

【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】	2018年10月10日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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】	新屋敷 昇
【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2018年4月10日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

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

第一部【証券情報】

(5) 【申込手数料】

<訂正前>

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

(略)

<訂正後>

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

(略)

(6) 【申込単位】

<訂正前>

販売会社または「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

<訂正後>

販売会社の照会先にお問い合わせください。

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*1を考えます。



分散投資効果をもとめ、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(1997年～2017年、円ベース)]

(%)

	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	
株式	日本大型株式	-13.2	-5.5	57.0	-23.0	-18.6	-18.1	22.8	10.2	44.5	6.3	-9.8	-42.3	7.7	1.0	-18.6	20.5	54.8	9.8	11.7	-0.2	21.0
	日本小型株式	-42.7	2.5	40.7	-6.4	-7.9	-10.4	36.6	21.8	57.7	-13.5	-16.0	-33.2	8.8	4.2	-7.1	18.4	52.9	13.1	16.1	4.8	30.2
	北米株式	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	8.9	17.5
	欧州先進国株式	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	-2.8	21.9
	アジア太平洋先進国株式	-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	4.7	21.7
債券	日本債券	5.7	0.4	5.4	2.1	3.3	3.3	-0.7	1.3	0.8	0.2	2.7	3.4	1.4	2.4	1.9	1.9	2.0	4.2	1.1	3.0	0.2
	海外債券	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	-3.0	4.7

※表は、各資産のインデックスの年間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*1。

*1 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*2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。

*2 「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193兆円(2017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個別投資する。グループ全体での運用資産総額は約1兆2,140億円(2017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

綿密なファンダメンタルズ分析に基づく銘柄選択に重点を置く株式運用

ニューヨーク証券取引所およびオーストラリア証券取引所に上場しているグローバル・アクティブ運用会社であるジャナス・ヘンダーソン・グループの一員。同グループの総運用資産総額は約42兆円(2017年12月末現在)。ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーの株式運用は、企業利益の中長期的成長性や競争優位性の高い銘柄を見極め、より多くの情報とアナリストが推奨する最良の投資アイデアの中から、ボトムアップアプローチによる銘柄選択によって超過収益の獲得を目指す。

Janus Henderson
INVESTORS

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

●MFSインターナショナル(U.K.)リミテッド

米国最古の運用会社であるMFSグループの英国法人

MFSグループは世界各地にリサーチ拠点を置くグローバルな運用会社で、米国投信の産みの親として長い歴史を持つ。産業・企業の徹底したファンダメンタルズ分析を行ない、継続的に高い収益成長が期待できるクオリティの高い企業を発見し、相対的に割安な株価水準で組み入れを図る。グループ全体の運用資産総額は約55兆円(2017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59兆円(2017年6月末現在)。

Schroders

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

●三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

国内唯一の専業信託銀行グループである「三井住友トラスト・グループ」の中核を成す資産運用会社

三井住友トラスト・アセットマネジメントは、三井住友トラスト・グループの中核を成す資産運用会社であり、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。三井住友トラスト・アセットマネジメントにおける運用資産総額は約9.7兆円(2018年6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122兆円(2017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…………… ラッセル野村大型インデックス
- 日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド…………… ラッセル野村小型インデックス
- 北米株式グローバル・ラップマザーファンド…………… MSCI北米インデックス(ヘッジなし・円ベース*)
- 欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド…………… MSCI欧州インデックス(ヘッジなし・円ベース*)
- アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド…………… MSCI太平洋フリー・インデックス
(日本を除く、ヘッジなし・円ベース*)
- 日本債券グローバル・ラップマザーファンド…………… NOMURA-BPI総合
- 海外債券グローバル・ラップマザーファンド…………… FTSE世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース*)

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

※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。

※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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)



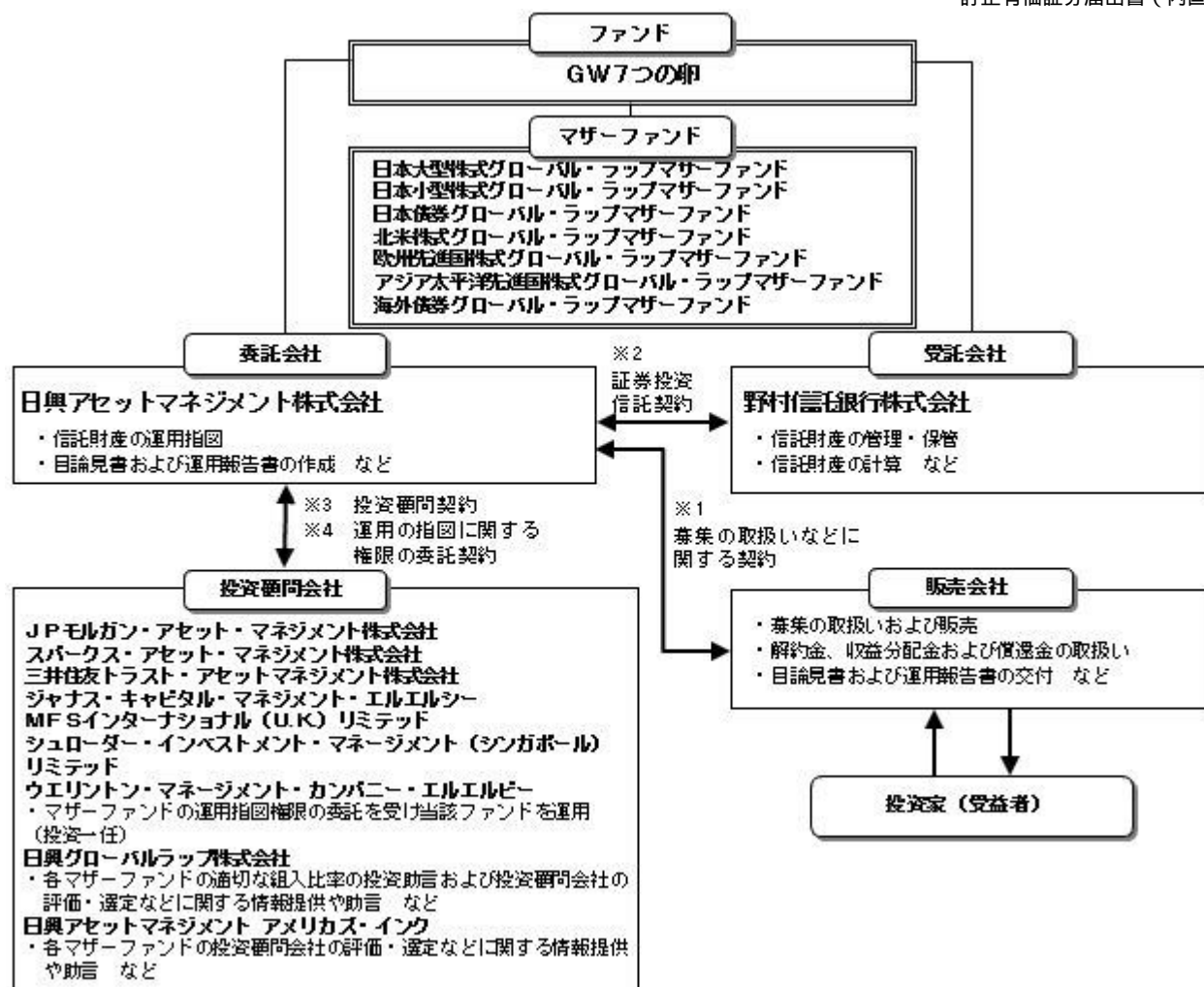
スペシャルレビュー
(原則毎年1月作成)

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>

ファンドの仕組み



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

< 更新後 >

委託会社の概況（2018年7月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999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>

(略)

<日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド>

(略)

<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（NOMURA-BPI総合 [*] ）を上回る投資成果の獲得をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> わが国の公社債を中心に投資を行ない、安定したインカム（利子等収益）の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。 国債、政府保証債、金融債などで核となるポートフォリオを構築し、社債への投資にあたっては、企業の信用度調査を充分に行ない、流動性、銘柄分散も考慮したうえで、ポートフォリオ全体のリスクの低減につとめます。 公社債の組入比率は原則として高位を維持します。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用を行なうことができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
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	三井住友トラスト・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（2001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）

* NOMURA-BPI 総合は、野村証券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限りません。

同指数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。

< 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 >

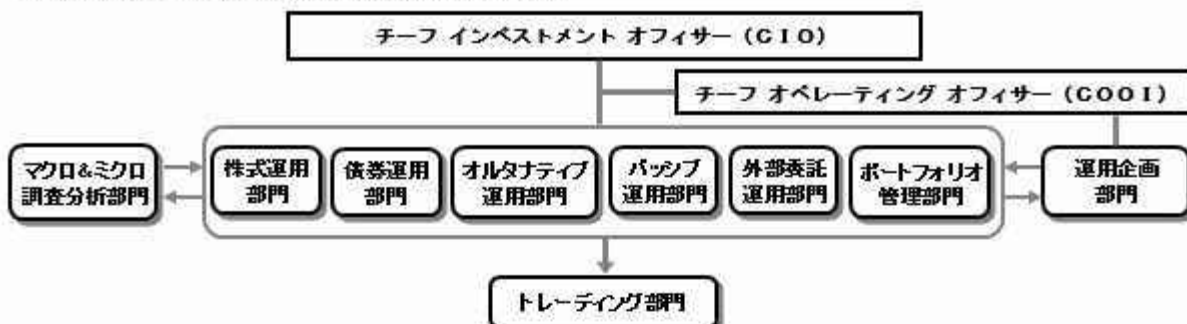
（略）

（3）【運用体制】

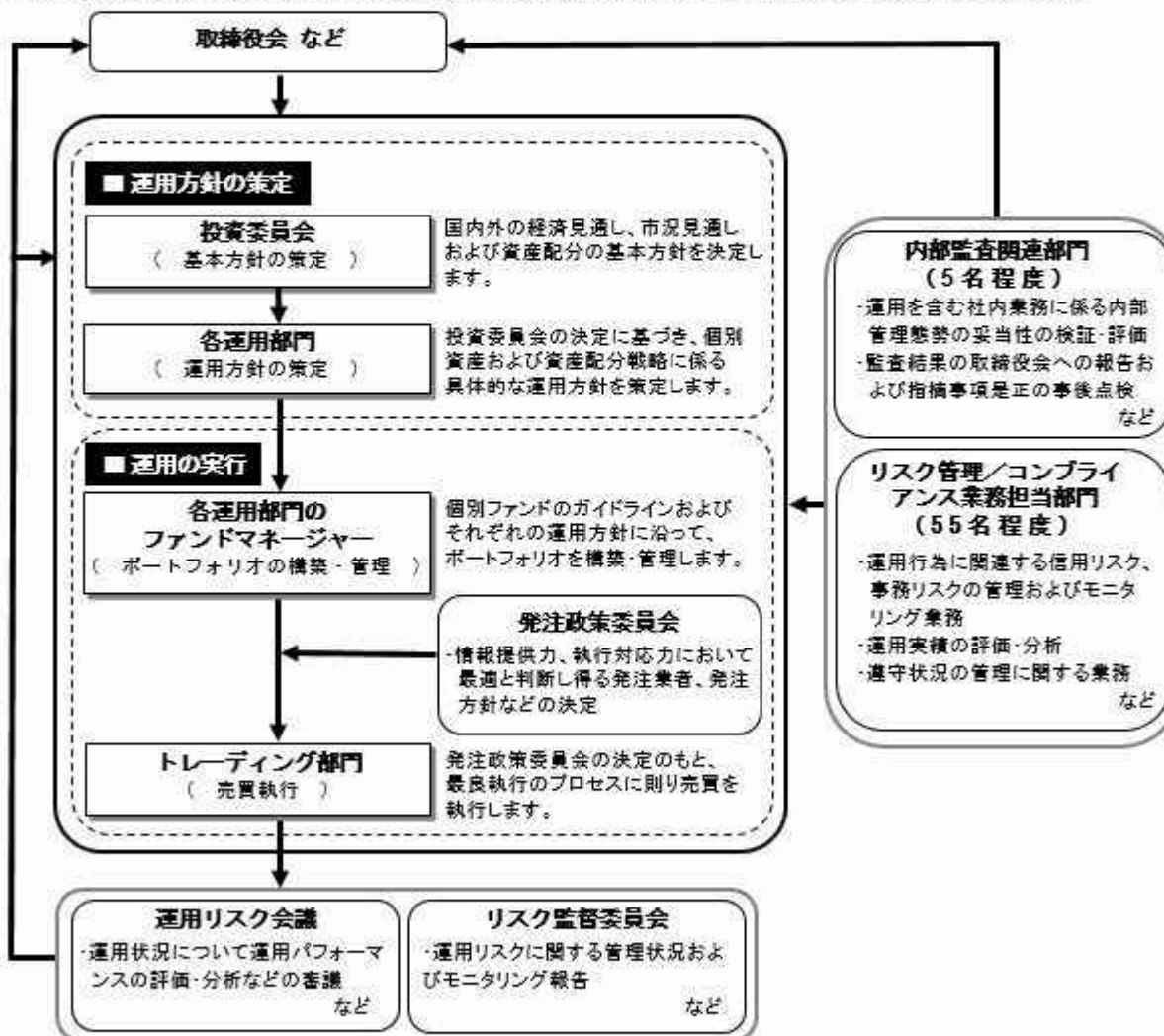
< 更新後 >

< 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なっております。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などのモニタリングを行なっております。

上記体制は2018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 >

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

以下の内容は、各社提供の情報に基づいて作成しています。

～（略）

「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」の運用は、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式

会社に委託します。

三井住友トラスト・アセットマネジメントは、三井住友トラスト・グループの中核を成す資産運用会社であり、資産運用で高い専門性を有しています。長期的な市場動向が中短期的な「市場テーマ（＝市場が注目する材料）」の積み重ねにより構成されていると考えており、マーケット動向、マクロ動向、クレジット動向の丹念な調査・分析により、独自に市場テーマを追求し、投資行動に効果的に反映することで超過収益の獲得をめざします。三井住友トラスト・アセットマネジメントにおける運用資産総額は約9.7兆円（2018年6月末現在）にのびります。

