

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】 関東財務局長殿
【提出日】 平成28年 8 月 4 日提出
【発行者名】 レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 桑畑 卓
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目 5 番 1 号
【事務連絡者氏名】 藤田 剛志
【電話番号】 03-5219-5700

【届出の対象とした募集内国投資 L M ・ グローバル ・ プラス（毎月分配型）
信託受益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資 2 兆円を上限とします。
信託受益証券の金額】

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成28年2月4日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部に訂正事項がありこれを訂正するため、本訂正届出書を提出いたします。

【訂正の内容】

下線部_____は訂正箇所を表します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

（訂正前）

（前略）

委託会社等の概況（平成27年11月末現在）

（以下略）

（訂正後）

（前略）

委託会社等の概況（平成28年5月末現在）

（以下略）

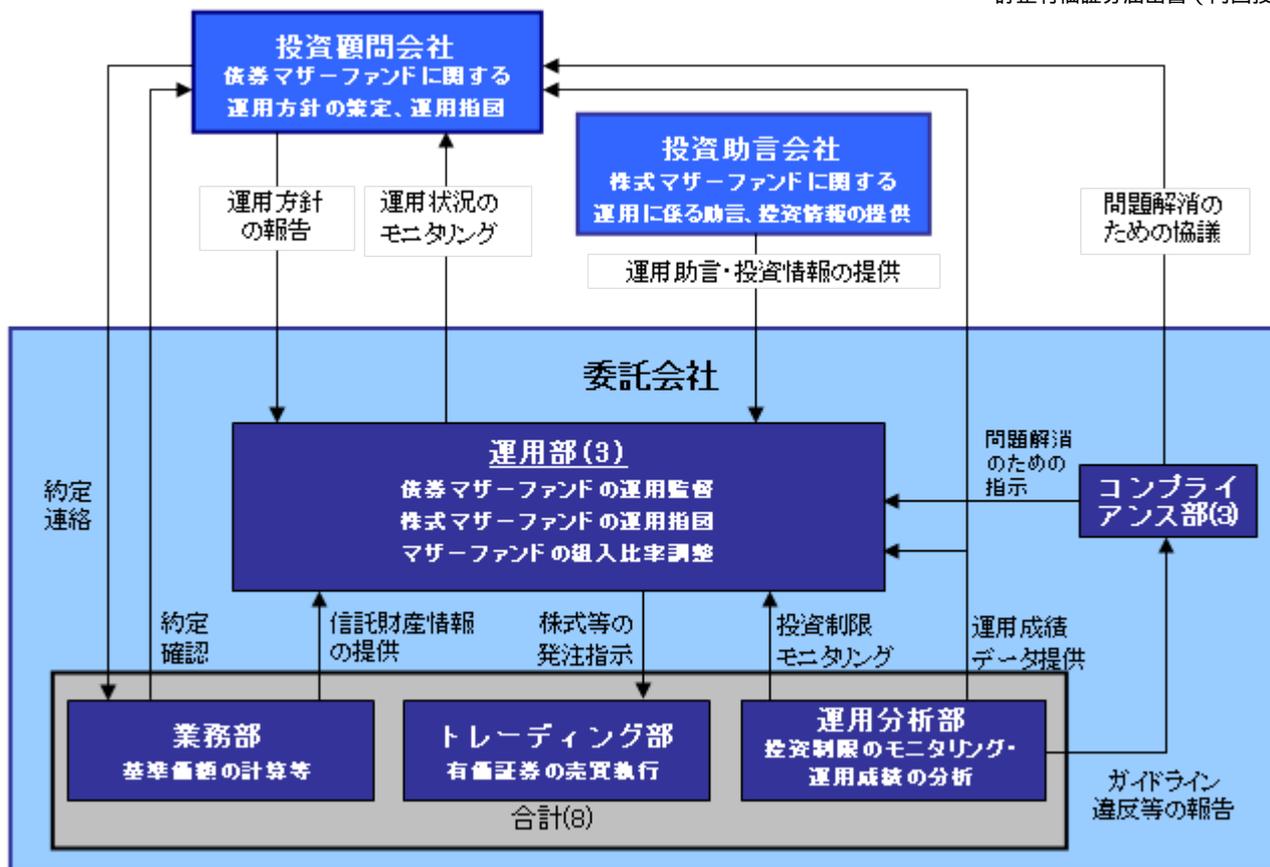
2【投資方針】

(3)【運用体制】

（訂正前）

（前略）

ファンドの運用体制



(注) 括弧内は平成27年11月末現在の各部署に属する人数（業務部、トレーディング部及び運用分析部は、上記業務に従事する人数の合計）を示します。

委託会社は、投資顧問会社との間で、LM・グローバル債券マザーファンドの運用に関する投資一任契約を締結するとともに、ファンドの運用に関するガイドライン（運用目標、投資対象、投資制限等）を投資顧問会社へ指示します。

投資顧問会社では、ファンドの信託約款、投資一任契約書及び委託会社から指示された運用に関するガイドラインを遵守して運用を行います。

委託会社の運用部は、投資助言会社から受けた投資助言に基づき、LM・グローバル株式マザーファンドの運用方針を決定し、トレーディング部に株式等の発注を指示します。

委託会社の運用部は、投資顧問会社の運用状況について、投資一任契約書、ガイドライン等を遵守し適切に行われていることを監督します。運用部は、投資顧問会社に対して、必要に応じて投資環境の見直し、運用方針等についての情報提供を求めます。

委託会社の運用分析部は、ファンドのポートフォリオが各種投資制限にしたがった状況となっているのかモニタリングを行い、投資制限の違反または違反のおそれのある場合には、コンプライアンス部に報告します。報告を受けたコンプライアンス部では、投資顧問会社のコンプライアンス部門と連携して問題解消に向けた措置をとります。また、運用分析部は、ファンドの運用成績について分析を行い、分析結果を委託会社の運用部及び関連部署並びに投資顧問会社にフィードバックします。

運用に関する社内委員会として、運用部及び関連部署の代表で構成される東京運用委員会が月次で開催されます。東京運用委員会では、運用状況の確認を行い、必要に応じて要因分析等の詳細な検討等を行います。また、投資顧問会社の運用方針、運用戦略及びポートフォリオの変更が行われた際の経緯等が記録されます。東京運用委員会の議事録は社長及び取締役会に報告されます。

（中略）

(注) ファンドの運用体制及び管理体制は、平成27年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(訂正後)

(5)【投資制限】

(訂正前)

(前略)

(参考)

LM・グローバル債券マザーファンド

(1)投資方針

(中略)

運用方法

(中略)

<ウエスタン・アセットの概要> (平成27年11月末現在)

本部：米国カリフォルニア州パサデナ、1971年設立

レグ・メイソン・インクの100%子会社

アクティブ運用に特化。チーム体制を採用し、セクターを重視する運用

ニューヨーク、ロンドン、東京、シンガポール、メルボルン、サンパウロにも運用拠点

(中略)

(参考)

LM・グローバル株式マザーファンド

(1)投資方針

(中略)

運用方法

(中略)

<QSインベスターズ・エルエルシーの概要> (平成27年11月末現在)

本社：米国ニューヨーク州ニューヨーク、1999年設立

グローバル株式戦略、米国株式戦略の他、アセット・アロケーション戦略や、流動性を確保したオルタナティブ戦略等を提供。

(以下略)

(訂正後)

(前略)

(参考)

LM・グローバル債券マザーファンド

(1)投資方針

(中略)

運用方法

(中略)

<ウエスタン・アセットの概要> (平成28年5月末現在)

本部：米国カリフォルニア州パサデナ、1971年設立

レグ・メイソン・インクの100%子会社

アクティブ運用に特化。チーム体制を採用し、セクターを重視する運用

ニューヨーク、ロンドン、東京、シンガポール、メルボルン、サンパウロにも運用拠点

(中略)

(参考)

LM・グローバル株式マザーファンド

(1)投資方針

(中略)

運用方法

(中略)

<QSインベスターズ・エルエルシーの概要> (平成28年5月末現在)

本社：米国ニューヨーク州ニューヨーク、1999年に大手資産運用会社のクオンツ運用部門として組織され、2010年に独立した投資顧問会社となる。

グローバル株式戦略、米国株式戦略の他、アセット・アロケーション戦略や、流動性を確保したオルタナティブ戦略等を提供。

(以下略)

3【投資リスク】

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

(更新・訂正後)

(前略)

(3)投資リスクに対する管理体制

(中略)

(注) リスク管理体制は、今後、変更となる場合があります。

参考情報

ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



「ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移」の留意点

- ※1 当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※2 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」の留意点

- ※1 上記グラフは、当ファンドと代表的な資産クラスの値動きを定量的に比較することを目的として作成したもので、全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ※2 2011年6月～2016年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しております。
- ※3 当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*各資産クラスの騰落率を計算するために使用した指数

日本株 …東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、ヘッジなし・円ベース)
 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、ヘッジなし・円ベース)
 日本国債…シティ日本国債インデックス(円ベース)
 先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
 新興国債…シティ新興国市場国債インデックス(ヘッジなし・円ベース)

