	0	0
権利未確定残	1,762,200	174,900
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	5,029,200
付与	0	0
失効	2,310,000	290,400
権利確定	0	0
権利未確定残	0	4,738,800
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。

(税効果会計関係)

第56期 (平成27年3月31日)		第57期 (平成28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 658		賞与引当金 642
	その他 813		その他 177
	小計 1,472		小計 819
	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 134		投資有価証券評価損 96
	関係会社株式評価損 1,510		関係会社株式評価損 1,430
	退職給付引当金 360		退職給付引当金 353
	固定資産減価償却費 133		固定資産減価償却費 122
	その他 73		その他 65
	小計 2,213		小計 2,068
	繰延税金資産小計 3,685		繰延税金資産小計 2,888
	評価性引当金 1,510		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 2,174		繰延税金資産合計 1,457
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金 25		その他有価証券評価差額金 71
	小計 25		繰延ヘッジ利益 114
			その他 26
			小計 213
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債合計 213
	その他有価証券評価差額金 454		繰延税金資産の純額 1,244
	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 35.6%		法定実効税率 33.1%
	(調整)		(調整)
	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 1.4%
	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 4.8%
	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 1.3%
	海外子会社の留保利益の影響額 等 1.7%		所得拡大促進税制 2.2%
	税効果会計適用後の法人税等の 負担率 37.9%		海外子会社の留保利益の影響額 等 0.6%
			税効果会計適用後の法人税等の 負担率 29.4%

第56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成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。</p>	<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28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28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.9%に、平成30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30.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が59百万円減少し、その他有価証券評価差額金が3百万円、繰延ヘッジ損益が6百万円、法人税等調整額が69百万円、それぞれ増加しております。</p>

(関連当事者情報)

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SGD11,000千、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

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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	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(千SGD)	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)	90(千SGD1,000)(注2)	関係会社短期貸付金	333(千SGD4,000)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	18(千SGD215)	未収収益	6(千SGD74)
							資金の貸付(円貨建)(注3)	5,000	関係会社短期貸付金	5,000
							貸付金利息(円貨建)(注3)	70	未収収益	70
	Nikko Asset	アメリカ	181,542	アセット	直接	資金の借入	6,176(千USD50,000)(注5)	関係会社短期借入金	5,631(千USD50,000)	

子会社	Management Americas, Inc.	カ合衆国	(千USD) (注4)	マネジメント業	100.00	借入	借入金利息 (米ドル 貸建) (注5)	113 (千 USD 949)	未払費用	106 (千 USD 949)
-----	---------------------------	------	----------------	---------	--------	----	------------------------------	-----------------------	------	-----------------------

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠SGD11,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 資金の貸付に係る取引金額 90百万円 (SGD 1,000千) の内訳は、貸付957百万円 (SGD11,000千) 及び返済1,047百万円 (SGD12,000千) であります。
- 3 融資枠5,000百万円、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。
- 4 Nikko Asset Management Americas, Inc.の「資本金」は、資本金と資本剰余金の合計額を記載しております。
- 5 融資枠USD50,000千、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 (東京証券取引所等に上場)
三井住友信託銀行株式会社 (非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成27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	30,897百万円
負債合計	9,936百万円
純資産合計	20,960百万円
営業収益	26,843百万円
税引前当期純利益	9,553百万円
当期純利益	6,411百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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。

第57期(自 平成27年4月1日 至 平成28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56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	250円20銭	267円27銭
1株当たり当期純利益金額	15円74銭	25円25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いません。

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56期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第57期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益（百万円）	3,101	4,962
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）	3,101	4,962
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,903	196,464
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、平成23年度ストックオプション(1)5,029,200株	平成21年度ストックオプション(1)1,762,200株、平成21年度ストックオプション(2)174,900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56期 (平成27年3月31日)	第57期 (平成28年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	49,265	52,438
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）	49,265	52,438
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	196,198

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容

野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
------------	-----------	---

< 更新後 >

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
あかつき証券株式会社	3,067百万円	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	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
S M B C フレンド証券株式会社	27,270百万円	
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
ちばぎん証券株式会社	4,374百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
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	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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	10,000百万円	
株式会社山口銀行	10,005百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	
三井生命保険株式会社 1	167,280百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
全国信用協同組合連合会	59,155百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

1 募集の取扱いを行いません。

< 更新後 >

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額	事業の内容
ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー	664百万米ドル (平成27年12月末現在)	

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)	資産運用に関する業務を 営んでいます。
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28年3月末現在)	
日興グローバルラップ株式会社	1,499百万円 (平成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28年3月末現在)	

3【資本関係】

<更新後>

(2) 販売会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(平成28年3月末現在)

<更新後>

(3) 投資顧問会社

三井住友信託銀行株式会社は、日興アセットマネジメント株式会社の発行済株式総数の91.29%を保有しております。(平成28年3月末現在)

日興アセットマネジメント株式会社の100%子会社である持株会社が、日興アセットマネジメント アメリカズ・インクの発行済株式総数の100%を保有しております。(平成28年3月末現在)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月25日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w Cあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員指定有限責任社員 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28年1月13日から平成28年7月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、GW7つの卵の平成28年7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中間計算期間（平成28年1月13日から平成28年7月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 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28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。