～（略）

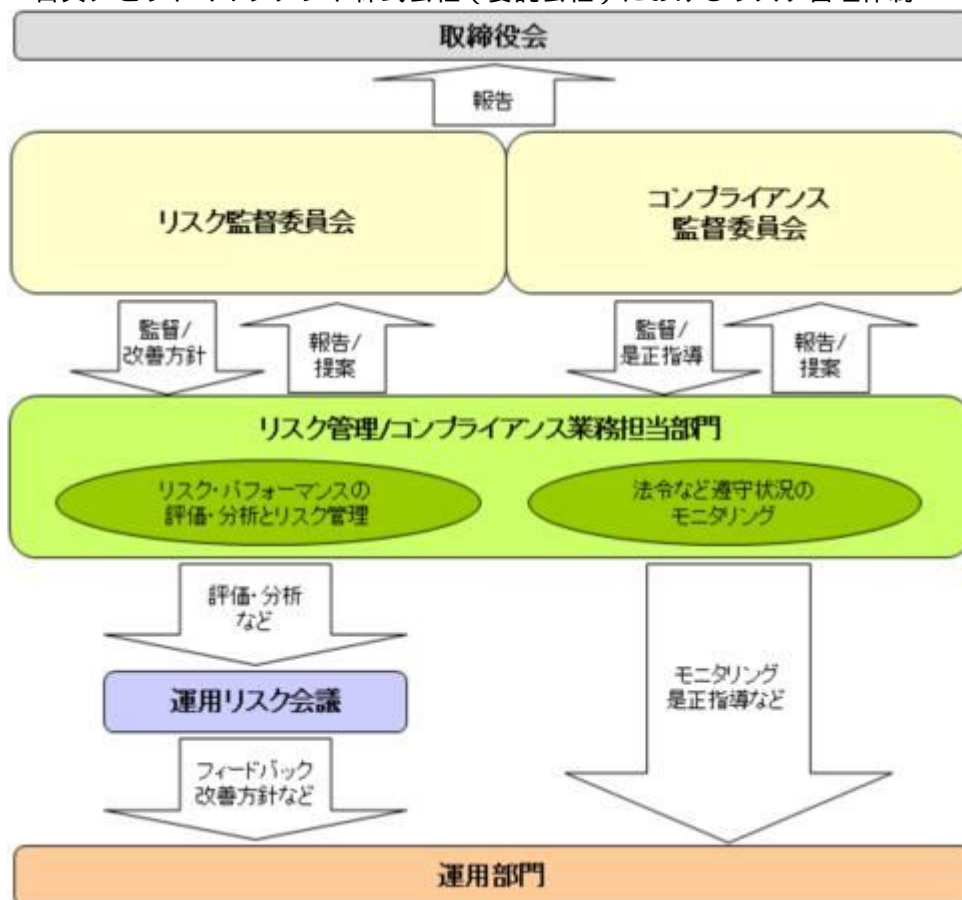
（略）

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会議においては、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リスク会議に報告し、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

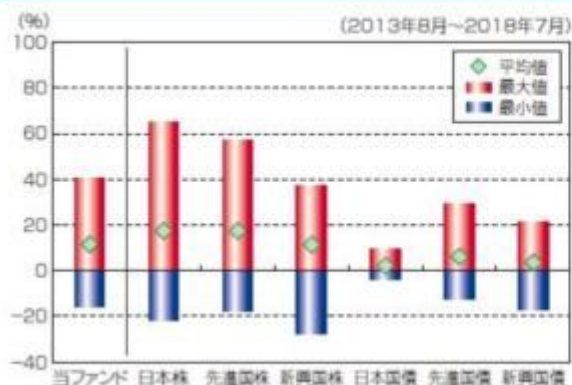
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2018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	11.6%	17.3%	17.5%	11.4%	2.2%	6.2%	3.6%
最大値	40.5%	65.0%	57.1%	37.2%	9.3%	29.1%	21.4%
最小値	-16.0%	-22.0%	-17.5%	-27.4%	-4.0%	-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2013年8月から2018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)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……東証株価指数(TOPIX、配当込)

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013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)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

東証株価指数(TOPIX、配当込)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-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。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

4【手数料等及び税金】**（1）【申込手数料】****<訂正前>**

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

（略）

<訂正後>

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

（略）

（3）【信託報酬等】**<訂正前>****支払時期**

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

<訂正後>**支払時期**

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

（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ます。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）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

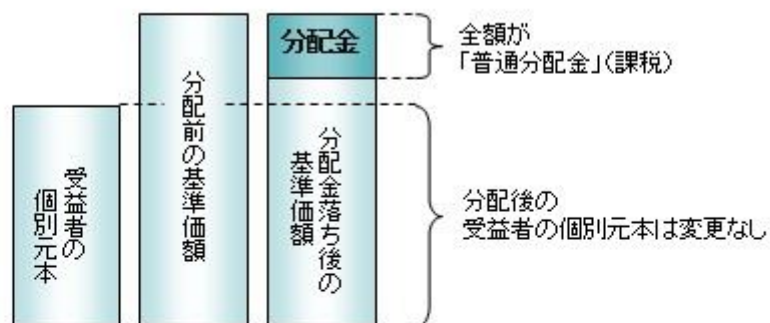
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

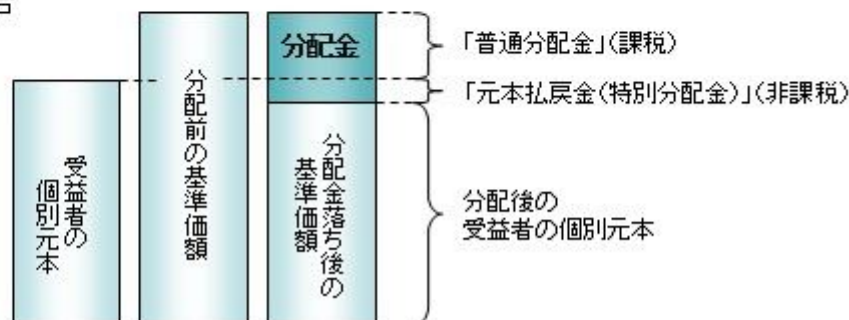
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - 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2018年10月10日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【GW7つの卵】

以下の運用状況は2018年7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	57,215,241,045	98.32
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		979,877,411	1.68
合計(純資産総額)		58,195,118,456	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	5,973,616,566	2.5141	15,018,385,800	2.3343	13,944,213,150	23.96

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	3,920,551,445	2.7943	10,955,513,741	2.8992	11,366,462,749	19.53
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	2,655,700,232	3.6006	9,562,289,977	3.6092	9,584,953,277	16.47
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	6,839,799,915	1.3727	9,388,993,344	1.3835	9,462,863,182	16.26
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	2,182,619,997	2.5429	5,550,303,325	2.4925	5,440,180,342	9.35
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	666,273,960	7.1899	4,790,443,146	6.9731	4,645,994,950	7.98
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	394,219,322	7.1218	2,807,569,505	7.0280	2,770,573,395	4.76

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.32
合計	98.32

【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
第14計算期間末 (2017年 1月10日)	64,401	67,480	1.0457	1.0957
第15計算期間末 (2018年 1月10日)	56,056	63,867	1.0765	1.2265
2017年 7月末日	62,242		1.1021	
8月末日	61,521		1.1012	
9月末日	62,387		1.1346	
10月末日	62,211		1.1626	

11月末日	62,230		1.1797
12月末日	62,804		1.2040
2018年 1月末日	58,644		1.0636
2月末日	56,942		1.0318
3月末日	55,639		1.0100
4月末日	56,960		1.0364
5月末日	56,707		1.0303
6月末日	56,751		1.0288
7月末日	58,195		1.0463

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
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
第14期	2016年 1月13日～2017年 1月10日	0.0500
第15期	2017年 1月11日～2018年 1月10日	0.1500
当中間期	2018年 1月11日～2018年 7月10日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第14期	2016年 1月13日～2017年 1月10日	8.14
第15期	2017年 1月11日～2018年 1月10日	17.29
当中間期	2018年 1月11日～2018年 7月10日	3.33

(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
第14期	2016年 1月13日～2017年 1月10日	2,093,430,717	8,531,237,609
第15期	2017年 1月11日～2018年 1月10日	2,591,306,295	12,103,089,879
当中間期	2018年 1月11日～2018年 7月10日	5,404,557,173	2,214,847,863

(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2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	30,769,530,930	99.14
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		268,212,991	0.86
合計(純資産総額)		31,037,743,921	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	日本電信電話	情報・通信業	246,400	4,927.98	1,214,254,455	5,168.00	1,273,395,200	4.10
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,597,700	690.21	1,102,750,462	689.40	1,101,454,380	3.55

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	316,400	3,491.62	1,104,750,843	3,355.00	1,061,522,000	3.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	278,000	2,845.73	791,115,491	3,117.00	866,526,000	2.79
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	183,300	4,451.33	815,929,322	4,445.00	814,768,500	2.63
日本	株式	ソニー	電気機器	130,600	5,082.57	663,784,493	5,828.00	761,136,800	2.45
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	139,300	4,813.99	670,589,598	5,301.00	738,429,300	2.38
日本	株式	ダイキン工業	機械	55,300	11,626.85	642,964,805	13,320.00	736,596,000	2.37
日本	株式	第一三共	医薬品	157,200	3,608.94	567,326,259	4,622.00	726,578,400	2.34
日本	株式	日立製作所	電気機器	929,000	764.36	710,097,575	778.60	723,319,400	2.33
日本	株式	キーエンス	電気機器	12,200	63,896.66	779,539,334	58,910.00	718,702,000	2.32
日本	株式	花王	化学	88,100	7,609.56	670,402,471	8,137.00	716,869,700	2.31
日本	株式	パナソニック	電気機器	479,900	1,568.50	752,727,620	1,438.00	690,096,200	2.22
日本	株式	スズキ	輸送用機器	98,600	5,602.52	552,409,020	6,551.00	645,928,600	2.08
日本	株式	アサヒグループホールディングス	食料品	118,400	5,497.13	650,860,224	5,422.00	641,964,800	2.07
日本	株式	日本電産	電気機器	39,500	15,860.00	626,470,000	16,180.00	639,110,000	2.06
日本	株式	T & Dホールディングス	保険業	381,400	1,666.80	635,720,399	1,665.00	635,031,000	2.05
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	86,500	6,711.57	580,550,805	7,305.00	631,882,500	2.04
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	121,600	5,145.91	625,743,025	5,150.00	626,240,000	2.02
日本	株式	日本航空	空運業	149,700	4,175.43	625,062,953	4,123.00	617,213,100	1.99
日本	株式	丸井グループ	小売業	271,800	2,006.75	545,436,920	2,216.00	602,308,800	1.94
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	200,400	2,746.77	550,454,569	2,873.00	575,749,200	1.85
日本	株式	信越化学工業	化学	51,000	10,759.67	548,743,474	11,270.00	574,770,000	1.85
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	273,100	2,113.34	577,155,639	1,980.00	540,738,000	1.74
日本	株式	三菱地所	不動産業	271,800	1,839.68	500,025,663	1,940.00	527,292,000	1.70
日本	株式	村田製作所	電気機器	26,700	16,948.64	452,528,874	19,500.00	520,650,000	1.68
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	224,300	2,282.42	511,948,239	2,223.50	498,731,050	1.61
日本	株式	電源開発	電気・ガス業	164,800	2,783.71	458,756,460	3,025.00	498,520,000	1.61
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	112,200	3,892.97	436,792,240	4,068.00	456,429,600	1.47
日本	株式	パンダイナムコホールディングス	その他製品	95,500	3,506.04	334,826,820	4,465.00	426,407,500	1.37

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	2.48
		食料品	3.34
		繊維製品	1.29
		化学	7.03
		医薬品	5.50
		石油・石炭製品	1.25
		ゴム製品	1.24
		ガラス・土石製品	0.64
		鉄鋼	1.61
		非鉄金属	0.40
		機械	4.58

	電気機器	15.92
	輸送用機器	10.07
	その他製品	2.27
	電気・ガス業	2.52
	陸運業	2.32
	海運業	0.60
	空運業	1.99
	情報・通信業	8.64
	卸売業	4.53
	小売業	4.13
	銀行業	6.69
	保険業	5.47
	その他金融業	0.77
	不動産業	2.79
	サービス業	1.05
合 計		99.14