(注1) 海外の指数は、各資産クラスに為替ヘッジなしによる投資を行うことを想定して、円ベースの指数を採用しております。

(注2) 上記各指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はその指数を算出、公表しているそれぞれの主体に帰属します(TOPIX:株式会社東京証券取引所、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックス:MSCI Inc.、シティ日本国債インデックス、シティ世界国債インデックス、シティ新興国市場国債インデックス: Citigroup Index LLC)。また、それぞれの主体は当ファンドの運用に関して一切の責任を負うものではありません。

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

(訂正前)

(前略)

個人の受益者に対する課税

(中略)

c. 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

平成28年4月1日以降、0歳から19歳までの未成年者の方を対象とした未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」が開始され、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間、原則非課税となります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

（注）上記は、平成28年1月1日現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容、税率等が変更される場合があります。

（訂正後）

（前略）

個人の受益者に対する課税

（中略）

c. 公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度及び未成年者少額投資非課税制度の適用対象です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」及び未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

（注）上記は平成28年5月末現在のものです。税法が改正された場合等には、内容、税率等が変更される場合があります。

5【運用状況】

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

（更新・訂正後）

以下は、平成28年5月31日現在の運用状況であります。また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）【投資状況】

LM・グローバル・プラス（毎月分配型）

資産の種類	国名/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	47,753,597,540	99.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,962,039	0.01
合計(純資産総額)		47,759,559,579	100.00

（参考）LM・グローバル債券マザーファンド

資産の種類	国名/地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	--------	---------	---------

国債証券	アメリカ	14,602,284,094	37.99
	カナダ	785,700,390	2.04
	メキシコ	1,937,682,649	5.04
	ドイツ	1,912,931,888	4.98
	イタリア	5,643,717,531	14.68
	フランス	3,317,116,632	8.63
	スペイン	944,655,112	2.46
	ベルギー	2,276,050,453	5.92
	イギリス	3,080,543,170	8.02
	スウェーデン	138,267,647	0.36
	ポーランド	1,740,629,659	4.53
	オーストラリア	247,907,182	0.65
	小計	36,627,486,407	95.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,807,754,352	4.70
合計(純資産総額)		38,435,240,759	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	12,845,236,970	33.42
	買建	ドイツ	5,056,874,482	13.15
	買建	オーストラリア	371,978,528	0.96
	売建	アメリカ	13,300,928,018	34.60
	売建	ドイツ	8,903,541,900	23.16
	売建	イギリス	1,458,032,796	3.79
債券オプション取引	売建	ドイツ	3,439,943	0.01

(注) その他の資産として、先物取引を利用しております。評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

(参考) LM・グローバル株式マザーファンド

資産の種類	国名/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	--------	---------	---------

株式	アメリカ	9,159,609,879	58.15
	カナダ	729,897,894	4.63
	ドイツ	330,226,475	2.10
	イタリア	27,318,778	0.17
	フランス	447,565,827	2.84
	オランダ	496,151,841	3.15
	スペイン	339,514,093	2.16
	ベルギー	57,863,507	0.37
	ルクセンブルク	63,114,021	0.40
	フィンランド	271,251,618	1.72
	アイルランド	129,179,645	0.82
	イギリス	952,169,761	6.04
	スイス	340,657,096	2.16
	スウェーデン	291,786,984	1.85
	ノルウェー	118,073,163	0.75
	デンマーク	94,734,000	0.60
	ケイマン諸島	22,231,104	0.14
	オーストラリア	314,423,994	2.00
	バミューダ	179,317,149	1.14
	香港	227,752,434	1.45
	シンガポール	107,941,403	0.69
	イスラエル	270,012,491	1.71
	プエルトリコ	53,128,057	0.34
ジャージー	292,962,899	1.86	
ガーンジー	47,623,658	0.30	
	小計	15,364,507,771	97.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		388,087,106	2.46
合計(純資産総額)		15,752,594,877	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

LM・グローバル・プラス(毎月分配型)

a. 上位30銘柄

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	LM・グローバル債券マザー ファンド	13,772,456,704	2.2698	31,260,722,227	2.3237	32,003,057,643	67.01
2	日本	親投資信託 受益証券	LM・グローバル株式マザー ファンド	6,196,608,662	2.3935	14,831,582,833	2.5418	15,750,539,897	32.98

b. 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

(参考) LM・グローバル債券マザーファンド

a. 上位30銘柄

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

1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	22,210,000	13,519.07	3,002,587,459	13,388.63	2,973,616,481	3.625	2044/2/15	7.74
2	イギリス	国債証券	UK TREASURY	12,700,000	22,456.66	2,851,996,773	22,590.73	2,869,023,002	4.250	2040/12/7	7.46
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	16,940,000	15,258.58	2,584,804,070	15,131.60	2,563,294,610	4.500	2039/8/15	6.67
4	アメリカ	国債証券	T-NOTE INFLATION INDEX	21,630,000	11,006.35	2,377,861,345	11,084.46	2,409,845,581	0.250	2025/1/15	6.27
5	ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	17,740,000	12,805.19	2,271,641,416	12,830.04	2,276,050,453	0.800	2025/6/22	5.92
6	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	60,600,000	2,922.90	1,771,279,769	2,872.32	1,740,629,659	3.250	2025/7/25	4.53
7	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI INFL	10,750,000	13,356.67	1,589,078,604	13,470.67	1,599,786,173	2.350	2019/9/15	4.16
8	ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	12,390,000	12,794.06	1,585,184,715	12,775.39	1,582,871,360	0.500	2026/2/15	4.12
9	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	215,514,600	665.08	1,433,354,480	664.51	1,432,123,999	7.750	2042/11/13	3.73
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	12,690,000	11,281.21	1,431,585,707	11,234.84	1,425,701,420	1.500	2018/12/31	3.71
11	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	10,240,000	13,862.15	1,419,484,590	13,855.60	1,418,813,517	1.750	2023/5/25	3.69
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	7,240,000	18,248.76	1,321,210,340	18,146.50	1,313,806,821	5.000	2040/9/1	3.42
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	11,650,000	11,130.83	1,296,742,338	11,120.43	1,295,530,665	1.000	2017/9/15	3.37
14	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	7,880,000	14,438.61	1,137,762,507	14,413.50	1,135,784,552	2.250	2024/5/25	2.96
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	9,435,000	11,851.07	1,118,149,290	11,760.94	1,109,644,698	3.125	2019/5/15	2.89
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	8,100,000	13,254.29	1,073,598,012	13,147.25	1,064,927,798	3.500	2039/2/15	2.77
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	7,900,000	12,904.11	1,019,425,006	12,932.30	1,021,652,190	1.450	2022/9/15	2.66
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	6,830,000	12,157.46	830,354,788	12,069.05	824,316,705	3.625	2020/2/15	2.14
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	6,020,000	13,018.36	783,705,669	13,069.43	786,779,930	2.000	2025/12/1	2.05
20	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	4,340,000	17,523.43	760,516,892	17,569.55	762,518,563	3.250	2045/5/25	1.98
21	アメリカ	国債証券	US T STRIP PRINC	11,970,000	5,808.16	695,237,213	5,793.65	693,500,252		2040/11/15	1.80
22	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	2,940,000	18,539.21	545,052,934	18,499.02	543,871,458	5.150	2044/10/31	1.42
23	カナダ	国債証券	CANADIAN GOVT	5,250,000	9,293.93	487,931,669	9,233.81	484,775,197	2.250	2025/6/1	1.26
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,690,000	18,107.67	487,096,510	17,958.67	483,088,457	4.750	2044/9/1	1.26
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	3,260,000	13,409.59	437,152,804	13,454.10	438,603,960	2.150	2021/12/15	1.14
26	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	2,500,000	15,970.88	399,272,033	16,031.34	400,783,654	5.850	2022/1/31	1.04
27	メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,694,000	11,583.57	312,061,597	12,364.81	333,108,189	5.550	2045/1/21	0.87
28	ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	1,870,000	17,846.40	333,727,764	17,650.29	330,060,528	2.500	2046/8/15	0.86
29	カナダ	国債証券	CANADA GOVT INFL INDEX	1,610,000	13,221.16	294,727,119	13,359.78	300,925,193	4.000	2031/12/1	0.78
30	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA GOVT	2,870,000	8,591.90	246,587,662	8,637.88	247,907,182	3.250	2025/4/21	0.65

(注1) 変動利付債券は平成28年5月末現在の利率です。

(注2) 平成28年5月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

b. 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.30

合計	95.30
----	-------

(参考) LM・グローバル株式マザーファンド

a. 上位30銘柄

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	情報技術	34,400	10,726.78	369,001,528	11,132.82	382,969,318	2.43
2	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・ サービス	12,900	13,769.87	177,631,359	14,859.30	191,685,016	1.22
3	アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財・サー ビス	12,800	13,110.88	167,819,382	14,335.66	183,496,535	1.16
4	アメリカ	株式	AVERY DENNISON CORP	素材	21,700	7,224.41	156,769,758	8,283.88	179,760,409	1.14
5	フィンランド	株式	NESTE OYJ	エネルギー	47,886	3,574.72	171,179,113	3,721.86	178,225,227	1.13
6	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	金融	100,700	1,478.95	148,930,549	1,650.78	166,234,271	1.06
7	アメリカ	株式	ELECTRONIC ARTS INC	情報技術	17,400	7,126.78	124,006,069	8,398.15	146,127,949	0.93
8	カナダ	株式	ROYAL BANK OF CANADA	金融	21,300	5,873.71	125,110,082	6,836.36	145,614,587	0.92
9	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア	9,600	13,212.95	126,844,358	14,865.96	142,713,216	0.91
10	アメリカ	株式	AMGEN INC	ヘルスケア	8,200	16,094.57	131,975,490	17,388.73	142,587,632	0.91
11	ジャージー	株式	SHIRE PLC	ヘルスケア	20,020	6,163.07	123,384,781	6,978.20	139,703,624	0.89
12	ドイツ	株式	HANNOVER RUECK SE	金融	11,225	11,715.83	131,510,276	12,376.37	138,924,818	0.88
13	カナダ	株式	METRO INC	生活必需品	36,500	3,677.12	134,215,230	3,774.92	137,784,784	0.87
14	アメリカ	株式	ALTRIA GROUP INC	生活必需品	19,400	6,830.57	132,513,171	7,095.72	137,657,015	0.87
15	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	情報技術	26,500	3,479.07	92,195,578	5,092.14	134,941,869	0.86
16	アメリカ	株式	LOWE'S COS INC	一般消費財・ サービス	14,800	7,491.77	110,878,317	8,914.02	131,927,629	0.84
17	アイルランド	株式	ICON PLC	ヘルスケア	16,900	7,894.49	133,416,887	7,643.76	129,179,645	0.82
18	アメリカ	株式	NORTHROP GRUMMAN CORP	資本財・サー ビス	5,400	21,324.88	115,154,389	23,787.75	128,453,876	0.82
19	アメリカ	株式	STEEL DYNAMICS INC	素材	46,800	2,017.99	94,442,335	2,734.67	127,982,603	0.81
20	フランス	株式	BNP PARIBAS	金融	20,251	5,316.95	107,673,555	6,217.12	125,902,938	0.80
21	オランダ	株式	KONINKLIJKE AHOLD NV	生活必需品	50,721	2,500.20	126,812,797	2,481.65	125,872,049	0.80
22	アメリカ	株式	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	生活必需品	12,000	10,154.33	121,852,058	10,223.12	122,677,452	0.78
23	アメリカ	株式	DOLLAR GENERAL CORP	一般消費財・ サービス	12,000	8,237.29	98,847,540	9,971.28	119,655,446	0.76
24	アメリカ	株式	SIRIUS XM HOLDINGS INC	一般消費財・ サービス	271,200	412.69	111,923,372	439.32	119,144,235	0.76
25	アメリカ	株式	PEPSICO INC	生活必需品	10,300	10,852.15	111,777,154	11,311.44	116,507,857	0.74

26	イスラエル	株式	BANK LEUMI LE-ISRAEL	金融	284,239	376.36	106,976,758	405.20	115,174,211	0.73
27	アメリカ	株式	CITRIX SYSTEMS INC	情報技術	12,100	7,837.91	94,838,723	9,485.37	114,772,977	0.73
28	アメリカ	株式	CENTENE CORP	ヘルスケア	16,737	6,199.32	103,758,140	6,854.98	114,731,844	0.73
29	アメリカ	株式	TYSON FOODS INC-CL A	生活必需品	15,500	7,183.36	111,342,158	7,218.86	111,892,420	0.71
30	アメリカ	株式	GENERAL DYNAMICS CORP	資本財・サー ビス	7,000	15,117.79	105,824,556	15,878.84	111,151,895	0.71

(注)平成28年5月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

b.種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	5.46
	素材	6.30
	資本財・サービス	10.64
	一般消費財・サービス	13.04
	生活必需品	11.31
	ヘルスケア	12.43
	金融	18.37
	情報技術	16.17
	電気通信サービス	1.91
	公益事業	1.91
合計		97.54

【投資不動産物件】

L M・グローバル・プラス(毎月分配型)

該当事項はありません。

(参考) L M・グローバル債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) L M・グローバル株式マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

L M・グローバル・プラス(毎月分配型)

該当事項はありません。

(参考) L M・グローバル債券マザーファンド

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

債券 先物 取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR 1609	買建	964	米ドル	115,732,183.57	12,839,328,444	115,785,442.32	12,845,236,970	33.42
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR 1609	売建	599	米ドル	77,587,272	8,607,531,955	77,692,174.87	8,619,169,880	22.42
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 20YR 1609	売建	259	米ドル	42,171,190.26	4,678,471,847	42,200,812.5	4,681,758,138	12.18
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ金 融先物取引所	BTP10YR 1606	買建	22	ユーロ	3,051,576.3	377,327,409	3,072,300	379,889,895	0.99
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ金 融先物取引所	EB 5YR 1606	買建	237	ユーロ	31,125,501.05	3,848,668,205	31,127,580	3,848,925,267	10.01
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ金 融先物取引所	EB 10YR 1606	売建	440	ユーロ	71,612,104	8,854,836,660	72,006,000	8,903,541,900	23.16
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ金 融先物取引所	EB 30YR 1606	買建	40	ユーロ	6,571,266	812,537,041	6,696,800	828,059,320	2.15
	オース トラリ ア	シドニー先物 取引所	AU 10YR 1606	買建	35	オースト ラリアド ル	4,542,066.55	362,547,751	4,660,217.1	371,978,528	0.96
	イギリ ス	ロンドン国際 金融先物オブ ション取引所	UK 10YR 1609	売建	73	英ポンド	8,951,889.26	1,456,472,383	8,961,480	1,458,032,796	3.79
債券オ ブショ ン取引	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ金 融先物取引所	RXN6 C 0624	売建	107	ユーロ	41,553.45	5,138,084	27,820	3,439,943	0.01

(注1) 評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

(注2) 評価額は、平成28年5月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(参考) LM・グローバル株式マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期間末	純資産総額(円)		基準価額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6特定期間末 (平成18年11月 8日)	240,358,417,781	249,984,437,679	10,748	11,208
第7特定期間末 (平成19年 5月 8日)	318,632,267,391	333,862,056,456	11,111	11,681
第8特定期間末 (平成19年11月 8日)	346,345,628,048	356,123,265,395	10,679	10,989
第9特定期間末 (平成20年 5月 8日)	300,486,293,661	308,437,394,899	9,568	9,818
第10特定期間末 (平成20年11月10日)	207,375,762,912	211,044,207,501	7,082	7,202
第11特定期間末 (平成21年 5月 8日)	195,133,794,264	203,990,077,700	6,882	7,192
第12特定期間末 (平成21年11月 9日)	190,690,132,596	197,163,252,862	6,875	7,105
第13特定期間末 (平成22年 5月10日)	170,534,959,508	175,864,406,871	6,598	6,798
第14特定期間末 (平成22年11月 8日)	149,489,380,098	153,404,011,319	6,372	6,532
第15特定期間末 (平成23年 5月 9日)	131,662,755,820	134,739,084,604	6,299	6,439
第16特定期間末 (平成23年11月 8日)	105,759,774,868	108,065,176,287	5,865	5,985
第17特定期間末 (平成24年 5月 8日)	94,212,717,820	96,179,541,898	6,063	6,183
第18特定期間末 (平成24年11月 8日)	83,120,655,618	84,853,636,129	6,099	6,219
第19特定期間末 (平成25年 5月 8日)	95,663,390,673	97,182,436,329	7,984	8,104
第20特定期間末 (平成25年11月 8日)	83,989,587,667	85,315,189,239	8,010	8,130
第21特定期間末 (平成26年 5月 8日)	76,553,478,098	77,673,991,945	8,720	8,840

第22特定期間末（平成26年11月10日）	71,585,396,342	72,548,687,076	9,597	9,717
第23特定期間末（平成27年 5月 8日）	63,814,736,868	64,628,312,828	9,959	10,079
第24特定期間末（平成27年11月 9日）	56,687,455,293	57,403,351,737	9,838	9,958
第25特定期間末（平成28年 5月 9日）	46,467,949,852	47,131,513,039	8,597	8,717
平成27年 5月末日	64,714,871,197		10,272	
6月末日	61,264,237,089		10,003	
7月末日	61,118,778,806		10,178	
8月末日	57,845,325,254		9,799	
9月末日	55,831,009,009		9,537	
10月末日	56,731,593,055		9,804	
11月末日	55,952,944,767		9,827	
12月末日	54,133,645,033		9,648	
平成28年 1月末日	51,975,958,017		9,329	
2月末日	48,981,559,255		8,873	
3月末日	49,952,528,474		9,146	
4月末日	47,972,825,099		8,870	
5月末日	47,759,559,579		8,899	