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2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	9,803,510,800	96.75
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		329,667,678	3.25
合計（純資産総額）		10,133,178,478	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	ベルシステム24ホールディングス	サービス業	117,900	1,447.00	170,601,300	1,974.00	232,734,600	2.30
日本	株式	ミライト・ホールディングス	建設業	130,000	1,631.00	212,030,000	1,716.00	223,080,000	2.20
日本	株式	キトー	機械	106,600	1,862.00	198,489,200	2,082.00	221,941,200	2.19
日本	株式	日本ユニシス	情報・通信業	84,200	2,209.00	185,997,800	2,575.00	216,815,000	2.14
日本	株式	前田工織	その他製品	100,400	1,644.00	165,057,600	2,150.00	215,860,000	2.13
日本	株式	エス・エム・エス	サービス業	95,000	2,105.00	199,975,000	2,270.00	215,650,000	2.13
日本	株式	ベネフィット・ワン	サービス業	64,400	2,896.00	186,502,400	3,210.00	206,724,000	2.04
日本	株式	オブテックスグループ	電気機器	62,400	2,525.00	157,560,000	3,285.00	204,984,000	2.02
日本	株式	阪和興業	卸売業	46,800	4,295.11	201,011,556	4,270.00	199,836,000	1.97
日本	株式	デジタルガレージ	情報・通信業	46,900	3,405.00	159,694,500	4,200.00	196,980,000	1.94
日本	株式	トーカロ	金属製品	152,900	1,274.00	194,794,600	1,276.00	195,100,400	1.93
日本	株式	エレコム	電気機器	73,300	2,368.00	173,574,400	2,653.00	194,464,900	1.92
日本	株式	日本電子	電気機器	175,000	917.00	160,475,000	1,111.00	194,425,000	1.92
日本	株式	ハマキョウレックス	陸運業	50,000	3,420.00	171,000,000	3,865.00	193,250,000	1.91
日本	株式	PALTA C	卸売業	32,300	5,200.00	167,960,000	5,900.00	190,570,000	1.88
日本	株式	三菱ロジスネクスト	輸送用機器	134,800	866.00	116,736,800	1,375.00	185,350,000	1.83
日本	株式	リログループ	サービス業	60,000	2,854.00	171,240,000	3,025.00	181,500,000	1.79
日本	株式	トラスコ中山	卸売業	64,400	2,493.00	160,549,200	2,818.00	181,479,200	1.79
日本	株式	ミマキエンジニアリング	電気機器	196,400	762.00	149,656,800	916.00	179,902,400	1.78
日本	株式	セーレン	繊維製品	83,400	1,817.00	151,537,800	2,001.00	166,883,400	1.65
日本	株式	ユーシン精機	機械	133,000	1,677.50	223,107,500	1,252.00	166,516,000	1.64
日本	株式	アジアパイルホールディングス	ガラス・土石製品	206,400	605.00	124,872,000	791.00	163,262,400	1.61
日本	株式	タケエイ	サービス業	151,200	1,192.00	180,230,400	1,045.00	158,004,000	1.56
日本	株式	新日鉄住金ソリューションズ	情報・通信業	53,000	2,950.27	156,364,390	2,946.00	156,138,000	1.54
日本	株式	サトーホールディングス	機械	47,700	3,280.00	156,456,000	3,265.00	155,740,500	1.54
日本	株式	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	電気機器	59,900	2,643.78	158,362,822	2,590.00	155,141,000	1.53
日本	株式	オカムラ	その他製品	95,300	1,387.00	132,181,100	1,609.00	153,337,700	1.51
日本	株式	タムラ製作所	電気機器	207,500	742.00	153,965,000	738.00	153,135,000	1.51
日本	株式	バルコ	小売業	118,800	1,331.00	158,122,800	1,266.00	150,400,800	1.48
日本	株式	カカコム	サービス業	63,600	1,818.00	115,624,800	2,352.00	149,587,200	1.48

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	建設業	2.20
		繊維製品	2.88
		化学	2.48
		ガラス・土石製品	1.61
		非鉄金属	0.99

	金属製品	2.80
	機械	8.23
	電気機器	16.00
	輸送用機器	3.09
	精密機器	0.44
	その他製品	7.85
	電気・ガス業	2.00
	陸運業	1.91
	情報・通信業	8.33
	卸売業	13.64
	小売業	3.92
	保険業	1.24
	不動産業	0.37
	サービス業	16.75
合 計		96.75

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2018年 7月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	47,668,038,657	63.33
	インドネシア	600,443,000	0.80
	小計	48,268,481,657	64.13
地方債証券	日本	525,332,000	0.70
特殊債券	韓国	100,007,000	0.13
社債券	日本	21,502,506,025	28.57
	アメリカ	300,188,000	0.40
	ドイツ	100,092,443	0.13
	イタリア	199,488,000	0.27
	フランス	1,397,341,000	1.86
	スペイン	395,336,000	0.53
	イギリス	500,595,000	0.67

	シンガポール	100,025,000	0.13
	韓国	699,961,000	0.93
	小計	25,195,532,468	33.47
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,181,792,981	1.57
合計（純資産総額）		75,271,146,106	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第772回国庫短期証券	8,400,000,000	100.03	8,402,830,279	100.03	8,402,830,279		2018/10/22	11.16
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,800,000,000	100.21	5,812,396,000	100.54	5,831,378,000	0.100	2028/6/20	7.75
日本	国債証券	第766回国庫短期証券	4,700,000,000	100.01	4,700,880,130	100.01	4,700,880,130		2018/9/25	6.25
日本	国債証券	第770回国庫短期証券	3,400,000,000	100.03	3,401,060,048	100.03	3,401,060,048		2018/10/15	4.52
日本	国債証券	第58回利付国債（30年）	3,300,000,000	102.50	3,382,713,000	101.82	3,360,357,000	0.800	2048/3/20	4.46
日本	国債証券	第773回国庫短期証券	2,700,000,000	100.04	2,701,117,800	100.04	2,701,117,800		2018/10/29	3.59
日本	国債証券	第158回利付国債（20年）	2,600,000,000	101.38	2,635,986,000	100.66	2,617,394,000	0.500	2036/9/20	3.48
日本	国債証券	第159回利付国債（20年）	1,900,000,000	102.47	1,947,076,000	102.28	1,943,434,000	0.600	2036/12/20	2.58
日本	国債証券	第127回利付国債（20年）	1,500,000,000	122.15	1,832,250,000	121.39	1,820,925,000	1.900	2031/3/20	2.42
日本	国債証券	第390回利付国債（2年）	1,800,000,000	100.45	1,808,142,000	100.42	1,807,596,000	0.100	2020/7/1	2.40
日本	国債証券	第164回利付国債（20年）	1,700,000,000	100.26	1,704,423,000	99.55	1,692,435,000	0.500	2038/3/20	2.25
日本	国債証券	第57回利付国債（30年）	1,200,000,000	101.54	1,218,480,000	101.81	1,221,792,000	0.800	2047/12/20	1.62
日本	国債証券	第152回利付国債（20年）	1,000,000,000	113.74	1,137,430,000	113.09	1,130,930,000	1.200	2035/3/20	1.50
日本	国債証券	第151回利付国債（20年）	920,000,000	113.64	1,045,543,200	113.17	1,041,182,400	1.200	2034/12/20	1.38
日本	国債証券	第10回利付国債（40年）	900,000,000	100.54	904,909,000	101.89	917,082,000	0.900	2057/3/20	1.22
フランス	社債券	第3回ビー・エヌ・ビー・パリバ非上位円貨社債（2018）	800,000,000	99.84	798,760,000	98.97	791,832,000	0.367	2023/2/28	1.05
日本	社債券	第18回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ期限前償還条項付無担保社債（実質破綻時免除特約および劣後特約付）	700,000,000	100.00	700,000,000	100.10	700,714,000	0.370	2028/5/31	0.93
日本	国債証券	第39回利付国債（30年）	500,000,000	129.40	647,025,000	128.56	642,825,000	1.900	2043/6/20	0.85
日本	国債証券	第142回利付国債（20年）	500,000,000	122.11	610,580,000	121.52	607,620,000	1.800	2032/12/20	0.81

日本	社債券	第2回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債（社債間限定同順位特約付）	600,000,000	100.46	602,805,000	100.16	601,002,000	0.450	2020/1/22	0.80
日本	社債券	第5回株式会社新生銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	600,000,000	100.00	600,000,000	100.08	600,522,000	0.210	2023/7/13	0.80
日本	国債証券	第45回利付国債（30年）	500,000,000	120.02	600,100,000	119.68	598,415,000	1.500	2044/12/20	0.80
日本	国債証券	第149回利付国債（20年）	500,000,000	118.55	592,752,000	117.74	588,740,000	1.500	2034/6/20	0.78
日本	社債券	第10回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債（実質破綻時免除特約および劣後特約付）	500,000,000	101.28	506,435,000	100.78	503,920,000	0.650	2027/1/26	0.67
イギリス	社債券	第6回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー円貨社債（2018）	500,000,000	100.00	500,000,000	100.11	500,595,000	0.650	2023/5/30	0.67
日本	社債券	第20回株式会社ジャックス無担保社債（社債間限定同順位特約付）	500,000,000	100.00	500,000,000	100.01	500,090,000	0.360	2025/6/13	0.66
日本	社債券	第30回阪和興業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	500,000,000	100.00	500,000,000	100.01	500,055,000	0.240	2023/6/13	0.66
インドネシア	国債証券	第4回インドネシア共和国円貨債券（2018）	500,000,000	100.00	500,000,000	100.01	500,050,000	0.670	2021/5/31	0.66
日本	社債券	第16回株式会社みずほフィナンシャルグループ期限前償還条項付無担保社債（実質破綻時免除特約および劣後特約付）	500,000,000	100.00	500,000,000	100.00	500,000,000	0.400	2028/6/12	0.66
日本	社債券	第517回関西電力株式会社社債（一般担保付）	500,000,000	100.00	500,000,000	99.97	499,875,000	0.190	2023/6/20	0.66

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	64.13
地方債証券	0.70
特殊債券	0.13
社債券	33.47
合計	98.43

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2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	21,375,500,984	90.39
	カナダ	769,248,477	3.25
	オランダ	148,423,352	0.63
	アイルランド	121,589,452	0.51
	イギリス	197,180,869	0.83
	シンガポール	128,886,939	0.55
	ジャージー	248,157,027	1.05
	小計	22,988,987,100	97.22
投資証券	アメリカ	478,777,531	2.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		179,044,699	0.76
合計（純資産総額）		23,646,809,330	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 （％）
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	8,229	114,677.77	943,683,372	135,403.33	1,114,234,063	4.71
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	4,025	166,335.16	669,499,034	197,511.21	794,982,629	3.36
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	43,578	11,919.14	519,412,444	12,958.19	564,692,322	2.39
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	24,127	19,111.48	461,102,716	21,965.54	529,962,793	2.24
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	33,501	13,027.02	436,418,314	15,150.64	507,561,751	2.15
アメリカ	株式	ALTRIA GROUP INC	食品・飲料・タバコ	75,911	6,562.91	498,197,152	6,488.53	492,551,142	2.08
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	95,848	4,729.02	453,267,684	5,131.99	491,891,198	2.08
アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	16,424	23,942.63	393,233,867	26,899.94	441,804,667	1.87
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	19,945	18,383.25	366,654,041	21,081.90	420,478,677	1.78
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	35,478	9,723.36	344,965,576	11,697.12	414,990,555	1.75

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	36,999	8,332.41	308,290,860	10,881.20	402,593,526	1.70
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	32,409	11,427.36	370,349,615	12,312.11	399,023,468	1.69
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	61,279	5,685.93	348,428,239	6,492.97	397,883,009	1.68
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	24,110	12,747.27	307,336,880	15,322.71	369,430,545	1.56
アメリカ	株式	PROGRESSIVE CORP	保険	53,148	6,640.61	352,935,576	6,596.21	350,575,592	1.48
アメリカ	株式	HUMANA INC	ヘルスケア機器・サービス	9,995	29,267.78	292,531,526	34,746.12	347,287,569	1.47
アメリカ	株式	L3 TECHNOLOGIES INC	資本財	14,692	22,254.17	326,958,335	23,453.08	344,572,691	1.46
アメリカ	株式	TD AMERITRADE HOLDING CORP	各種金融	53,190	6,325.34	336,445,356	6,456.34	343,412,810	1.45
アメリカ	株式	ANADARKO PETROLEUM CORP	エネルギー	41,789	6,822.67	285,112,749	8,182.54	341,940,461	1.45
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	17,989	19,089.27	343,397,051	18,989.37	341,599,788	1.44
カナダ	株式	SUNCOR ENERGY INC	エネルギー	72,611	3,674.23	266,789,791	4,692.01	340,691,923	1.44
アメリカ	株式	NRG ENERGY INC	公益事業	95,696	3,311.42	316,890,443	3,449.08	330,063,227	1.40
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	39,744	7,557.56	300,367,696	8,024.91	318,942,138	1.35
アメリカ	株式	CSX CORP	運輸	38,187	7,114.63	271,686,410	7,802.89	297,969,071	1.26
アメリカ	株式	PARKER HANNIFIN CORP	資本財	16,107	18,932.75	304,949,893	18,151.24	292,362,105	1.24
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	20,599	12,580.76	259,151,144	14,190.40	292,308,221	1.24
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	11,320	22,781.47	257,886,265	25,612.22	289,930,412	1.23
アメリカ	株式	BALL CORP	素材	67,664	4,307.18	291,441,569	4,282.76	289,789,065	1.23
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	16,378	17,348.64	284,136,072	17,610.62	288,426,839	1.22
アメリカ	株式	ILLINOIS TOOL WORKS	資本財	18,412	17,137.72	315,539,770	15,511.42	285,596,399	1.21

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	7.58
		素材	3.64
		資本財	6.73
		商業・専門サービス	1.43
		運輸	2.32
		自動車・自動車部品	1.05
		耐久消費財・アパレル	1.11
		消費者サービス	4.09
		メディア	1.38
		小売	5.53
		食品・飲料・タバコ	5.08
		家庭用品・パーソナル用品	0.86
		ヘルスケア機器・サービス	4.82
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.69		

	銀行	6.28
	各種金融	5.34
	保険	1.48
	ソフトウェア・サービス	22.45
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.08
	公益事業	2.01
	半導体・半導体製造装置	2.27
投資証券		2.02
合 計		99.24

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。

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2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	ドイツ	2,677,467,687	12.49
	イタリア	735,622,742	3.43
	フランス	2,360,239,219	11.01
	オランダ	1,248,682,877	5.82
	スペイン	1,191,270,386	5.56
	ベルギー	551,141,216	2.57
	アイルランド	983,790,862	4.59
	ポルトガル	405,305,604	1.89
	イギリス	5,481,346,166	25.57
	スイス	2,807,600,831	13.10
	スウェーデン	1,176,852,624	5.49
	ノルウェー	113,285,248	0.53
	デンマーク	726,694,688	3.39
	バミューダ	331,080,263	1.54
ジャージー	237,765,471	1.11	
	小計	21,028,145,884	98.09
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		410,269,647	1.91
合計（純資産総額）		21,438,415,531	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(%)
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	96,200	8,319.13	800,300,729	9,112.39	876,612,495	4.09
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	710,281	686.19	487,394,751	823.87	585,184,143	2.73
イギリス	株式	BEAZLEY PLC/UK	保険	694,701	807.12	560,708,877	809.30	562,227,041	2.62
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	20,195	24,340.54	491,557,343	27,241.68	550,145,768	2.57
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	13,664	32,116.09	438,834,355	38,803.59	530,212,315	2.47
ドイツ	株式	LINDE AG - TENDER	素材	18,200	22,972.92	418,107,205	27,428.22	499,193,659	2.33
スウェーデン	株式	ERICSSON LM-B SHS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	555,009	699.42	388,189,279	887.09	492,344,488	2.30
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	45,928	8,543.26	392,374,919	10,008.90	459,688,897	2.14
ドイツ	株式	BAYER AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,209	11,757.36	425,722,455	12,364.13	447,693,102	2.09
オランダ	株式	AKZO NOBEL	素材	43,456	9,873.38	429,057,631	10,285.25	446,956,206	2.08
スイス	株式	UBS GROUP AG-REG	各種金融	222,385	1,795.51	399,295,114	1,817.98	404,292,550	1.89
スウェーデン	株式	COM HEM HOLDING AB	電気通信サービス	190,495	1,713.44	326,403,353	2,040.21	388,650,185	1.81
イギリス	株式	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	食品・飲料・タバコ	62,816	6,094.21	382,814,065	6,049.77	380,022,808	1.77
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,254	5,181.77	348,494,947	5,633.11	378,849,852	1.77
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	1,387,641	282.63	392,200,909	271.71	377,038,502	1.76
イギリス	株式	TESCO PLC	食品・生活必需品小売り	991,435	313.23	310,550,655	372.82	369,627,500	1.72
イギリス	株式	JUST EAT PLC	ソフトウェア・サービス	291,865	1,042.38	304,236,696	1,233.12	359,904,615	1.68
スペイン	株式	AMADEUS IT GROUP SA	ソフトウェア・サービス	36,900	7,781.50	287,137,634	9,708.36	358,238,838	1.67
フランス	株式	BNP PARIBAS	銀行	49,909	7,724.33	385,514,010	7,159.14	357,305,668	1.67
イタリア	株式	ENI SPA	エネルギー	168,669	1,855.40	312,948,530	2,116.03	356,910,347	1.66
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SE	資本財	39,462	8,794.96	347,066,778	8,926.19	352,245,349	1.64
アイルランド	株式	PADDY POWER BETFAIR PLC	消費者サービス	29,072	10,760.66	312,834,006	11,881.01	345,404,999	1.61
ベルギー	株式	KBC GROEP NV	銀行	40,198	9,158.76	368,164,063	8,590.97	345,339,876	1.61
スペイン	株式	AENA SA	運輸	16,736	21,231.86	355,336,431	20,145.64	337,157,540	1.57

フランス	株式	L'OREAL	家庭用品・ パーソナル 用品	12,507	23,153.52	289,581,149	26,921.49	336,707,150	1.57
バミュー ダ	株式	HISCOX LTD	保険	143,829	2,115.41	304,258,571	2,301.90	331,080,263	1.54
ドイツ	株式	SYMRISE AG	素材	31,996	8,370.09	267,809,418	10,033.19	321,022,094	1.50
オランダ	株式	KONINKLIJKE KPN NV	電気通信 サービス	949,248	315.72	299,705,977	325.34	308,832,825	1.44
ドイツ	株式	DEUTSCHE BOERSE AG	各種金融	20,825	14,211.74	295,959,556	14,669.09	305,483,945	1.42
スウェー デン	株式	ESSITY AKTIEBOLAG-B	家庭用品・ パーソナル 用品	105,865	2,805.57	297,012,388	2,794.67	295,857,951	1.38

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	6.17
		素材	8.65
		資本財	4.29
		商業・専門サービス	2.40
		運輸	3.03
		耐久消費財・アパレル	4.24
		消費者サービス	2.77
		メディア	2.51
		小売	0.96
		食品・生活必需品小売り	2.46
		食品・飲料・タバコ	7.22
		家庭用品・パーソナル用品	5.09
		ヘルスケア機器・サービス	1.27
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.26
		銀行	7.39
		各種金融	5.88
		保険	4.17
		不動産	0.77
		ソフトウェア・サービス	9.20
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.30		
電気通信サービス	6.39		
公益事業	2.67		
合 計			98.09

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。

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2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	136,844,892	2.13
	アイルランド	159,254,674	2.48
	イギリス	86,190,653	1.34
	ケイマン	150,430,372	2.34
	オーストラリア	3,388,278,553	52.80
	バミューダ	152,944,582	2.38
	ニュージーランド	103,099,441	1.61
	香港	1,236,871,366	19.27
	シンガポール	534,549,268	8.33
	中国	163,663,147	2.55
	小計	6,112,126,948	95.24
投資証券	オーストラリア	157,898,828	2.46
	シンガポール	76,387,368	1.19
	小計	234,286,196	3.65
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		70,983,455	1.11
合計（純資産総額）		6,417,396,599	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	507,600	936.94	475,592,170	971.41	493,091,777	7.68
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	154,867	2,365.18	366,288,594	2,810.75	435,293,953	6.78
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	21,562	13,144.55	283,422,936	16,241.40	350,197,231	5.46
オーストラリア	株式	AUST AND NZ BANKING GROUP	銀行	126,607	2,273.06	287,785,991	2,410.39	305,173,158	4.76
オーストラリア	株式	WESTPAC BANKING CORP	銀行	116,680	2,375.04	277,120,473	2,414.50	281,724,759	4.39
オーストラリア	株式	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	34,571	5,969.73	206,379,863	6,157.52	212,871,935	3.32
オーストラリア	株式	WOOLWORTHS GROUP LTD	食品・生活必需品小売り	83,118	2,193.25	182,298,897	2,472.87	205,540,574	3.20

オーストラリア	株式	BRAMBLES LTD	商業・専門サービス	234,304	799.90	187,420,542	806.48	188,961,513	2.94
オーストラリア	株式	RIO TINTO LTD	素材	25,638	6,087.65	156,075,183	6,613.79	169,564,463	2.64
オーストラリア	株式	ASX LTD	各種金融	29,710	4,675.26	138,902,178	5,465.32	162,374,681	2.53
アイルランド	株式	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	素材	90,649	1,855.47	168,197,379	1,756.82	159,254,674	2.48
オーストラリア	投資証券	LENDLEASE GROUP		94,942	1,400.85	133,000,298	1,663.10	157,898,828	2.46
バミューダ	株式	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	資本財	35,500	4,227.40	150,072,833	4,308.29	152,944,582	2.38
シンガポール	株式	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	銀行	160,800	1,053.84	169,458,693	939.68	151,101,573	2.35
香港	株式	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	消費者サービス	164,000	984.50	161,459,422	899.30	147,485,856	2.30
オーストラリア	株式	INCITEC PIVOT LTD	素材	454,583	297.15	135,080,807	307.46	139,768,544	2.18
香港	株式	SWIRE PROPERTIES LTD	不動産	327,200	396.62	129,776,354	427.02	139,723,561	2.18
アメリカ	株式	RESMED INC-CDI	ヘルスケア機器・サービス	116,404	1,025.98	119,428,269	1,175.60	136,844,892	2.13
オーストラリア	株式	WESFARMERS LTD	食品・生活必需品小売り	32,523	3,437.20	111,788,059	4,071.86	132,429,145	2.06
香港	株式	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	耐久消費財・アパレル	205,000	616.50	126,383,320	622.16	127,542,800	1.99
オーストラリア	株式	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	銀行	54,672	2,378.97	130,063,550	2,327.36	127,241,705	1.98
シンガポール	株式	UNITED OVERSEAS BANK LTD	銀行	57,392	2,235.01	128,272,153	2,200.75	126,305,938	1.97
香港	株式	SUN HUNG KAI PROPERTIES	不動産	70,000	1,791.83	125,428,358	1,754.77	122,834,180	1.91
オーストラリア	株式	CROWN RESORTS LTD	消費者サービス	109,045	1,036.66	113,043,473	1,117.23	121,828,771	1.90
オーストラリア	株式	COMPUTERSHARE LTD	ソフトウェア・サービス	75,429	1,421.41	107,215,603	1,504.44	113,478,631	1.77
オーストラリア	株式	WOODSIDE PETROLEUM LTD	エネルギー	36,302	2,412.04	87,561,927	2,918.45	105,945,753	1.65
ケイマン	株式	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	資本財	87,772	1,340.47	117,655,908	1,206.84	105,927,550	1.65
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	20,400	5,900.93	120,379,144	5,192.20	105,921,043	1.65
香港	株式	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	不動産	130,500	764.85	99,814,086	805.93	105,174,204	1.64
オーストラリア	株式	MEDIBANK PRIVATE LTD	保険	405,579	244.16	99,027,670	256.49	104,029,067	1.62

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	1.65
		素材	16.01
		資本財	4.03
		商業・専門サービス	2.94
		耐久消費財・アパレル	1.99
		消費者サービス	4.89
		食品・生活必需品小売り	5.27
		ヘルスケア機器・サービス	2.13

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.46
	銀行	21.69
	各種金融	2.53
	保険	11.48
	不動産	7.13
	ソフトウェア・サービス	3.42
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.00
	電気通信サービス	2.01
	公益事業	1.61
投資証券		3.65
合 計		98.89

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2018年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	2,248,269,297	20.80
	カナダ	259,836,533	2.40
	メキシコ	109,564,874	1.01
	ドイツ	668,781,609	6.19
	イタリア	974,140,812	9.01
	フランス	986,270,536	9.12
	オランダ	284,489,669	2.63
	スペイン	634,668,532	5.87
	ベルギー	251,132,487	2.32
	オーストリア	150,385,813	1.39
	フィンランド	142,704,364	1.32
	アイルランド	80,148,477	0.74
	イギリス	1,123,980,819	10.40
	スイス	14,152,163	0.13
	スウェーデン	40,500,825	0.37
ノルウェー	34,434,337	0.32	

	デンマーク	163,237,224	1.51
	ポーランド	89,703,303	0.83
	オーストラリア	255,716,457	2.37
	ニュージーランド	367,193,086	3.40
	シンガポール	94,111,265	0.87
	マレーシア	61,325,710	0.57
	南アフリカ	63,815,034	0.59
	小計	9,098,563,226	84.17
特殊債券	アメリカ	16,833,094	0.16
	ドイツ	51,230,461	0.47
	小計	68,063,555	0.63
社債券	アメリカ	896,897,536	8.30
	カナダ	95,992,765	0.89
	フランス	26,106,003	0.24
	スペイン	33,810,783	0.31
	イギリス	42,346,379	0.39
	スウェーデン	81,329,593	0.75
	小計	1,176,483,059	10.88
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		466,686,587	4.32
合計（純資産総額）		10,809,796,427	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	2,286,119,175	21.15
	買建	ドイツ	256,817,039	2.38
	買建	オーストラリア	749,508,285	6.93
	売建	アメリカ	1,514,674,245	14.01
	売建	カナダ	103,703,843	0.96
	売建	ドイツ	97,587,824	0.90
	売建	イギリス	160,597,000	1.49
その他先物取引	買建	アメリカ	269,684,919	2.49
	売建	アメリカ	702,232,608	6.50

(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		5,378,848,674	49.76
	売建		5,414,615,346	50.09

(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 (%)
イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,480,000	14,940.38	370,521,511	14,916.51	369,929,628	2.000	2020/7/22	3.42
ニュー ジーラ ンド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4,210,000	8,717.41	367,003,072	8,721.92	367,193,086	5.500	2023/4/15	3.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,860,000	11,326.92	323,950,128	11,209.84	320,601,576	3.125	2021/5/15	2.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,510,000	10,574.79	265,427,239	10,490.22	263,304,597	2.000	2025/2/15	2.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,225,000	10,530.11	234,295,169	10,444.47	232,389,585	2.000	2025/8/15	2.15
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,660,000	13,986.92	232,182,964	13,974.50	231,976,770	1.500	2022/9/4	2.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,025,000	10,804.61	218,793,441	10,736.30	217,410,276	1.750	2021/11/30	2.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,915,000	10,961.37	209,910,267	10,893.72	208,614,779	3.000	2045/5/15	1.93
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,335,000	15,795.18	210,865,750	14,909.68	199,044,339	5.500	2022/9/1	1.84
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,495,000	13,134.62	196,362,624	13,215.01	197,564,478	0.500	2025/5/25	1.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,440,000	11,243.44	161,905,651	11,151.29	160,578,700	3.125	2043/2/15	1.49
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,175,000	13,115.48	154,106,984	13,135.38	154,340,774	0.000	2021/5/25	1.43
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	734,000	20,343.14	149,318,648	20,198.26	148,255,288	4.750	2035/4/25	1.37
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,060,000	12,972.77	137,511,402	12,923.69	136,991,152	0.000	2024/3/25	1.27
デンマ ーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	7,290,000	1,877.04	136,836,547	1,849.53	134,831,078	4.000	2019/11/15	1.25
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	985,000	14,861.14	146,382,293	13,603.03	133,989,849	3.500	2030/3/1	1.24
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,265,000	10,389.40	131,426,018	10,323.93	130,597,715	1.375	2023/8/31	1.21
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	985,000	13,147.55	129,503,428	13,146.29	129,490,970	0.450	2022/10/31	1.20
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,150,000	10,973.72	126,197,861	10,867.05	124,971,162	2.500	2024/5/15	1.16
イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM GILT	865,000	14,236.90	123,149,267	14,341.72	124,055,934	0.750	2023/7/22	1.15
オース トラ リア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,515,000	7,795.24	118,097,948	8,035.99	121,745,317	3.000	2047/3/21	1.13
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	875,000	14,080.51	123,204,499	13,902.75	121,649,065	3.500	2020/4/25	1.13
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	610,000	19,162.07	116,888,666	18,774.37	114,523,707	6.000	2029/1/31	1.06
イギリス	国債証券	UK TREASURY	535,000	20,217.98	108,166,213	20,133.01	107,711,644	4.250	2036/3/7	1.00
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000	17,120.19	106,145,217	17,339.09	107,502,380	2.500	2044/7/4	0.99
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	10,568.15	105,681,520	10,469.63	104,696,306	2.250	2027/8/15	0.97
イギリス	国債証券	UK TREASURY	465,000	22,453.74	104,409,904	22,091.45	102,725,267	3.750	2052/7/22	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	940,000	10,970.04	103,118,390	10,892.20	102,386,692	2.125	2021/8/15	0.95
イギリス	国債証券	UK TREASURY	675,000	14,792.10	99,846,741	14,810.55	99,971,240	1.500	2021/1/22	0.92
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	785,000	12,902.80	101,286,984	12,602.04	98,926,079	0.050	2021/4/15	0.92