（注1）分配付純資産総額は、各特定期間末の純資産総額に、各特定期間中に支払われた分配金の総額を加算しております。

（注2）基準価額は1万口当たりの純資産額です。

【分配の推移】

期	期間	1万口当たりの分配金（円）
第6特定期間	平成18年 5月 9日～平成18年11月 8日	460
第7特定期間	平成18年11月 9日～平成19年 5月 8日	570
第8特定期間	平成19年 5月 9日～平成19年11月 8日	310
第9特定期間	平成19年11月 9日～平成20年 5月 8日	250
第10特定期間	平成20年 5月 9日～平成20年11月10日	120
第11特定期間	平成20年11月11日～平成21年 5月 8日	310
第12特定期間	平成21年 5月 9日～平成21年11月 9日	230
第13特定期間	平成21年11月10日～平成22年 5月10日	200
第14特定期間	平成22年 5月11日～平成22年11月 8日	160
第15特定期間	平成22年11月 9日～平成23年 5月 9日	140
第16特定期間	平成23年 5月10日～平成23年11月 8日	120
第17特定期間	平成23年11月 9日～平成24年 5月 8日	120
第18特定期間	平成24年 5月 9日～平成24年11月 8日	120
第19特定期間	平成24年11月 9日～平成25年 5月 8日	120
第20特定期間	平成25年 5月 9日～平成25年11月 8日	120
第21特定期間	平成25年11月 9日～平成26年 5月 8日	120
第22特定期間	平成26年 5月 9日～平成26年11月10日	120
第23特定期間	平成26年11月11日～平成27年 5月 8日	120
第24特定期間	平成27年 5月 9日～平成27年11月 9日	120
第25特定期間	平成27年11月10日～平成28年 5月 9日	120

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第6特定期間	平成18年 5月 9日～平成18年11月 8日	8.57
第7特定期間	平成18年11月 9日～平成19年 5月 8日	8.68
第8特定期間	平成19年 5月 9日～平成19年11月 8日	1.10
第9特定期間	平成19年11月 9日～平成20年 5月 8日	8.06

第10特定期間	平成20年 5月 9日～平成20年11月10日	24.73
第11特定期間	平成20年11月11日～平成21年 5月 8日	1.55
第12特定期間	平成21年 5月 9日～平成21年11月 9日	3.24
第13特定期間	平成21年11月10日～平成22年 5月10日	1.12
第14特定期間	平成22年 5月11日～平成22年11月 8日	1.00
第15特定期間	平成22年11月 9日～平成23年 5月 9日	1.05
第16特定期間	平成23年 5月10日～平成23年11月 8日	4.98
第17特定期間	平成23年11月 9日～平成24年 5月 8日	5.42
第18特定期間	平成24年 5月 9日～平成24年11月 8日	2.57
第19特定期間	平成24年11月 9日～平成25年 5月 8日	32.87
第20特定期間	平成25年 5月 9日～平成25年11月 8日	1.83
第21特定期間	平成25年11月 9日～平成26年 5月 8日	10.36
第22特定期間	平成26年 5月 9日～平成26年11月10日	11.43
第23特定期間	平成26年11月11日～平成27年 5月 8日	5.02
第24特定期間	平成27年 5月 9日～平成27年11月 9日	0.01
第25特定期間	平成27年11月10日～平成28年 5月 9日	11.39

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	設定口数（口）	解約口数（口）
第6特定期間	64,789,598,214	14,181,241,647
第7特定期間	80,339,070,811	17,186,558,594
第8特定期間	54,899,501,098	17,359,889,447
第9特定期間	12,414,782,001	22,684,436,074
第10特定期間	5,797,634,687	27,006,007,142
第11特定期間	1,853,557,139	11,145,611,830
第12特定期間	3,886,998,711	10,056,305,413
第13特定期間	1,534,068,210	20,462,118,847
第14特定期間	747,558,607	24,598,698,126
第15特定期間	626,102,248	26,208,348,225
第16特定期間	391,313,735	29,075,179,631
第17特定期間	335,029,826	25,267,895,244
第18特定期間	270,116,622	19,370,817,048
第19特定期間	375,116,602	16,855,620,382
第20特定期間	244,952,174	15,206,731,793
第21特定期間	309,909,865	17,374,704,347
第22特定期間	300,553,932	13,499,228,798
第23特定期間	422,664,785	10,936,538,412
第24特定期間	187,968,819	6,642,585,800
第25特定期間	142,254,596	3,711,304,178

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

< 参考情報 >

基準日:2016年5月31日

基準価額・純資産の推移(過去10年間)

2006年5月末～2016年5月末



基準価額・純資産総額

基準価額	純資産総額
8,899円	478億円

分配の推移

2016年1月	20円
2016年2月	20円
2016年3月	20円
2016年4月	20円
2016年5月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	5,700円

※1万口当たり、税引前

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

主要な資産の状況

※下記比率は各ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

■LM・グローバル・プラス(毎月分配型)

■資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
LM・グローバル債券マザーファンド受益証券	日本	67.01
LM・グローバル株式マザーファンド受益証券	日本	32.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.01
合計(純資産総額)		100.00

■LM・グローバル債券マザーファンド

■国・地域別構成

国・地域	比率(%)
アメリカ	37.99
イタリア	14.68
フランス	8.63
イギリス	8.02
その他	25.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	4.70
合計(純資産総額)	100.00

その他投資資産	比率(%)
先物等	-14.03

■主要投資銘柄

国	種類	銘柄名	利率(%)	償還日	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3.625	2044年2月15日	7.74
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4.250	2040年12月7日	7.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	4.500	2039年8月15日	6.67
アメリカ	国債証券	T-NOTE INFLATION INDEX	0.250	2025年1月15日	6.27
ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	0.800	2025年6月22日	5.92
ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	3.250	2025年7月25日	4.53
イタリア	国債証券	BUONI POLIENALI INFL	2.350	2019年9月15日	4.16
ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	0.500	2026年2月15日	4.12
メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	7.750	2042年11月13日	3.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	1.500	2018年12月31日	3.71

■LM・グローバル株式マザーファンド

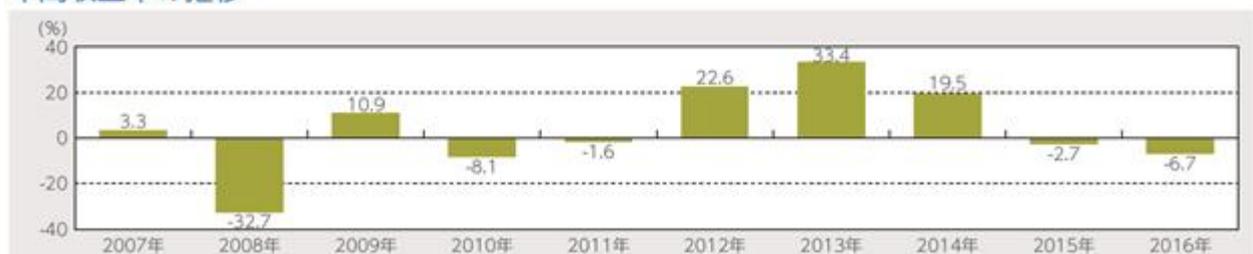
■国・地域別構成

国・地域	比率(%)
アメリカ	58.15
イギリス	6.04
カナダ	4.63
オランダ	3.15
フランス	2.84
スイス	2.16
スペイン	2.16
その他	18.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	2.46
合計(純資産総額)	100.00

■主要投資銘柄

国	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	情報技術	2.43
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス	1.22
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財・サービス	1.16
アメリカ	株式	AVERY DENNISON CORP	素材	1.14
フィンランド	株式	NESTE OYJ	エネルギー	1.13
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	金融	1.06
アメリカ	株式	ELECTRONIC ARTS INC	情報技術	0.93
カナダ	株式	ROYAL BANK OF CANADA	金融	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア	0.91
アメリカ	株式	AMGEN INC	ヘルスケア	0.91

年間収益率の推移



※当ファンドにはベンチマークはありません。

※年間収益率は、税引前分配金を再投資(複利運用)したと仮定して、委託会社が暦年ベースで算出したものです。

※2016年は年初から基準日までの収益率を表示しています。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

ファンドの運用状況は、委託会社のホームページで確認することができます。

第3【ファンドの経理状況】

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

（更新・訂正後）

（1）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

（3）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年11月10日から平成28年 5月 9日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【LM・グローバル・プラス（毎月分配型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 平成27年11月 9日現在	当期 平成28年 5月 9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	81,583,338	58,357,441
親投資信託受益証券	56,683,261,499	46,438,172,971
未収入金	200,000,000	150,000,000
未収利息	117	-
流動資産合計	56,964,844,954	46,646,530,412
資産合計	56,964,844,954	46,646,530,412
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	115,245,111	108,107,012
未払解約金	97,340,929	17,595,425
未払受託者報酬	3,750,741	3,060,799
未払委託者報酬	60,547,681	49,410,028
未払利息	-	171
その他未払費用	505,199	407,125
流動負債合計	277,389,661	178,580,560
負債合計	277,389,661	178,580,560
純資産の部		
元本等		
元本	57,622,555,822	54,053,506,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	935,100,529	7,585,556,388
（分配準備積立金）	1,363,159,019	959,507,326
元本等合計	56,687,455,293	46,467,949,852
純資産合計	56,687,455,293	46,467,949,852
負債純資産合計	56,964,844,954	46,646,530,412