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.17
特殊債券	0.63
社債券	10.88

合 計	95.68
-----	-------

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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 1809	買建	90	米ドル	19,050,975.39	2,114,848,777	19,022,344.2	2,111,670,429	19.53
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TNOTE5Y 1809	売建	108	米ドル	12,243,825.96	1,359,187,119	12,216,656.52	1,356,171,040	12.55
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TNOTE10Y1809	買建	4	米ドル	478,007.32	53,063,593	477,500	53,007,275	0.49
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TBOND20Y1809	売建	2	米ドル	283,855.72	31,510,823	285,250	31,665,602	0.29
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TNOUL10Y1809	売建	9	米ドル	1,141,061.66	126,669,255	1,142,578.17	126,837,603	1.17
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	TBOND30Y1809	買建	7	米ドル	1,107,356.56	122,927,652	1,093,968.75	121,441,471	1.12
	カナダ	モントリ オール取引 所	CAN 10Y 1809	売建	9	加ドル	1,234,531.55	105,145,051	1,217,610	103,703,843	0.96
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	FBTP10Y 1809	売建	2	ユーロ	255,758.26	33,230,671	253,400	32,924,262	0.30
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	SCHATZ2Y1809	買建	11	ユーロ	1,232,229.35	160,103,560	1,231,120	159,959,422	1.48
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	BOBL5Y 1809	買建	1	ユーロ	131,680.87	17,109,295	131,620	17,101,386	0.16
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	BUND10Y 1809	売建	2	ユーロ	324,018.26	42,099,693	322,860	41,949,200	0.39
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	BUXL30Y 1809	売建	1	ユーロ	178,059.13	23,135,222	174,820	22,714,362	0.21
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	OAT10Y 1809	買建	4	ユーロ	609,843.4	79,236,952	613,840	79,756,231	0.74
その他 先物取 引	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	AUSTR03Y1809	買建	32	豪ドル	3,557,240.2	292,440,716	3,561,017.28	292,751,230	2.71
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	AUSTR10Y1809	買建	43	豪ドル	5,557,893.59	456,914,432	5,555,979.26	456,757,055	4.23
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	GILT10Y 1809	売建	9	英ポンド	1,110,970.81	161,857,337	1,102,320	160,597,000	1.49
その他 先物取 引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	90DEURO 1809	売建	16	米ドル	3,901,175.92	433,069,539	3,902,600	433,227,626	4.01
	アメリカ	シカゴ商業 取引所	90DEURO 1903	買建	10	米ドル	2,431,578.58	269,929,538	2,429,375	269,684,919	2.49
	アメリカ	シカゴ商業 取引所	90DEURO 2003	売建	10	米ドル	2,428,625	269,601,661	2,423,250	269,004,982	2.49

(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	29,601,470.76	3,269,328,245	3,282,292,794	30.36
	加ドル	買建	1,239,000.00	105,378,119	105,444,850	0.98
	メキシコペソ	買建	2,927,000.00	17,484,051	17,503,460	0.16
	ユーロ	買建	4,422,000.00	571,454,273	574,561,780	5.32
	英ポンド	買建	3,831,000.00	560,983,729	558,061,770	5.16
	スイスフラン	買建	256,000.00	28,576,629	28,764,160	0.27
	ノルウェークローネ	買建	2,848,000.00	38,490,490	38,846,720	0.36
	デンマーククローネ	買建	5,500,000.00	95,600,482	95,920,000	0.89
	ポーランドズロチ	買建	3,407,000.00	101,881,744	103,560,240	0.96
	豪ドル	買建	1,215,000.00	99,243,385	99,815,850	0.92
	ニュージーランドドル	買建	5,412,000.00	407,705,250	410,067,240	3.79
	シンガポールドル	買建	606,000.00	49,426,178	49,419,300	0.46
	南アフリカランド	買建	1,738,000.00	14,280,955	14,590,510	0.13
	米ドル	売建	20,288,196.07	2,253,565,285	2,250,838,886	20.82
	加ドル	売建	2,538,000.00	212,551,370	216,001,840	2.00
	メキシコペソ	売建	5,854,000.00	33,572,690	34,860,570	0.32
	ユーロ	売建	4,392,000.00	565,968,790	570,663,580	5.28
	英ポンド	売建	6,436,000.00	936,695,440	937,219,520	8.67
	スイスフラン	売建	512,000.00	57,026,560	57,543,680	0.53
	ノルウェークローネ	売建	3,577,000.00	49,210,610	48,782,990	0.45
	デンマーククローネ	売建	11,000,000.00	190,135,000	191,895,000	1.78
	ポーランドズロチ	売建	2,779,000.00	83,348,590	84,494,160	0.78
	豪ドル	売建	1,430,000.00	116,831,900	117,448,000	1.09
	ニュージーランドドル	売建	10,554,000.00	795,744,960	798,802,440	7.39
	シンガポールドル	売建	1,212,000.00	98,193,600	98,747,700	0.91
	南アフリカランド	売建	869,000.00	7,290,910	7,316,980	0.07

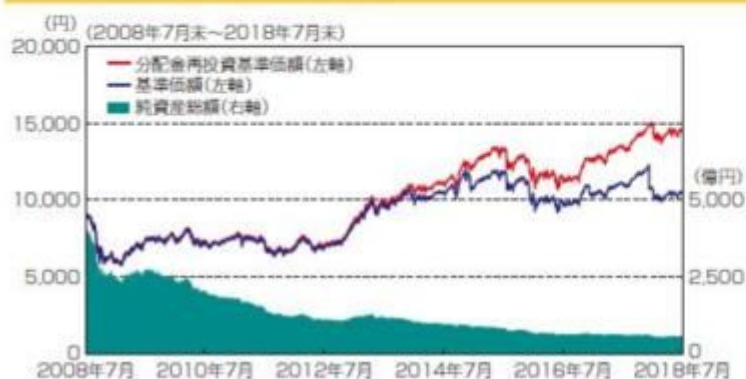
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2018年7月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,463円

純資産総額…………… 581.95億円

※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、2008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)

2014年1月	2015年1月	2016年1月	2017年1月	2018年1月	設定来累計
350円	700円	300円	500円	1,500円	9,750円

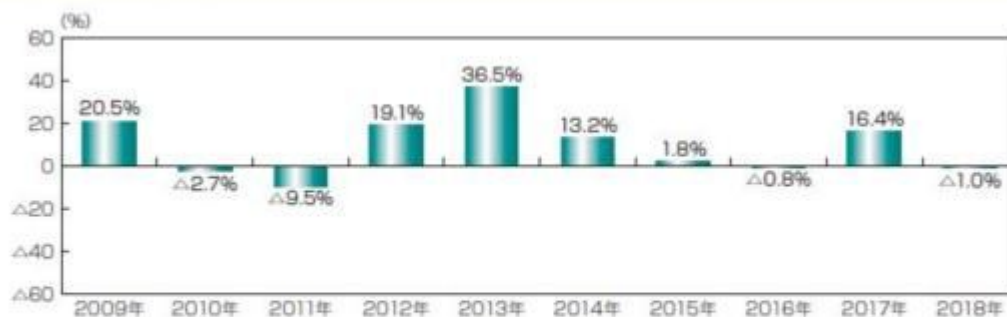
主要な資産の状況

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	24.0%	日本電信電話	情報・通信業	4.1%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3.5%
		本田技研工業	輸送用機器	3.4%
日本小型株式 グローバル・ラップ マザーファンド	8.0%	ベルシステム24ホールディングス	サービス業	2.3%
		ミライトホールディングス	建設業	2.2%
		キトー	機械	2.2%
北米株式 グローバル・ラップ マザーファンド	19.5%	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	4.7%
		AMAZON.COM INC	小売	3.4%
		JPMORGAN CHASE & CO	銀行	2.4%
欧州先進国株式 グローバル・ラップ マザーファンド	16.5%	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	4.1%
		BP PLC	エネルギー	2.7%
		BEAZLEY PLC/UK	保険	2.6%
アジア太平洋先進国株式 グローバル・ラップ マザーファンド	4.8%	AIA GROUP LTD	保険	7.7%
		BHP BILLITON LTD	素材	6.8%
		CSL LTD	医薬品・バイオテクノロジー	5.5%
日本債券 グローバル・ラップ マザーファンド	16.3%	第772回国庫短期証券	国債証券	11.2%
		第351回利付国債(10年)	国債証券	7.8%
		第766回国庫短期証券	国債証券	6.3%
海外債券 グローバル・ラップ マザーファンド	9.3%	UK TREASURY(2%)	国債証券	3.4%
		NEW ZEALAND GOVERNMENT(5.5%)	国債証券	3.4%
		US TREASURY N/B(3.125%)	国債証券	3.0%
現金その他	1.7%			

※1:当ファンドの対純資産総額比です。また、合計の比率が四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

※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。
 ※2018年は、2018年7月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

(6) 申込単位

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス <http://www.nikkoam.com/>

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

<訂正後>

(6) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

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30年1月11日から平成30年7月10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30年 1月10日現在	当中間計算期間末 平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,190,446,856	1,241,811,528
親投資信託受益証券	55,551,443,124	56,846,998,097
未収入金	7,809,337,246	-
流動資産合計	64,551,227,226	58,088,809,625
資産合計	64,551,227,226	58,088,809,625
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,810,844,203	-
未払解約金	72,034,013	23,957,173
未払受託者報酬	16,958,357	15,273,417
未払委託者報酬	593,544,624	534,571,695
未払利息	1,341	1,998
その他未払費用	1,661,863	1,221,812
流動負債合計	8,495,044,401	575,026,095
負債合計	8,495,044,401	575,026,095
純資産の部		
元本等		
元本	52,072,294,689	55,262,003,999
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,983,888,136	2,251,779,531
（分配準備積立金）	1,702,274,452	1,635,129,890
元本等合計	56,056,182,825	57,513,783,530
純資産合計	56,056,182,825	57,513,783,530
負債純資産合計	64,551,227,226	58,088,809,625

(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29年 1月11日 至 平成29年 7月10日	当中間計算期間 自 平成30年 1月11日 至 平成30年 7月10日
営業収益		
受取利息	125	265
有価証券売買等損益	4,233,984,026	1,422,705,190
営業収益合計	4,233,984,151	1,422,704,925

	前中間計算期間 自 平成29年 1月11日 至 平成29年 7月10日	当中間計算期間 自 平成30年 1月11日 至 平成30年 7月10日
営業費用		
支払利息	204,763	213,183
受託者報酬	17,079,343	15,273,417
委託者報酬	597,779,237	534,571,695
その他費用	1,673,717	1,225,747
営業費用合計	616,737,060	551,284,042
営業利益又は営業損失()	3,617,247,091	1,973,988,967
経常利益又は経常損失()	3,617,247,091	1,973,988,967
中間純利益又は中間純損失()	3,617,247,091	1,973,988,967
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()	110,577,697	74,754,924
期首剰余金又は期首欠損金()	2,817,259,938	3,983,888,136
剰余金増加額又は欠損金減少額	98,048,974	335,515,905
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	98,048,974	335,515,905
剰余金減少額又は欠損金増加額	285,815,009	168,390,467
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	285,815,009	168,390,467
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()	6,136,163,297	2,251,779,531

(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30年 1月10日現在	当中間計算期間末 平成30年 7月10日現在
1. 期首元本額	61,584,078,273円	52,072,294,689円
期中追加設定元本額	2,591,306,295円	5,404,557,173円
期中一部解約元本額	12,103,089,879円	2,214,847,863円
2. 受益権の総数	52,072,294,689口	55,262,003,999口

(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29年 1月11日 至 平成29年 7月10日	当中間計算期間 自 平成30年 1月11日 至 平成30年 7月10日
信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 149,479,994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 131,568,948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30年 1月10日現在	当中間計算期間末 平成30年 7月10日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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30年 1月10日現在	当中間計算期間末 平成30年 7月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0765円 (10,765円)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0407円 (10,407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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	274,054,321	285,789,692
株式	33,785,192,550	30,108,204,940
未収入金	2,004,437,549	-
未収配当金	58,972,400	39,875,000
流動資産合計	36,122,656,820	30,433,869,632
資産合計	36,122,656,820	30,433,869,632
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,007,849,245	-
未払利息	308	460
流動負債合計	2,007,849,553	460
負債合計	2,007,849,553	460
純資産の部		
元本等		
元本	13,507,345,599	13,306,696,752
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,607,461,668	17,127,172,420
元本等合計	34,114,807,267	30,433,869,172
純資産合計	34,114,807,267	30,433,869,172
負債純資産合計	36,122,656,820	30,433,869,632

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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
1.	期首	平成29年 1月11日	平成30年 1月11日
	期首元本額	18,078,332,390円	13,507,345,599円
	期首からの追加設定元本額	115,370,531円	1,230,084,902円
	期首からの一部解約元本額	4,686,357,322円	1,430,733,749円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	5,682,264,403円	5,973,616,566円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	205,180,201円	181,279,425円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	371,350,054円	330,971,735円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	3,075,983,612円	2,820,539,667円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	1,369,069,146円	1,252,174,756円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	1,470,084,916円	1,378,798,907円
	日本大型株式ファンド	75,969,059円	66,236,172円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	56,689,386円	61,122,727円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	151,324,647円	158,288,897円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	193,057,111円	197,998,670円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	433,238,645円	449,514,062円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	423,134,419円	436,155,168円
	計	13,507,345,599円	13,306,696,752円
2.	受益権の総数	13,507,345,599口	13,306,696,752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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	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30年 1月10日現在		平成30年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	2.5256円	1口当たり純資産額	2.2871円
(1万口当たり純資産額)	(25,256円)	(1万口当たり純資産額)	(22,871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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	614,384,415	419,153,432
株式	10,769,697,000	9,431,223,140
未収入金	264,367,845	63,717,386
未収配当金	11,051,050	9,719,750
流動資産合計	11,659,500,310	9,923,813,708
資産合計	11,659,500,310	9,923,813,708
負債の部		
流動負債		
未払金	-	78,537,585
未払解約金	717,738,777	-
未払利息	692	674
流動負債合計	717,739,469	78,538,259
負債合計	717,739,469	78,538,259
純資産の部		
元本等		
元本	1,518,758,304	1,452,676,888
剰余金		
剰余金又は欠損金()	9,423,002,537	8,392,598,561
元本等合計	10,941,760,841	9,845,275,449
純資産合計	10,941,760,841	9,845,275,449
負債純資産合計	11,659,500,310	9,923,813,708

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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
1.	期首	平成29年 1月11日	平成30年 1月11日
	期首元本額	2,548,863,316円	1,518,758,304円
	期首からの追加設定元本額	7,540,367円	98,172,060円
	期首からの一部解約元本額	1,037,645,379円	164,253,476円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	630,716,420円	666,273,960円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	35,448,084円	29,908,329円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	51,217,813円	43,142,182円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	345,718,948円	298,472,808円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	138,170,076円	120,030,844円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	106,087,095円	94,947,620円
	日本小型株式ファンド	46,239,654円	42,036,877円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(安定型)	13,110,021円	13,215,335円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(安定成長型)	27,265,330円	25,922,148円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(成長型)	28,074,462円	27,099,038円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(積極成長型)	51,609,350円	49,028,218円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス(積極型)	45,101,051円	42,599,529円
	計	1,518,758,304円	1,452,676,888円
2.	受益権の総数	1,518,758,304口	1,452,676,888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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在

貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	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30年 1月10日現在		平成30年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	7,204円	1口当たり純資産額	6,773円
(1万口当たり純資産額)	(72,044円)	(1万口当たり純資産額)	(67,773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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	298,668,864	1,876,818,626
国債証券	11,951,941,659	50,672,910,467
地方債証券	525,865,000	526,137,000
特殊債券	-	100,016,000
社債券	8,368,733,564	23,008,627,886
未収入金	2,223,972,650	9,301,343,600
未収利息	31,938,966	47,901,022
前払費用	2,942,045	35,106,972
流動資産合計	23,404,062,748	85,568,861,573
資産合計	23,404,062,748	85,568,861,573
負債の部		
流動負債		

	平成30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
未払金	912,939,300	10,374,675,000
未払解約金	1,194,505,759	-
未払利息	336	3,020
流動負債合計	2,107,445,395	10,374,678,020
負債合計	2,107,445,395	10,374,678,020
純資産の部		
元本等		
元本	15,517,820,925	54,063,806,748
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,778,796,428	21,130,376,805
元本等合計	21,296,617,353	75,194,183,553
純資産合計	21,296,617,353	75,194,183,553
負債純資産合計	23,404,062,748	85,568,861,573

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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
1. 期首	平成29年 1月11日	平成30年 1月11日
期首元本額	16,857,196,919円	15,517,820,925円
期首からの追加設定元本額	1,052,386,169円	40,405,699,624円
期首からの一部解約元本額	2,391,762,163円	1,859,713,801円
元本の内訳		
GW 7つの卵	6,632,520,681円	6,839,799,915円
日興アセット/日本債券ファンド（適格機関投資家向け）	- 円	39,073,927,676円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	1,194,436,970円	1,046,902,113円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	1,345,751,717円	1,163,589,869円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	3,649,541,443円	3,168,293,363円

日本債券ファンド	34,897,843円	31,979,808円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	604,609,492円	643,631,799円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	874,869,891円	889,542,666円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	681,489,821円	699,048,985円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	499,703,067円	507,090,554円
計	15,517,820,925円	54,063,806,748円
2. 受益権の総数	15,517,820,925口	54,063,806,748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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	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30年 1月10日現在		平成30年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	1.3724円	1口当たり純資産額	1.3908円
(1万口当たり純資産額)	(13,724円)	(1万口当たり純資産額)	(13,908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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
預金	275,142,313	173,212,810
コール・ローン	1,523,322	1,521,741
株式	23,199,789,297	23,381,938,993
投資証券	421,133,168	489,782,567
派生商品評価勘定	9,900,257	-
未収入金	2,098,118,644	49,793,554
未収配当金	23,396,358	18,473,180
流動資産合計	26,029,003,359	24,114,722,845
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	26,929
未払金	167,400,015	-
未払解約金	1,480,186,000	5,477,289
未払利息	1	2
流動負債合計	1,647,586,016	5,504,220
負債合計	1,647,586,016	5,504,220
純資産の部		
元本等		
元本	8,662,094,483	8,290,025,884
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	15,719,322,860	15,819,192,741
元本等合計	24,381,417,343	24,109,218,625
純資産合計	24,381,417,343	24,109,218,625
負債純資産合計	26,029,003,359	24,114,722,845

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		平成30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
1.	期首	平成29年 1月11日	平成30年 1月11日
	期首元本額	11,939,735,755円	8,662,094,483円
	期首からの追加設定元本額	96,571,641円	1,080,702,509円
	期首からの一部解約元本額	3,374,212,913円	1,452,771,108円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	3,701,750,937円	3,920,551,445円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	139,389,003円	120,520,025円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	257,435,946円	213,338,252円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	2,030,540,977円	1,724,463,176円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	824,154,892円	715,396,282円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	831,920,710円	724,460,631円
	北米株式ファンド	41,908,730円	36,228,769円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	50,527,757円	53,654,539円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	104,534,348円	102,886,717円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	135,258,090円	136,508,882円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	287,991,859円	287,602,842円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	256,681,234円	254,414,324円
	計	8,662,094,483円	8,290,025,884円
2.	受益権の総数	8,662,094,483口	8,290,025,884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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	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30年 1月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,480,186,000	-	1,470,285,743	9,900,257
	米ドル	1,480,186,000	-	1,470,285,743	9,900,257
	合計	1,480,186,000	-	1,470,285,743	9,900,257

(平成30年 7月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	5,477,289	-	5,504,218	26,929
	米ドル	5,477,289	-	5,504,218	26,929
	合計	5,477,289	-	5,504,218	26,929

（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30年 1月10日現在		平成30年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	2.8147円	1口当たり純資産額	2.9082円
(1万口当たり純資産額)	(28,147円)	(1万口当たり純資産額)	(29,082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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,718,731,540	406,914,309
コール・ローン	19,981,655	19,949,526
株式	22,337,014,603	21,222,574,627
派生商品評価勘定	11,758,802	33,932
未収入金	79,970,610	96,761,515
未収配当金	9,684,783	29,873,806
流動資産合計	24,177,141,993	21,776,107,715
資産合計	24,177,141,993	21,776,107,715
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	194,823
未払金	-	200,313,225
未払解約金	1,399,243,062	19,848,972
未払利息	22	32
流動負債合計	1,399,243,084	220,357,052
負債合計	1,399,243,084	220,357,052
純資産の部		
元本等		
元本	6,316,153,078	6,024,972,116
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,461,745,831	15,530,778,547

	平成30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
元本等合計	22,777,898,909	21,555,750,663
純資産合計	22,777,898,909	21,555,750,663
負債純資産合計	24,177,141,993	21,776,107,715

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
1. 期首	平成29年 1月11日	平成30年 1月11日
期首元本額	8,202,646,019円	6,316,153,078円
期首からの追加設定元本額	522,693,715円	588,981,887円
期首からの一部解約元本額	2,409,186,656円	880,162,849円
元本の内訳		
GW7つの卵	2,582,954,186円	2,655,700,232円
グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	84,391,448円	72,440,675円
グローバル・ラップ・バランス 成長型	171,869,443円	147,771,311円
グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	1,425,514,907円	1,257,105,903円
グローバル・ラップ・バランス 積極型	613,387,953円	548,070,019円
グローバル・ラップ・バランス 超積極型	840,538,030円	749,244,317円
欧州先進国株式ファンド	29,746,549円	25,949,626円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	28,794,583円	30,014,248円

年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	62,234,401円	62,651,830円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	88,233,654円	87,741,837円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	198,433,278円	198,969,549円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	190,054,646円	189,312,569円
計	6,316,153,078円	6,024,972,116円
2. 受益権の総数	6,316,153,078口	6,024,972,116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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	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30年 1月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	売建	1,399,243,062	-	1,387,484,260	11,758,802
	英ポンド	1,399,243,062	-	1,387,484,260	11,758,802
合計		1,399,243,062	-	1,387,484,260	11,758,802

(平成30年 7月10日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	30,245,714	-	30,278,912	33,198
	ユーロ	16,192,430	-	16,208,820	16,390
	英ポンド	2,165,949	-	2,175,443	9,494
	スウェーデンクローナ	4,139,460	-	4,142,265	2,805
	ノルウェークローネ	1,020,051	-	1,019,317	734
	デンマーククローネ	6,727,824	-	6,733,067	5,243
	売建	50,094,686	-	50,288,775	194,089
	英ポンド	47,928,737	-	48,111,642	182,905
	デンマーククローネ	2,165,949	-	2,177,133	11,184
合計		80,340,400	-	80,567,687	160,891

(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30年 1月10日現在		平成30年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	3.6063円	1口当たり純資産額	3.5777円
(1万口当たり純資産額)	(36,063円)	(1万口当たり純資産額)	(35,777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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
預金	111,574,055	26,454,448
コール・ローン	361,263,779	69,512,903
株式	6,553,469,731	6,152,599,494
投資証券	134,497,267	235,010,930
派生商品評価勘定	1,018,464	-
未収入金	40,653,599	-
未収配当金	4,554,912	6,634,337
流動資産合計	7,207,031,807	6,490,212,112
資産合計	7,207,031,807	6,490,212,112
負債の部		
流動負債		
未払解約金	430,609,158	5,116,966
未払利息	406	111
流動負債合計	430,609,564	5,117,077
負債合計	430,609,564	5,117,077
純資産の部		
元本等		
元本	948,892,487	922,086,895
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,827,529,756	5,563,008,140
元本等合計	6,776,422,243	6,485,095,035
純資産合計	6,776,422,243	6,485,095,035
負債純資産合計	7,207,031,807	6,490,212,112

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式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。 （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。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券
--------------------	---

	<p>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> <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られ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られ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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
1.	期首	平成29年 1月11日	平成30年 1月11日
	期首元本額	1,291,245,513円	948,892,487円
	期首からの追加設定元本額	6,252,329円	89,066,783円
	期首からの一部解約元本額	348,605,355円	115,872,375円
	元本の内訳		
	GW 7つの卵	370,201,870円	394,219,322円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	12,310,369円	10,716,046円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	26,071,993円	22,459,999円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	204,954,824円	181,901,840円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	105,658,534円	94,952,851円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	127,081,527円	115,404,122円
	アジア太平洋先進国株式ファンド	13,953,579円	12,552,022円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	4,772,790円	5,074,663円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	9,030,251円	9,223,793円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	13,366,558円	13,721,845円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	28,641,342円	29,025,141円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	32,848,850円	32,835,251円	
計	948,892,487円	922,086,895円	
2.	受益権の総数	948,892,487口	922,086,895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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在

貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	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 該当事項はありません。 (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30年 1月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	149,442,639	-	148,424,175	1,018,464
	米ドル	13,708,847	-	13,624,029	84,818
	香港ドル	108,459,750	-	107,775,000	684,750
	シンガポールドル	27,274,042	-	27,025,146	248,896
合計		149,442,639	-	148,424,175	1,018,464

（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30年 7月10日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成30年 1月10日現在		平成30年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	7.1414円	1口当たり純資産額	7.0331円
(1万口当たり純資産額)	(71,414円)	(1万口当たり純資産額)	(70,331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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
資産の部		
流動資産		
預金	690,308,273	162,883,816
コール・ローン	9,999,983	9,994,803
国債証券	9,779,561,038	9,358,398,539
特殊債券	72,962,602	68,575,953
社債券	1,066,576,316	1,218,421,199
派生商品評価勘定	31,395,408	29,821,819
未収入金	101,931,994	-
未収利息	89,839,288	74,382,835
前払費用	8,893,109	9,847,549
差入委託証拠金	120,046,996	135,939,993
流動資産合計	11,971,515,007	11,068,266,506
資産合計	11,971,515,007	11,068,266,506
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,393,364	32,744,644
未払金	60,831,655	-
未払解約金	726,548,765	-
未払利息	11	16
流動負債合計	812,773,795	32,744,660
負債合計	812,773,795	32,744,660
純資産の部		
元本等		
元本	4,378,257,216	4,394,647,833

平成30年 1月10日現在

平成30年 7月10日現在

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,780,483,996	6,640,874,013
元本等合計	11,158,741,212	11,035,521,846
純資産合計	11,158,741,212	11,035,521,846
負債純資産合計	11,971,515,007	11,068,266,506

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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
1.	期首	平成29年 1月11日	平成30年 1月11日
	期首元本額	5,198,064,547円	4,378,257,216円
	期首からの追加設定元本額	136,911,543円	554,121,497円
	期首からの一部解約元本額	956,718,874円	537,730,880円
	元本の内訳		
	GW7つの卵	2,030,810,105円	2,182,619,997円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	100,761,155円	91,726,151円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	162,573,200円	146,714,617円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	1,119,522,134円	1,020,503,994円

グローバル・ラップ・バランス 積極型	440,291,356円	405,991,423円
海外債券ファンド	38,870,286円	32,591,774円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	40,145,199円	44,571,376円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	73,960,265円	78,730,553円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	82,652,981円	87,562,037円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	153,272,678円	162,428,010円
年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	135,397,857円	141,207,901円
計	4,378,257,216円	4,394,647,833円
2. 受益権の総数	4,378,257,216口	4,394,647,833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30年 1月10日現在	平成30年 7月10日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	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30年 1月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,846,361,177	-	1,835,236,025	11,125,152
	売建	1,921,136,271	-	1,912,042,765	9,093,506
合計		3,767,497,448	-	3,747,278,790	2,031,646