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自	平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自	平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
営業収益				
受取利息		6,443		6,849
有価証券売買等損益		462,655,518		5,895,088,528
営業収益合計		462,661,961		5,895,081,679
営業費用				
支払利息		-		3,503
受託者報酬		22,929,397		19,273,749
委託者報酬		370,145,900		311,133,240
その他費用		2,819,493		2,237,193
営業費用合計		395,894,790		332,647,685
営業利益又は営業損失()		66,767,171		6,227,729,364
経常利益又は経常損失()		66,767,171		6,227,729,364
当期純利益又は当期純損失()		66,767,171		6,227,729,364
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		36,633,403		20,611,640
期首剰余金又は期首欠損金()		262,435,935		935,100,529
剰余金増加額又は欠損金減少額		67,535,544		231,112,640
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		66,251,501		231,112,640
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,284,043		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		54,437,462		10,887,588
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		53,385,130		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,052,332		10,887,588
分配金		715,896,444		663,563,187
期末剰余金又は期末欠損金()		935,100,529		7,585,556,388

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 平成27年11月 8日が休日のため、前特定期間末日は平成27年11月 9日としております。また、平成28年 5月 8日が休日のため、当特定期間末日は平成28年 5月 9日としております。このため、当特定期間は182日となっております。

(未適用の会計基準等に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

前期 平成27年11月 9日現在	当期 平成28年 5月 9日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 57,622,555,822口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 54,053,506,240口
2. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 935,100,529円	2. 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 7,585,556,388円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額 0.9838円 (一万口当たり純資産額) (9,838円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 一口当たり純資産額 0.8597円 (一万口当たり純資産額) (8,597円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期 自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	当期 自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。
2. 分配金の計算過程	平成27年 5月 9日から 平成27年 6月 8日までの 計算期間	平成27年11月10日から 平成27年12月 8日までの 計算期間
費用控除後の配当等収益額	134,077,200円	96,302,553円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	13,187,541円	- 円
収益調整金額	3,565,373,030円	3,241,071,878円
分配準備積立金額	1,550,786,917円	1,338,676,476円
当ファンドの分配対象収益額	5,263,424,688円	4,676,050,907円
当ファンドの期末残存口数	62,359,897,102口	56,606,933,202口
1万口当たり収益分配対象額	844.03円	826.03円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	124,719,794円	113,213,866円

	平成27年 6月 9日から 平成27年 7月 8日まで の計算期間	平成27年12月 9日から 平成28年 1月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	63,968,271円	44,695,603円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	3,483,410,075円	3,205,877,677円
分配準備積立金額	1,535,963,895円	1,306,587,555円
当ファンドの分配対象収益額	5,083,342,241円	4,557,160,835円
当ファンドの期末残存口数	60,911,319,251口	55,981,665,772口
1万口当たり収益分配対象額	834.54円	814.03円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	121,822,638円	111,963,331円
	平成27年 7月 9日から 平成27年 8月10日まで の計算期間	平成28年 1月 9日から 平成28年 2月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	114,492,696円	37,098,846円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	3,418,316,059円	3,182,111,138円
分配準備積立金額	1,448,763,750円	1,229,396,063円
当ファンドの分配対象収益額	4,981,572,505円	4,448,606,047円
当ファンドの期末残存口数	59,751,097,099口	55,557,102,194口
1万口当たり収益分配対象額	833.71円	800.72円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	119,502,194円	111,114,204円
	平成27年 8月11日から 平成27年 9月 8日まで の計算期間	平成28年 2月 9日から 平成28年 3月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	69,464,567円	46,673,381円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	3,372,215,617円	3,154,704,911円
分配準備積立金額	1,422,317,170円	1,144,514,226円
当ファンドの分配対象収益額	4,863,997,354円	4,345,892,518円
当ファンドの期末残存口数	58,920,145,109口	55,066,410,244口
1万口当たり収益分配対象額	825.51円	789.21円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	117,840,290円	110,132,820円
	平成27年 9月 9日から 平成27年10月 8日まで の計算期間	平成28年 3月 9日から 平成28年 4月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	99,236,148円	54,624,931円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	3,341,879,299円	3,123,735,646円
分配準備積立金額	1,361,046,537円	1,069,715,732円
当ファンドの分配対象収益額	4,802,161,984円	4,248,076,309円

当ファンドの期末残存口数	58,383,208,871口	54,515,977,416口
1万口当たり収益分配対象額	822.52円	779.23円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	116,766,417円	109,031,954円
	平成27年10月 9日から 平成27年11月 9日まで の計算期間	平成28年 4月 9日から 平成28年 5月 9日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	152,756,763円	61,192,560円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	3,298,735,589円	3,097,527,142円
分配準備積立金額	1,325,647,367円	1,006,421,778円
当ファンドの分配対象収益額	4,777,139,719円	4,165,141,480円
当ファンドの期末残存口数	57,622,555,822口	54,053,506,240口
1万口当たり収益分配対象額	829.02円	770.54円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	115,245,111円	108,107,012円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	当期 自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	当期 自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左

2.時価の算定方法	親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
-----------	---	----

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

項目	前期	当期
	自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
期首元本額	64,077,172,803円	57,622,555,822円
期中追加設定元本額	187,968,819円	142,254,596円
期中解約元本額	6,642,585,800円	3,711,304,178円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	平成27年11月 9日現在	平成28年 5月 9日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,022,894,570	690,388,918
合計	1,022,894,570	690,388,918

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	総口数（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	日本円	LM・グローバル債券マザーファンド	13,903,781,938	31,558,804,242	
		LM・グローバル株式マザーファンド	6,216,573,524	14,879,368,729	
	小計	銘柄数：2 組入時価比率：99.9%	20,120,355,462	46,438,172,971 100.0%	
合計				46,438,172,971	

(注)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「LM・グローバル債券マザーファンド」受益証券及び「LM・グローバル株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次の通りであります。

1. 「LM・グローバル債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。また、LM・グローバル債券マザーファンドの計算期間はLM・グローバル・プラス（毎月分配型）の計算期間とは異なり、毎年3月2日から翌年3月1日までであります。

LM・グローバル債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年11月 9日現在	平成28年 5月 9日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,982,371,536	669,969,834
コール・ローン	226,318,717	336,347,990
国債証券	41,808,476,335	36,220,515,767
派生商品評価勘定	224,963,310	109,941,507
未収利息	294,178,533	291,510,327
前払費用	18,833,941	47,528,973
差入委託証拠金	800,812,351	439,747,113
流動資産合計	45,355,954,723	38,115,561,511
資産合計	45,355,954,723	38,115,561,511
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	190,719,437	132,055,839
未払解約金	241,054,500	28,941
未払利息	-	990
流動負債合計	431,773,937	132,085,770
負債合計	431,773,937	132,085,770
純資産の部		
元本等		
元本	18,164,745,322	16,734,630,795
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,759,435,464	21,248,844,946
元本等合計	44,924,180,786	37,983,475,741
純資産合計	44,924,180,786	37,983,475,741
負債純資産合計	45,355,954,723	38,115,561,511

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（未適用の会計基準等に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

平成27年11月 9日現在		平成28年 5月 9日現在	
1. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの受益権の総数	18,164,745,322口	1. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの受益権の総数	16,734,630,795口
2. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	2.4732円 (24,732円)	2. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	2.2698円 (22,698円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。 また、当ファンドは、有価証券等の価格変動リスクの回避を目的として債券先物取引を行っております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

金融商品の時価等に関する事項

項目	自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動等

項目	自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
開示対象ファンドの期首における当該ファンドの元本額	20,974,683,694円	18,164,745,322円
同期中における追加設定元本額	141,331,430円	125,712,746円
同期中における解約元本額	2,951,269,802円	1,555,827,273円
元本の内訳		
LM・世界債券ファンドVA（適格機関投資家専用）	2,453,741,580円	2,134,484,051円
LM・グローバル債券ファンドVA（適格機関投資家専用）	689,690,921円	513,173,199円
LM・グローバル・プラス（毎月分配型）	14,941,037,626円	13,903,781,938円
LM・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	80,275,195円	183,191,607円
計	18,164,745,322円	16,734,630,795円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成27年11月 9日現在	平成28年 5月 9日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,733,936,612	14,661,542
合計	1,733,936,612	14,661,542

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

債券関連

種類	平成27年11月 9日現在				平成28年 5月 9日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買建	8,052,121,415	-	8,063,430,281	11,308,866	13,386,209,265	-	13,484,269,955	98,060,690
売建	19,462,778,356	-	19,439,843,349	22,935,007	21,737,608,233	-	21,857,783,255	120,175,022
合計	27,514,899,771	-	27,503,273,630	34,243,873	35,123,817,498	-	35,342,053,210	22,114,332

(注) 時価の算定方法

外国先物取引について

- 1) 外国先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 2) 貸借対照表作成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。上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