(平成30年 7月10日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,356,383,399	-	3,361,119,734	4,736,335
	売建	2,432,829,796	-	2,437,191,298	4,361,502
合計		5,789,213,195	-	5,798,311,032	374,833

(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30年 1月10日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,854,497,795	-	2,846,775,476	7,722,319
	米ドル	1,804,487,760	-	1,807,425,256	2,937,496
	加ドル	74,891,333	-	74,758,100	133,233
	ユーロ	463,294,195	-	456,758,410	6,535,785

英ポンド	67,764,004	-	67,367,010	396,994
スウェーデンク ローナ	157,145,232	-	154,845,600	2,299,632
ノルウェークロー ネ	63,892,139	-	63,571,500	320,639
豪ドル	116,284,649	-	115,378,100	906,549
ニュージーランド ドル	31,604,315	-	31,373,840	230,475
南アフリカランド	75,134,168	-	75,297,660	163,492
売建	3,581,046,560	-	3,565,290,551	15,756,009
米ドル	1,786,558,800	-	1,779,226,281	7,332,519
加ドル	31,917,250	-	31,974,850	57,600
メキシコペソ	16,800,980	-	16,976,600	175,620
ユーロ	971,785,760	-	964,907,580	6,878,180
英ポンド	210,121,650	-	210,160,740	39,090
スイスフラン	29,557,760	-	29,276,160	281,600
スウェーデンク ローナ	89,430,620	-	88,916,100	514,520
ノルウェークロー ネ	17,727,800	-	17,921,900	194,100
デンマーククロー ネ	100,093,440	-	99,506,440	587,000
ポーランドズロチ	23,451,080	-	23,089,560	361,520
豪ドル	38,361,450	-	38,166,900	194,550
ニュージーランド ドル	226,966,000	-	227,079,200	113,200
シンガポールドル	38,273,970	-	38,088,240	185,730
合計	6,435,544,355	-	6,412,066,027	8,033,690

(平成30年 7月10日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	2,050,979,738	-	2,073,211,660	22,231,922
	米ドル	1,699,694,423	-	1,714,214,954	14,520,531
	ユーロ	214,724,429	-	219,113,240	4,388,811
	英ポンド	775,622	-	780,146	4,524

ノルウェークローネ	28,587,093	-	29,326,960	739,867
ポーランドズロチ	39,566,905	-	40,672,800	1,105,895
豪ドル	40,490,618	-	41,450,000	959,382
ニュージーランドドル	20,138,105	-	20,493,000	354,895
南アフリカランド	7,002,543	-	7,160,560	158,017
売建	2,198,123,251	-	2,223,885,433	25,762,182
米ドル	498,428,828	-	502,611,445	4,182,617
加ドル	150,442,850	-	153,177,250	2,734,400
メキシコペソ	16,098,500	-	16,830,250	731,750
ユーロ	305,698,008	-	310,957,035	5,259,027
英ポンド	557,563,740	-	563,731,650	6,167,910
スイスフラン	28,418,560	-	28,684,800	266,240
ノルウェークローネ	9,842,790	-	10,089,360	246,570
デンマーククローネ	94,655,000	-	96,360,000	1,705,000
ポーランドズロチ	21,158,670	-	21,682,080	523,410
豪ドル	58,320,145	-	59,335,123	1,014,978
ニュージーランドドル	408,655,200	-	410,770,800	2,115,600
シンガポールドル	48,840,960	-	49,655,640	814,680
合計	4,249,102,989	-	4,297,097,093	3,530,260

(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30年 1月10日現在）

該当事項はありません。

（平成30年 7月10日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	金利先物取引				
	買建	594,052,508	-	593,818,384	234,124
	売建	999,344,531	566,076,291	998,877,805	466,726
合計		1,593,397,039	566,076,291	1,592,696,189	232,602

（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30年 1月10日現在		平成30年 7月10日現在	
1口当たり純資産額	2.5487円	1口当たり純資産額	2.5111円
(1万口当たり純資産額)	(25,487円)	(1万口当たり純資産額)	(25,111円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2018年 7月31日現在です。

【GW7つの卵】

【純資産額計算書】

資産総額	58,294,784,889円
------	-----------------

負債総額	99,666,433円
純資産総額（ - ）	58,195,118,456円
発行済口数	55,621,898,107口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0463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	31,482,207,922円
負債総額	444,464,001円
純資産総額（ - ）	31,037,743,921円
発行済口数	13,296,512,800口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3343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	10,166,915,466円
負債総額	33,736,988円
純資産総額（ - ）	10,133,178,478円
発行済口数	1,453,182,053口
1口当たり純資産額（ / ）	6.9731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	79,471,436,809円
負債総額	4,200,290,703円
純資産総額（ - ）	75,271,146,106円
発行済口数	54,408,085,674口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3835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	23,646,809,331円
負債総額	1円
純資産総額（ - ）	23,646,809,330円
発行済口数	8,156,392,591口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8992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	21,440,312,316円
負債総額	1,896,785円
純資産総額（ - ）	21,438,415,531円
発行済口数	5,939,864,149口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6092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	6,417,396,640円
負債総額	41円
純資産総額（ - ）	6,417,396,599円
発行済口数	913,118,666口
1口当たり純資産額（ / ）	7.0280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	10,845,512,708円
負債総額	35,716,281円
純資産総額（ - ）	10,809,796,427円
発行済口数	4,336,959,973口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4925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

2018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（2018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（2018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、2018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	812	180,056
株式投資信託	770	152,822
単位型	232	8,569
追加型	538	144,252
公社債投資信託	42	27,234
単位型	28	479
追加型	14	26,754

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59期事業年度（平成29年4月1日から平成30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58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
(単位：百万円)				
資産の部				
流動資産				
現金・預金	3	16,761	3	14,024
金銭の信託	3	152		-
有価証券		10		19
前払費用		506		551
未収入金		136		73
未収委託者報酬		10,757		15,873
未収収益	3	2,799	3	3,174
関係会社短期貸付金		962		1,128
立替金		1,240		2,776
繰延税金資産		865		1,014
その他	2,3	385	2,3	4,179
流動資産合計		34,577		42,814
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	93	1	68
器具備品	1	190	1	122
有形固定資産合計		283		191

無形固定資産		
ソフトウェア	138	99
無形固定資産合計	138	99
投資その他の資産		
投資有価証券	11,783	14,103
関係会社株式	23,203	25,769
関係会社長期貸付金	60	-
長期差入保証金	782	490
長期前払費用	0	0
繰延税金資産	423	489
投資その他の資産合計	36,253	40,854
固定資産合計	36,674	41,144
資産合計	71,252	83,959

(単位：百万円)

	第58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金	3	589	3	3,804
未払金		4,043		5,874
未払収益分配金		7		7
未払償還金		91		91
未払手数料	3	3,499	3	5,124
その他未払金		445		651
未払費用	3	4,229	3	4,634
未払法人税等		1,808		2,185
未払消費税等	4	538	4	788
賞与引当金		2,077		2,286
役員賞与引当金		168		198
その他	3	62		41
流動負債合計		13,517		19,813
固定負債				
退職給付引当金		1,259		1,316
その他		-		318
固定負債合計		1,259		1,634
負債合計		14,777		21,448
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		34,015		39,959

利益剰余金合計	34,015	39,959
自己株式	672	786
株主資本合計	55,926	61,756
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282	408
繰延ヘッジ損益	266	346
評価・換算差額等合計	548	754
純資産合計	56,475	62,511
負債純資産合計	71,252	83,959

(2) 【損益計算書】

< 更新後 >

	(単位：百万円)	
	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	64,680	70,609
その他営業収益	4,218	5,398
営業収益合計	68,898	76,008
営業費用		
支払手数料	28,675	30,448
広告宣伝費	969	973
公告費	2	2
調査費	17,322	18,132
調査費	841	862
委託調査費	16,456	17,241
図書費	24	28
委託計算費	498	520
営業雑経費	656	740
通信費	185	173
印刷費	276	348
協会費	66	68
諸会費	17	24
その他	111	125
営業費用計	48,124	50,817
一般管理費		
給料	8,243	9,096
役員報酬	360	507
役員賞与引当金繰入額	168	198
給料・手当	5,576	6,083
賞与	61	20
賞与引当金繰入額	2,077	2,286
交際費	99	99
寄付金	17	16
旅費交通費	412	455
租税公課	375	424
不動産賃借料	889	890
退職給付費用	390	355

退職金	20	24
固定資産減価償却費	192	152
福利費	959	974
諸経費	2,791	3,175
一般管理費計	14,394	15,664
営業利益	6,380	9,526

(単位：百万円)

	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		19		26
受取配当金	1	1,644	1	1,120
有価証券償還益		-		1
時効成立分配金・償還金		22		1
為替差益		177		79
その他		36		41
営業外収益合計		1,899		1,272
営業外費用				
支払利息	1	223	1	223
有価証券償還損		7		-
デリバティブ費用	1	146	1	295
時効成立後支払分配金・償還金		2		0
支払源泉所得税		155		-
長期差入保証金償却額		-		212
その他		73		34
営業外費用合計		608		767
経常利益		7,670		10,030
特別利益				
投資有価証券売却益		174		199
特別利益合計		174		199
特別損失				
投資有価証券売却損		120		133
固定資産処分損		13		7
役員退職一時金		-		117
損害賠償損失		-		81
特別損失合計		134		340
税引前当期純利益		7,710		9,890
法人税、住民税及び事業税		2,137		3,217
過年度法人税等	2	115		-
法人税等調整額		104		307
法人税等合計		2,147		2,910
当期純利益		5,562		6,979

(3) 【株主資本等変動計算書】

< 更新後 >

第58期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	29,948	29,948	502	52,028
当期変動額							
剰余金の配当				1,495	1,495		1,495
当期純利益				5,562	5,562		5,562
自己株式の取得						170	170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	4,067	4,067	170	3,897
当期末残高	17,363	5,220	5,220	34,015	34,015	672	55,926

	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	151	258	410	52,438
当期変動額				
剰余金の配当				1,495
当期純利益				5,562
自己株式の取得				170
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	130	7	138	138
当期変動額合計	130	7	138	4,036
当期末残高	282	266	548	56,475

第59期（自 平成29年4月1日 至 平成30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	34,015	34,015	672	55,926
当期変動額							
剰余金の配当				1,036	1,036		1,036
当期純利益				6,979	6,979		6,979
自己株式の取得						113	113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計				5,943	5,943	113	5,830
当期末残高	17,363	5,220	5,220	39,959	39,959	786	61,756

	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	282	266	548	56,475
当期変動額				
剰余金の配当				1,036
当期純利益				6,979
自己株式の取得				113
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	125	80	206	206
当期変動額合計	125	80	206	6,036
当期末残高	408	346	754	62,511

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
	1 資産の評価基準及び評価方法
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 5年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p>

<p>4 ヘッジ会計の方法</p> <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>	<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翌事業年度から費用処理しております。</p> <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> <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>
--	--

(貸借対照表関係)

第58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,222百万円</p> <p>器具備品 603百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,260百万円</p> <p>器具備品 612百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち3,030百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,243百万円</p> <p>金銭の信託 152百万円</p> <p>未収収益 619百万円</p> <p>その他 20百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 177百万円</p> <p>未払手数料 144百万円</p> <p>未払費用 251百万円</p> <p>その他 61百万円</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>現金・預金 3,189百万円</p> <p>未収収益 592百万円</p> <p>その他 345百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>預り金 419百万円</p> <p>未払手数料 376百万円</p> <p>未払費用 677百万円</p>
<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>

<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務587百万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546百万円に対して保証を行っております。</p>	<p>5 保証債務</p> <p>当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務553百万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103百万円に対して保証を行っております。</p>
---	--

(損益計算書関係)

第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	第59期 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)												
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">1,550百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">347百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">58百万円</td> </tr> </table> <p>2 過年度の取引に関する法人税等の追加費用計上額です。</p>	受取配当金	1,550百万円	デリバティブ収益	347百万円	支払利息	58百万円	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">受取配当金</td> <td style="text-align: right;">979百万円</td> </tr> <tr> <td>デリバティブ収益</td> <td style="text-align: right;">407百万円</td> </tr> <tr> <td>支払利息</td> <td style="text-align: right;">213百万円</td> </tr> </table>	受取配当金	979百万円	デリバティブ収益	407百万円	支払利息	213百万円
受取配当金	1,550百万円												
デリバティブ収益	347百万円												
支払利息	58百万円												
受取配当金	979百万円												
デリバティブ収益	407百万円												
支払利息	213百万円												

(株主資本等変動計算書関係)

第58期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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)	814,100	305,000	-	1,119,100

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	1,762,200	-	72,600	1,689,600	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	-	174,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,738,800	-	1,848,000	2,890,800	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	-	4,437,000	33,000	4,404,000	-
合計		6,675,900	4,437,000	1,953,600	9,159,300	-

(注) 1 平成28年度ストックオプション(1)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 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。

- 3 平成21年度ストックオプション(1)1,689,600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)2,890,800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。また、平成28年度ストックオプション(1)は、権利行使期間の初日が到来していません。

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28年5月30日 取締役会	普通株式	1,495	7.62	平成28年3月31日	平成28年6月22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29年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22日

第59期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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)	1,119,100	182,600	-	1,301,700

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	1,689,600	-	194,700	1,494,900	-
平成21年度 ストックオプション(2)	普通株式	174,900	-	66,000	108,900	-
平成23年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,890,800	-	204,600	2,686,200	-
平成28年度 ストックオプション(1)	普通株式	4,404,000	-	786,000	3,618,000	-
平成28年度 ストックオプション(2)	普通株式	-	4,409,000	532,000	3,877,000	-
合計		9,159,300	4,409,000	1,783,300	11,785,000	-