次表の通りです。

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	T-NOTE INFLATION INDEX	21,630,000.00	21,825,090.08	
		UNITED MEXICAN STATES	2,694,000.00	3,036,191.88	
		UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,577,744.00	
		US T STRIP PRINC	11,970,000.00	6,269,036.13	
		US TREASURY BOND	8,100,000.00	9,666,843.75	
		US TREASURY BOND	16,940,000.00	23,263,384.37	
		US TREASURY BOND	22,210,000.00	26,972,136.27	
		US TREASURY NOTE	5,680,000.00	5,685,103.13	
		US TREASURY NOTE	11,650,000.00	11,701,423.79	
		US TREASURY NOTE	12,690,000.00	12,906,622.23	
		US TREASURY NOTE	9,435,000.00	10,063,385.71	
		US TREASURY NOTE	6,830,000.00	7,483,919.15	
米ドル小計			131,429,000.00	140,450,880.49 (15,091,447,108)	
カナダドル	国債証券	CANADA GOVT INFL INDEX	1,610,000.00	3,534,662.77	
		CANADIAN GOVT	5,250,000.00	5,699,715.00	
カナダドル小計			6,860,000.00	9,234,377.77 (766,453,354)	
メキシコペソ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	215,514,600.00	245,490,525.71	
メキシコペソ小計			215,514,600.00	245,490,525.71 (1,475,398,059)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM GOVT	17,740,000.00	18,350,788.20	
		BUNDES REPUBLIC DE	12,390,000.00	12,816,959.40	
		BUNDES REPUBLIC DE	1,870,000.00	2,688,349.40	
		BUONI POLIENNALI	3,260,000.00	3,531,427.60	
		BUONI POLIENNALI	7,900,000.00	8,206,204.00	
		BUONI POLIENNALI	6,020,000.00	6,292,886.60	
		BUONI POLIENNALI	7,240,000.00	10,407,500.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,690,000.00	3,818,724.00	
		BUONI POLIENNALI INFL	10,750,000.00	12,920,092.01	
		FRANCE O.A.T.	10,240,000.00	11,468,492.80	
		FRANCE O.A.T.	7,880,000.00	9,173,029.20	
		FRANCE O.A.T.	4,340,000.00	6,128,123.40	
		SPAIN GOVT	2,500,000.00	3,233,800.00	
		SPAIN GOVT	2,940,000.00	4,325,092.80	

ユーロ小計			97,760,000.00	113,361,469.41 (13,862,974,094)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY	1,250,000.00	1,306,350.00
		UK TREASURY	12,700,000.00	17,590,643.00
英ポンド小計			13,950,000.00	18,896,993.00 (2,926,577,305)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDEN GOVT	8,870,000.00	10,412,049.50
スウェーデンクローナ小計			8,870,000.00	10,412,049.50 (137,126,691)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVT	60,600,000.00	62,122,272.00
ポーランドズロチ小計			60,600,000.00	62,122,272.00 (1,715,195,929)
オーストラリアドル	国債証券	AUSTRALIA GOVT	2,870,000.00	3,100,116.60
オーストラリアドル小計			2,870,000.00	3,100,116.60 (245,343,227)
合計 (外貨建証券の邦貨換算額)				36,220,515,767 (36,220,515,767)

(注)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 12銘柄	100.0%	41.6%
カナダドル	国債証券 2銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	4.1%
ユーロ	国債証券 14銘柄	100.0%	38.3%
英ポンド	国債証券 2銘柄	100.0%	8.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	100.0%	4.7%
オーストラリアドル	国債証券 1銘柄	100.0%	0.7%

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

債券関連

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

2. 「LM・グローバル株式マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。また、LM・グローバル株式マザーファンドの計算期間はLM・グローバル・プラス（毎月分配型）の計算期間とは異なり、毎年3月2日から翌年3月1日までであります。

LM・グローバル株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成27年11月 9日現在	平成28年 5月 9日現在
資産の部		
流動資産		
預金	268,968,015	195,967,140
金銭信託	898,425	16,316
コール・ローン	347,539,877	292,611,036
株式	19,090,950,503	14,518,791,559
未収入金	361,307,408	-
未収配当金	13,917,241	23,894,016
未収利息	498	-
流動資産合計	20,083,581,967	15,031,280,067
資産合計	20,083,581,967	15,031,280,067
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,645,148	-
未払金	348,666,625	-
未払解約金	-	150,000,000
未払利息	-	861
流動負債合計	350,311,773	150,000,861
負債合計	350,311,773	150,000,861
純資産の部		
元本等		
元本	6,933,805,498	6,217,456,322
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,799,464,696	8,663,822,884
元本等合計	19,733,270,194	14,881,279,206
純資産合計	19,733,270,194	14,881,279,206
負債純資産合計	20,083,581,967	15,031,280,067

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価格）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
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 為替予約の評価は、原則として、わが国における貸借対照表作成日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 (1) 株式 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には入金時に計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（未適用の会計基準等に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

平成27年11月 9日現在		平成28年 5月 9日現在	
1. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの受益権の総数	6,933,805,498口	1. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの受益権の総数	6,217,456,322口
2. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	2.8460円 (28,460円)	2. 開示対象ファンドの期末における当該ファンドの 一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	2.3935円 (23,935円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、株価変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。また、当ファンドは、外貨建金銭債権債務の為替変動リスクの回避を目的として為替予約取引を行っております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、株価変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	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。

金融商品の時価等に関する事項

項目	自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	<p>株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

1 元本の移動等

項目	自 平成27年 5月 9日 至 平成27年11月 9日	自 平成27年11月10日 至 平成28年 5月 9日
開示対象ファンドの期首における当該ファンドの元本額	7,842,321,806円	6,933,805,498円
同期中における追加設定元本額	- 円	- 円
同期中における解約元本額	908,516,308円	716,349,176円
元本の内訳		
LM・グローバル株式ファンドVA（適格機関投資家専用）	886,579円	882,798円
LM・グローバル・プラス（毎月分配型）	6,932,918,919円	6,216,573,524円
計	6,933,805,498円	6,217,456,322円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成27年11月 9日現在	平成28年 5月 9日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	246,281,764	363,738,471
合計	246,281,764	363,738,471

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

種類	平成27年11月 9日現在				平成28年 5月 9日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
為替予約取引								
売建	122,800,685	-	124,445,833	1,645,148	-	-	-	-
米ドル	122,800,685	-	124,445,833	1,645,148	-	-	-	-
合計	122,800,685	-	124,445,833	1,645,148	-	-	-	-

(注) 時価の算定方法

為替予約取引について

1. 貸借対照表作成日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

貸借対照表作成日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 貸借対照表作成日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 貸借対照表作成日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2. 貸借対照表作成日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、貸借対照表作成日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

次表の通りです。

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	AETNA INC	5,600	112.82	631,792.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,300	41.43	799,599.00	
	ALASKA AIR GROUP INC	13,800	68.51	945,438.00	
	ALLSTATE CORP	9,000	67.10	603,900.00	
	ALPHABET INC-CL A	900	725.18	652,662.00	
	ALTRIA GROUP INC	19,400	62.93	1,220,842.00	
	AMDOCS LTD	7,400	57.41	424,834.00	
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	33,800	14.51	490,438.00	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,850	70.82	910,037.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	6,400	76.52	489,728.00	
	AMGEN INC	6,100	153.19	934,459.00	
	AMSURG CORP	12,600	76.65	965,790.00	
	ANTHEM INC	3,800	137.25	521,550.00	
	APPLE INC	34,400	92.72	3,189,568.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	11,200	59.53	666,736.00	
	ASPEN INSURANCE HOLDINGS LTD	17,800	46.64	830,192.00	
	ASPEN TECHNOLOGY INC	18,000	37.31	671,580.00	
	ASSURED GUARANTY LTD	15,800	26.20	413,960.00	
	AVERY DENNISON CORP	21,700	74.87	1,624,679.00	
	AVNET INC	17,100	39.40	673,740.00	
	BANK OF AMERICA CORP	67,700	14.11	955,247.00	
	BED BATH&BEYOND INC	6,700	45.26	303,242.00	
	BIG LOTS INC	13,600	45.61	620,296.00	
	BIOGEN INC	2,900	263.61	764,469.00	
	BOEING CO/THE	12,800	133.26	1,705,728.00	
	BRINKER INTERNATIONAL INC	16,600	45.48	754,968.00	
	BROCADE COMMUNICATIONS SYS	90,700	8.08	732,856.00	
	CAMPBELL SOUP CO	13,000	63.92	830,960.00	
	CARDINAL HEALTH INC	9,100	76.85	699,335.00	
	CDW CORP/DE	17,100	40.52	692,892.00	
	CENTENE CORP	16,737	59.76	1,000,203.12	
	CIGNA CORP	6,700	130.85	876,695.00	
	CISCO SYSTEMS INC	18,100	26.53	480,193.00	
	CITIGROUP INC	12,800	44.41	568,448.00	
CITRIX SYSTEMS INC	12,100	81.24	983,004.00		
COMCAST CORP-CLASS A	9,800	61.42	601,916.00		
COMPUTER SCIENCES CORP	5,800	33.54	194,532.00		

CORELOGIC INC	16,300	36.17	589,571.00
CSRA INC	5,800	25.81	149,698.00
CVS HEALTH CORPORATION	5,200	104.85	545,220.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	10,400	70.46	732,784.00
DELTA AIR LINES INC	19,000	42.04	798,760.00
DOLLAR GENERAL CORP	12,000	83.27	999,240.00
DOW CHEMICAL CO/THE	13,140	51.16	672,242.40
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,000	93.95	1,127,400.00
ELECTRONIC ARTS INC	17,400	63.94	1,112,556.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	9,900	73.13	723,987.00
EXXON MOBIL CORPORATION	7,500	88.51	663,825.00
FIRSTENERGY CORP	19,000	33.09	628,710.00
FLEXTRONICS INTL LTD	77,900	12.13	944,927.00
FOOT LOCKER INC	13,600	60.78	826,608.00
GENERAL DYNAMICS CORP	7,000	143.44	1,004,080.00
GENERAL ELECTRIC COMPANY	17,800	30.12	536,136.00
GENTEX CORP	22,100	16.08	355,368.00
GILEAD SCIENCES INC	8,600	84.68	728,248.00
HANOVER INSURANCE GROUP INC/	11,100	84.64	939,504.00
HOLLYFRONTIER CORP	9,000	29.88	268,920.00
HOME DEPOT INC	12,900	135.70	1,750,530.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,300	155.20	512,160.00
ICON PLC	16,900	64.30	1,086,670.00
INGRAM MICRO INC-CL A	14,600	34.30	500,780.00
INGREDION INC	5,100	117.54	599,454.00
INTEGRATED DEVICE TECH INC	24,800	20.28	502,944.00
INTEL CORP	27,200	30.04	817,088.00
INTERNATIONAL PAPER CO	21,100	42.10	888,310.00
JACK IN THE BOX INC	5,600	68.48	383,488.00
JOHNSON CONTROLS INC	13,100	40.79	534,349.00
JPMORGAN CHASE & CO	16,600	61.60	1,022,560.00
JUNIPER NETWORKS INC	21,400	22.67	485,138.00
KROGER CO	22,900	34.55	791,195.00
LAM RESEARCH CORP	5,700	74.94	427,158.00
LEAR CORP	6,800	115.02	782,136.00
LEIDOS HOLDINGS INC	14,000	49.21	688,940.00
LOWE'S COS INC	14,800	75.54	1,117,992.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,300	82.10	681,430.00
MARATHON PETROLEUM CORP	18,900	35.88	678,132.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,000	95.50	668,500.00
MCKESSON CORP	3,300	168.86	557,238.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,400	357.26	857,424.00
MGIC INVESTMENT CORP	91,000	6.69	608,790.00

MICROSOFT CORP	15,200	50.39	765,928.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	12,800	45.49	582,272.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,300	70.54	585,482.00	
NETAPP INC	6,700	23.15	155,105.00	
NEUSTAR INC-CLASS A	31,800	23.07	733,626.00	
NOBLE CORP PLC	76,900	10.13	778,997.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,400	214.10	1,156,140.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	35,200	16.83	592,416.00	
NVIDIA CORP	26,500	35.33	936,245.00	
OLD REPUBLIC INTL CORP	27,700	18.76	519,652.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	265.92	771,168.00	
OWENS CORNING	18,300	48.07	879,681.00	
PEPSICO INC	10,300	104.96	1,081,088.00	
PFIZER INC	21,600	33.58	725,328.00	
POPULAR INC	15,300	28.96	443,088.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10,800	76.05	821,340.00	
REPUBLIC SERVICES INC	8,700	47.96	417,252.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	271,200	3.93	1,065,816.00	
SONOCO PRODUCTS CO	7,800	46.89	365,742.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	22,700	41.73	947,271.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,100	46.22	651,702.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,800	111.30	868,140.00	
STEEL DYNAMICS INC	46,800	24.94	1,167,192.00	
TARGET CORP	8,300	78.74	653,542.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	11,500	50.27	578,105.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	15,300	57.20	875,160.00	
TIME WARNER INC	9,100	74.89	681,499.00	
TJX COMPANIES INC	11,100	76.61	850,371.00	
TYSON FOODS INC-CL A	15,500	67.25	1,042,375.00	
UNITED THERAPEUTICS CORP	5,400	108.16	584,064.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,600	132.04	1,267,584.00	
VALERO ENERGY CORP	14,000	55.36	775,040.00	
VERIFONE SYSTEMS INC	23,900	27.05	646,495.00	
VIACOM INC-CLASS B	4,200	41.32	173,544.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,800	79.43	698,984.00	
XEROX CORP	33,500	9.48	317,580.00	
米ドル小計	2,186,627		87,871,712.52 (9,441,815,510)	
カナダドル				
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,300	98.42	915,306.00	
EMERA INC	17,800	46.25	823,250.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,800	52.82	517,636.00	
METRO INC	36,500	42.70	1,558,550.00	
POWER CORP OF CANADA	31,400	28.73	902,122.00	

	PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	20,300	42.44	861,532.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	21,300	76.09	1,620,717.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,600	42.33	1,083,648.00	
カナダドル小計		172,000		8,282,761.00 (687,469,163)	
ユーロ	ALLIANZ SE-REG	5,703	139.68	796,646.36	
	ASSICURAZIONI GENERALI	16,763	12.93	216,745.59	
	AXA SA	20,218	20.43	413,053.74	
	BNP PARIBAS	20,251	44.26	896,410.51	
	DELHAIZE GROUP	4,867	90.77	441,777.59	
	ENAGAS SA	22,865	26.60	608,323.32	
	EURONEXT NV	17,723	37.06	656,814.38	
	GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	42,943	17.60	755,796.80	
	GAS NATURAL SDG SA	35,168	17.67	621,418.56	
	HANNOVER RUECK SE	11,225	100.70	1,130,458.52	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	50,721	18.97	962,177.37	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,189	162.59	681,110.45	
	NESTE OYJ	47,886	28.32	1,356,131.52	
	NN GROUP NV	20,959	29.33	614,727.47	
	PEUGEOT SA	24,728	13.40	331,478.84	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	32,217	22.33	719,566.69	
	SCOR SE	12,262	29.38	360,257.56	
	SOCIETE GENERALE SA	23,324	32.86	766,426.64	
	TECHNIP SA	11,245	47.44	533,519.02	
	UPM-KYMMENE OYJ	43,639	16.44	717,425.16	
ユーロ小計		468,896		13,580,266.09 (1,660,730,740)	
英ポンド	BELLWAY PLC	15,642	24.47	382,759.74	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	13,601	29.08	395,517.08	
	BOOKER GROUP PLC	192,974	1.63	314,933.56	
	BT GROUP PLC	110,202	4.43	488,745.87	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	159,838	3.77	602,589.26	
	EASYJET PLC	17,301	14.16	244,982.16	
	IMPERIAL BRANDS PLC	15,103	37.57	567,495.22	
	INCHCAPE PLC	36,528	6.80	248,390.40	
	INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	104,080	5.08	528,726.40	
	MAN GROUP PLC	430,677	1.30	560,310.77	
	PERSIMMON PLC	18,823	19.51	367,236.73	
	PETROFAC LTD	58,804	8.19	481,604.76	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,049	67.31	541,778.19	
	SHIRE PLC	20,020	40.09	802,601.80	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	44,383	6.17	273,843.11	

英ポンド小計		1,246,025		6,801,515.05 (1,053,350,635)
スイスフラン	ACTELION LTD-REG	2,554	153.40	391,783.60
	ADECCO SA-REG	5,668	60.80	344,614.40
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,805	470.00	848,350.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	48,332	14.55	703,230.60
	NESTLE SA-REG	3,608	71.00	256,168.00
	SWISS RE AG	4,465	85.70	382,650.50
スイスフラン小計		66,432		2,926,797.10 (323,206,203)
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	24,627	136.90	3,371,436.30
	ELECTROLUX AB-SER B	28,187	228.50	6,440,729.50
	INTRUM JUSTITIA AB	15,928	291.00	4,635,048.00
	SWEDISH MATCH AB	25,403	268.20	6,813,084.60
スウェーデンクローナ小計		94,145		21,260,298.40 (279,998,129)
ノルウェークローネ	NORSK HYDRO ASA	101,258	32.83	3,324,300.14
	SUBSEA 7 SA	35,450	75.30	2,669,385.00
	TELENOR ASA	38,587	133.40	5,147,505.80
ノルウェークローネ小計		175,295		11,141,190.94 (145,726,777)
デンマーククローネ	PANDORA A/S	5,687	840.50	4,779,923.50
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,000	437.30	5,247,600.00
デンマーククローネ小計		17,687		10,027,523.50 (164,852,486)
オーストラリアドル	AMCOR LIMITED	62,092	16.01	994,092.92
	BORAL LTD	127,733	6.65	849,424.45
	CALTEX AUSTRALIA LTD	24,879	33.60	835,934.40
	DOWNER EDI LTD	103,212	3.68	379,820.16
	MACQUARIE GROUP LTD	6,527	65.10	424,907.70
	QANTAS AIRWAYS LTD	240,640	3.32	798,924.80
オーストラリアドル小計		565,083		4,283,104.43 (338,964,884)
香港ドル	CK PROPERTY HOLDINGS	32,000	48.50	1,552,000.00
	KERRY PROPERTIES LTD	138,500	20.30	2,811,550.00
	PCCW LTD	1,197,000	5.26	6,296,220.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	68,000	82.35	5,599,800.00
香港ドル小計		1,435,500		16,259,570.00 (225,195,044)
イスラエルシェケル	BANK HAPOLIM BM	156,288	19.40	3,031,987.20
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	284,239	13.84	3,933,867.76
イスラエルシェケル小計		440,527		6,965,854.96 (197,481,988)

合計 (外貨建証券の邦貨換算額)	6,868,217		14,518,791,559 (14,518,791,559)
---------------------	-----------	--	------------------------------------