(注)1 平成28年度ストックオプション(2)の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

2 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。

3 平成21年度ストックオプション(1)1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2)108,900株及び平成23年度ストックオプション(1)2,686,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成28年度ストックオプション(1)及び平成28年度ストックオプション(2)は、権利行使期間の初日が到来していません。

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29年5月25日 取締役会	普通株式	1,036	5.29	平成29年3月31日	平成29年6月22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30年5月31日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,640	8.38	平成30年3月31日	平成30年6月23日

(リース取引関係)

第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30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	865百万円	1年内	866百万円
1年超	1,787百万円	1年超	923百万円
合計	2,653百万円	合計	1,790百万円

(金融商品関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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 - 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、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29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	16,761	16,761	-
(2) 未収委託者報酬	10,757	10,757	-
(3) 未収収益	2,799	2,799	-
(4) 関係会社短期貸付金	962	962	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,777	11,777	-
(6) 未払金	(4,043)	(4,043)	-
(7) 未払費用	(4,229)	(4,229)	-
(8) 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	35	35	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(1)	(1)	-
デリバティブ取引計	34	34	-

(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) 未払金及び(7) 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。

(8) 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ていないもののうち75百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、39百万円は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ているものうち20百万円は貸借対照表上流動資産のその他に含まれ、22百万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 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式(貸借対照表計上額20,310百万円)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	16,761	-	-	-
未収委託者報酬	10,757	-	-	-
未収収益	2,799	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	10	616	907	735
合計	30,328	616	907	735

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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、自社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せんが、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30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	14,024	14,024	-
(2) 未収委託者報酬	15,873	15,873	-
(3) 未収収益	3,174	3,174	-
(4) 関係会社短期貸付金	1,128	1,128	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	14,106	14,106	-
(6) 未払金	(5,874)	(5,874)	-
(7) 未払費用	(4,634)	(4,634)	-

(8) 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	(14)	(14)	-	
ヘッジ会計が適用されているもの	336	336	-	
デリバティブ取引計	321	321	-	

(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) 未払金及び(7) 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。

(8) 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ていないもののうち8百万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。また、ヘッジ会計が適用されているものは貸借対照表上流動資産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 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22,876百万円）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	14,024	-	-	-
未収委託者報酬	15,873	-	-	-
未収収益	3,174	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	19	616	1,743	545
合計	33,090	616	1,743	545

(有価証券関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
--	----------

子会社株式	20,310
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	6,299	5,590	708
	小計	6,299	5,590	708
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	5,478	5,780	302
	小計	5,478	5,780	302
合計		11,777	11,370	406

(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
投資信託	3,198	174	120
合計	3,198	174	120

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	22,876
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	8,544	7,535	1,008
	小計	8,544	7,535	1,008
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	5,561	5,982	420
	小計	5,561	5,982	420

合計	14,106	13,518	588
----	--------	--------	-----

(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
投資信託	2,792	199	133
合計	2,792	199	133

(デリバティブ取引関係)

第58期(平成29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	1,729	-	35	35
	買建	-	-	-	-
合計		1,729	-	35	35

(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	2,993	-	11
	豪ドル	有価証券	77	-	2
	シンガポールドル		1,639	-	20
	香港ドル		205	-	2
	人民元		1,946	-	6
ユーロ		57	-	0	
合計			6,920	-	1

(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59期(平成30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	2,422	-	14	14
	買建	-	-	-	-
合計		2,422	-	14	14

(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	投資 有価証券			
	売建				
	米ドル		4,447	-	196
	豪ドル		109	-	10
	シンガポールドル		1,783	-	65
	香港ドル		541	-	25
	人民元		2,156	-	32
ユーロ	154	-	6		
合計			9,192	-	336

(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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30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	3,030	(1) 関連会社に対する投資の金額	3,008
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	9,455	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	10,409
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,092	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,827

(退職給付関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	1,299
勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	190
退職給付の支払額	72
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,190</u>

(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	1,190
未積立退職給付債務	1,190
未認識数理計算上の差異	69
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>
退職給付引当金	1,259
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,259</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	150
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	23
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>177</u>

(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、213百万円でありました。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	1,190
勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	66
退職給付の支払額	76
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,313</u>

(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	1,313
未積立退職給付債務	1,313
未認識数理計算上の差異	2
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

退職給付引当金	1,316
貸借対照表に計上された負債の額	1,316

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	130
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	0
確定給付制度に係る退職給付費用	132

(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、222百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16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 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	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。	平成30年7月15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3分の1、3分の1、3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25年10月7日から 平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31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	1,762,200	174,900
付与	0	0
失効	72,600	0
権利確定	0	0
権利未確定残	1,689,600	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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	4,738,800	-
付与	0	4,437,000
失効	1,848,000	33,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,890,800	4,404,000
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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利行使価格(円)	737 (注)3	558
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(取引事例比準法等による評価額と行使価格との差額)の積みによっております。

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

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の取締役・従業員 16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 6,101,700株	普通株式 4,437,000株

付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定条件	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。	平成30年7月15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3分の1、3分の1、3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25年10月7日から 平成33年10月6日まで	平成30年7月15日から 平成38年7月31日まで

	平成28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 31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 4,409,000株
付与日	平成29年4月27日
権利確定条件	平成31年4月27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3分の1、3分の1、3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
権利行使期間	平成31年4月27日から 平成39年4月30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	1,689,600	174,900
付与	0	0
失効	194,700	66,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,494,900	108,900
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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利確定前(株)		
期首	2,890,800	4,404,000
付与	0	0
失効	204,600	786,000
権利確定	0	0
権利未確定残	2,686,200	3,618,000
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28年度ストックオプション(2)
付与日	平成29年4月27日
権利確定前(株)	
期首	-
付与	4,409,000
失効	532,000
権利確定	0
権利未確定残	3,877,000
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23年度ストックオプション(1)	平成28年度ストックオプション(1)
付与日	平成23年10月7日	平成28年7月15日
権利行使価格(円)	737(注) 3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	平成28年度ストックオプション(2)

付与日	平成29年4月27日
権利行使価格(円)	553
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法等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 1,149百万円
- 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に調整される。）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58期 (平成29年3月31日)		第59期 (平成30年3月31日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳	1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳
	(単位：百万円)		(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 641		賞与引当金 700
	その他 224		その他 314
	小計 865		小計 1,014
	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 96		投資有価証券評価損 96
	関係会社株式評価損 1,430		関係会社株式評価損 1,430
	退職給付引当金 385		退職給付引当金 402
	固定資産減価償却費 119		固定資産減価償却費 111
	その他 63		その他 211
	小計 2,095		小計 2,253
	繰延税金資産小計 2,961		繰延税金資産小計 3,268
	評価性引当金 1,430		評価性引当金 1,430
	繰延税金資産合計 1,530		繰延税金資産合計 1,838
	繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)
	その他有価証券評価差額金 0		その他有価証券評価差額金 -
	小計 0		小計 -
	繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)
	その他有価証券評価差額金 123		その他有価証券評価差額金 180
	繰延ヘッジ利益 117		繰延ヘッジ利益 152
	小計 241		小計 333
	繰延税金負債合計 242		繰延税金負債合計 333
	繰延税金資産の純額 1,288		繰延税金資産の純額 1,504

<p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率 (調整)</td> <td style="text-align: right;">30.9%</td> </tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">0.6%</td> </tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">5.3%</td> </tr> <tr> <td>過年度法人税等</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> <tr> <td>海外子会社の留保利益の影響額等</td> <td style="text-align: right;">0.2%</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">27.9%</td> </tr> </table>	法定実効税率 (調整)	30.9%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.3%	過年度法人税等	1.5%	海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%	<p>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</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>
法定実効税率 (調整)	30.9%												
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%												
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.3%												
過年度法人税等	1.5%												
海外子会社の留保利益の影響額等	0.2%												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9%												

(関連当事者情報)

第58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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	312,000 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	65 (SGD 800 千) (注2)	関係会社短期貸付金	385 (SGD 4,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13 (SGD 177 千)	未収収益	8 (SGD 105千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	4,422 (注4)	関係会社短期貸付金	577
							貸付金利息(円貸建)(注3)	3	未収収益	3
							-	1,501 (SGD 20,000 千) (注5)	-	-
子会社	Nikko Asset Management Americas, Inc.	アメリカ合衆国	181,542 (USD 千) (注6)	アセットマネジメント業	間接 100.00	資金の借入	資金の借入(米ドル貸建)(注7)	5,549 (USD 50,000 千) (注8)	関係会社短期借入金	-
							借入金利息(米ドル貸建)(注7)	48 (USD 453 千)	未払費用	-

(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65百万円(SGD800千)の内訳は、貸付505百万円(SGD6,600千)及び返済439百万円(SGD5,800千)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 資金の貸付に係る取引金額 4,422百万円の内訳は、貸付577百万円及び返済5,000百万円であります。
- 5 Nikko Asset Management International Limitedの行った20,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 6 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。
- 7 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。
- 8 資金の借入に係る取引金額 5,549百万円(USD 50,000千)は、返済であります。

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28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	25,221百万円
負債合計	5,428百万円
純資産合計	19,792百万円
営業収益	18,250百万円
税引前当期純利益	6,809百万円
当期純利益	4,680百万円

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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	342,369(SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	資金の貸付	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	159(SGD 2,000千)(注2)	関係会社短期貸付金	550(SGD 6,800千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	13(SGD 162千)	未収収益	8(SGD 110千)
							資金の貸付(円貸建)(注3)	-	関係会社短期貸付金	577

							貸付金利息 (円貨建) (注3)	12	未収収益	3
						-	増資の引受 (注4)	2,466 (SGD 30,369千)	-	-
子会社	日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社	日本	100 (百万円)	金融商品取引業者として登録を受けるための準備会社	直接 100.00	-	増資の引受 (注5)	100	-	-

(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159百万円(SGD2,000千)の内訳は、貸付159百万円(SGD2,000千)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 International Limitedの行った30,369,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。
- 5 日本インスティテューショナル証券設立準備株式会社の行った2,000株の新株発行を、1株につき50千円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

三井住友信託銀行株式会社(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロンドン)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29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	27,012百万円
負債合計	5,141百万円
純資産合計	21,871百万円
営業収益	15,830百万円
税引前当期純利益	5,266百万円
当期純利益	3,594百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第58期(自平成28年4月1日至平成29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59期(自平成29年4月1日至平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29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59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

第59期(自 平成29年4月1日 至 平成30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58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	288円29銭	319円40銭
1株当たり当期純利益金額	28円38銭	35円64銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第58期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第59期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	5,562	6,979
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)	5,562	6,979
普通株式の期中平均株式数(千株)	196,009	195,794
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) 1,689,600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) 2,890,800株、平成28年度ストックオプション(1) 4,404,000株	平成21年度ストックオプション(1) 1,494,900株、平成21年度ストックオプション(2) 108,900株、平成23年度ストックオプション(1) 2,686,200株、平成28年度ストックオプション(1) 3,618,000株、平成28年度ストックオプション(2) 3,877,000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58期 (平成29年3月31日)	第59期 (平成30年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	56,475	62,511
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)	56,475	62,511
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)	195,893	195,711

(重要な後発事象)

新株予約権(ストックオプション)の付与

当社は平成30年3月15日付の臨時株主総会及び平成30年3月20日開催の取締役会の決議に基づき、平成30年4月27日にストックオプションとして新株予約権を当社、当社子会社の取締役及び従業員36名に

付与いたしました。

新株予約権の数	4,422個
新株予約権の目的となる株式の種類及び数	当社普通株式 4,422,000株
新株予約権の発行価額	無償
新株予約権の行使時の払込金額	1株当たり金694円
新株予約権の行使期間	平成32年4月27日から平成40年4月30日まで

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 (2018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 (2018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T T証券株式会社	1,250百万円	
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	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
九州F G証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	
上光証券株式会社 1	500百万円	
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T T証券株式会社	3,000百万円	
日産証券株式会社	1,500百万円	
野村證券株式会社	10,000百万円	

浜銀 T T 証券株式会社	3,307百万円	
ばんせい証券株式会社	1,558百万円	
ひろぎん証券株式会社 1	5,000百万円	
ほくほく T T 証券株式会社 1	1,250百万円	
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	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社秋田銀行	14,100百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社沖縄銀行	22,725百万円	
株式会社鹿児島銀行	18,130百万円	
株式会社関西アーバン銀行	47,039百万円	
株式会社北九州銀行	10,000百万円	
株式会社北日本銀行	7,761百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社近畿大阪銀行	38,971百万円	
株式会社群馬銀行	48,652百万円	
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社十八銀行	24,404百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社徳島銀行 1	11,036百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社長野銀行	13,017百万円	
株式会社南都銀行	37,924百万円	
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	
全国信用協同組合連合会	67,275百万円 (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	770百万米ドル (2017年12月末現在)	資産運用に関する業務を営んでいます。
MFS インターナショナル(U.K.) リミテッド	1,996千英ポンド (2017年12月末現在)	
JPMorgan・アセット・マネジメン ト株式会社	2,218百万円 (2017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	1,070.6百万米ドル (2017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 (2017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 (2017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 (2018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 (2017年12月末現在)	
三井住友トラスト・アセットマネジ メント株式会社	300百万円 (2018年3月末現在)	

2 【関係業務の概要】

<更新後>

(3) 投資顧問会社

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

JPMorgan・アセット・マネジメン
ト株式会社

スパークス・アセット・マネジメン
ト株式会社

三井住友トラスト・アセットマネジ
メント株式会社

ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシー

MFSインターナショナル(U.K.)リミテッド

シュローダー・インベストメント・マネージメント(シンガポール)リミテッド

ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー

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

日興グローバルラップ株式会社

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

日興アセットマネジメント アメリカズ・インク

3【資本関係】

<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。(2018年3月末現在)

<更新後>

(3) 投資顧問会社

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。(2018年3月末現在)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年8月22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30年1月11日から平成30年7月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続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30年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年1月11日から平成30年7月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 羽 太 典 明
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 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29年4月1日から平成30年3月31日までの第59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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注)1.上記は、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。