(注)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 116銘柄	100.0%	65.1%
カナダドル	株式 8銘柄	100.0%	4.7%
ユーロ	株式 20銘柄	100.0%	11.4%
英ポンド	株式 15銘柄	100.0%	7.3%
スイスフラン	株式 6銘柄	100.0%	2.2%
スウェーデンクローナ	株式 4銘柄	100.0%	1.9%
ノルウェークローネ	株式 3銘柄	100.0%	1.0%
デンマーククローネ	株式 2銘柄	100.0%	1.1%
オーストラリアドル	株式 6銘柄	100.0%	2.3%
香港ドル	株式 4銘柄	100.0%	1.6%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%	1.4%

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下は、平成28年 5月31日現在のファンドの状況であります。

【純資産額計算書】

LM・グローバル・プラス（毎月分配型）

資産総額	47,863,163,370円
負債総額	103,603,791円
純資産総額（ - ）	47,759,559,579円
発行済口数	53,668,044,015口
1万口当たり純資産額 （ / ×10,000）	8,899円

（参考）LM・グローバル債券マザーファンド

資産総額	38,506,004,344円
負債総額	70,763,585円
純資産総額（ - ）	38,435,240,759円
発行済口数	16,540,391,727口
1万口当たり純資産額 （ / ×10,000）	23,237円

（参考）LM・グローバル株式マザーファンド

資産総額	15,941,280,876円
負債総額	188,685,999円
純資産総額（ - ）	15,752,594,877円
発行済口数	6,197,491,460口
1万口当たり純資産額 （ / ×10,000）	25,418円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（訂正前）

(1)資本金の額（平成27年11月末現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

運用の意思決定機構

東京運用委員会が運用に関する委員会として月次ベースで開催されます。東京運用委員会は、運用部及び関連部署の代表で構成されており、議事録は社長に報告されるとともに取締役会にも報告されま

す。

（以下略）

（訂正後）

(1)資本金の額（平成28年5月末現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

（中略）

運用の意思決定機構

東京運用委員会が運用に関する委員会として月次ベースで開催されます。東京運用委員会は、運用本部及び関連部署の代表で構成されており、議事録は社長に報告されるとともに取締役会にも報告されま

す。

（以下略）

2【事業の内容及び営業の概況】

（訂正前）

（前略）

(2)平成27年11月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託（親投資信託を除きます。）は以下の通りです。

種 類	ファンド数	純資産総額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	64	1,642,228
合 計	64	1,642,228

（訂正後）

（前略）

(2)平成28年5月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託（親投資信託を除きます。）は以下の通りです。

種 類	ファンド数	純資産総額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	61	1,300,440
合 計	61	1,300,440

3【委託会社等の経理状況】

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

（更新・訂正後）

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に従って作成しております。
財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、PwCあらた監査法人による監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第17期事業年度 (平成27年3月31日)	第18期事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	2,594,047	991,120
前払費用	90,111	71,675
未収委託者報酬	729,271	566,300
未収運用受託報酬	1,359,621	1,404,563
その他未収収益	28,870	15,322
繰延税金資産	436,730	211,764
関係会社短期貸付金	-	250,000
未収還付法人税等	-	6,293
未収入金	-	857
未収利息	-	362
流動資産計	5,238,652	3,518,260
固定資産		
有形固定資産		
建物	223,431	200,137
器具備品	26,529	15,768
有形固定資産計	249,960	215,906
無形固定資産		
ソフトウェア	31,315	37,094
無形固定資産計	31,315	37,094
投資その他の資産		
投資有価証券	101,165	74,647
長期差入保証金	129,278	125,533
保険積立金	484,188	-
前払年金費用	13,511	35,258
投資その他の資産計	728,144	235,439
固定資産計	1,009,420	488,440
資産合計	6,248,073	4,006,700

(単位：千円)

	第17期事業年度 (平成27年3月31日)		第18期事業年度 (平成28年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		18,729		20,513
未払金		1,117,368		946,928
未払手数料		248,960		193,297
未払消費税等		325,370		133,222
その他未払金		543,038		620,408
未払費用	2	1,163,172	2	824,143
未払法人税等		346,913		-
前受金		52,711		53,125
流動負債計		2,698,895		1,844,711
固定負債				
退職給付引当金		86,880		63,361
役員退職慰労引当金		602,668		-
繰延税金負債		-		10,880
固定負債計		689,548		74,242
負債合計		3,388,444		1,918,953
純資産の部				
株主資本				
資本金		1,000,000		1,000,000
資本剰余金				
資本準備金		226,405		226,405
資本剰余金計		226,405		226,405
利益剰余金				
利益準備金		23,594		23,594
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		1,609,629		837,746
利益剰余金計		1,633,223		861,341
株主資本合計		2,859,629		2,087,746
純資産合計		2,859,629		2,087,746
負債純資産合計		6,248,073		4,006,700

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第17期事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	10,051,079	10,697,615
運用受託報酬	2,487,985	2,335,131
その他営業収益	329,360	250,608
営業収益計	12,868,425	13,283,355
営業費用		
支払手数料	3,786,684	3,788,445
広告宣伝費	68,911	79,452
公告費	665	665
調査費	5,008,827	5,225,403
調査費	143,484	176,822
委託調査費	4,863,881	5,047,039
函書費	1,462	1,541
委託計算費	231,551	240,948
営業雑経費	179,517	189,522
通信費	49,866	51,864
印刷費	117,501	125,556
協会費	11,595	11,561
諸会費	553	540
営業費用計	9,276,157	9,524,438
一般管理費		
給料	1,545,298	1,650,619
役員報酬	98,885	107,190
給料・手当	958,889	998,021
賞与	487,523	545,408
交際費	12,867	35,305
寄付金	120	-
旅費交通費	58,533	80,064
租税公課	17,192	25,618
不動産賃借料	248,605	251,590
退職給付費用	38,668	84,950
退職金	17,519	-
役員退職慰労引当金繰入額	57,314	13,248
固定資産減価償却費	49,536	47,514
業務委託費	171,205	171,426
諸経費	190,413	269,836
一般管理費計	2,407,275	2,630,175
営業利益	1,184,993	1,128,742

(単位：千円)

	第17期事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業外収益		
受取利息	456	424
受取配当金	1,279	13,829
為替差益	39,845	-
営業外収益計	41,581	14,254
営業外費用		
為替差損	-	14,538
投資有価証券売却損	-	9,647
営業外費用計	-	24,186
経常利益	1,226,574	1,118,810
特別損失		
固定資産除却損	557	188
特別損失計	557	188
税引前当期純利益	1,226,016	1,118,621
法人税、住民税及び事業税	496,356	214,657
法人税等調整額	202,573	235,846
法人税等合計	293,782	450,504
当期純利益	932,234	668,117

(3) 【株主資本等変動計算書】

第17期事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

第18期事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本						純資産 合計
	資本金	資本 剰余金	利益剰余金			株主資本 合計	
		資本 準備金	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	1,000,000	226,405	23,594	1,609,629	1,633,223	2,859,629	2,859,629
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	1,440,000	1,440,000	1,440,000	1,440,000
当期純利益	-	-	-	668,117	668,117	668,117	668,117
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	771,882	771,882	771,882	771,882
当期末残高	1,000,000	226,405	23,594	837,746	861,341	2,087,746	2,087,746

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	(1) 其他有価証券 時価のあるもの 期末日の市場価額等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの 移動平均法による原価法
------------------------	--

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

未適用の会計基準等

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

1. 概要

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

- （分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い
- （分類2）および（分類3）に係る分類の要件
- （分類2）に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い
- （分類3）に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い
- （分類4）に係る分類の要件を満たす企業が（分類2）又は（分類3）に該当する場合の取扱い

2. 適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

3. 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

第17期事業年度 (平成27年3月31日)	第18期事業年度 (平成28年3月31日)
--------------------------	--------------------------

1 固定資産の減価償却累計額 建物 165,429千円 器具備品 191,043千円	1 固定資産の減価償却累計額 建物 188,723千円 器具備品 192,301千円
2 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。 未払費用 4,197千円	2 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。 未払費用 5,668千円

(損益計算書関係)

第17期事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1 関係会社との取引 諸経費 65,393千円	1 関係会社との取引 諸経費 151,169千円

(株主資本等変動計算書関係)

第17期事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	78,270	-	-	78,270

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成26年6月26日 定時株主総会	普通株式	400,000	5,110.5	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年6月12日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	840,000	10,732.0	平成27年 3月31日	平成27年 6月15日

第18期事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	78,270	-	-	78,270

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成27年6月12日 定時株主総会	普通株式	840,000	10,732.0	平成27年 3月31日	平成27年 6月15日
平成27年10月29日 取締役会	普通株式	600,000	7,665.7	平成27年 9月30日	平成27年 11月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの次の通り決議する予定であります。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	250,000	3,194.0	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

(リース取引関係)

第17期事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
オペレーティング・リース取引 (借主側) オペレーティング・リース取引のうち解約 不能のものに係る未経過リース料 1年以内 226,176千円 1年超 876,232千円 合計 1,102,409千円	オペレーティング・リース取引 (借主側) オペレーティング・リース取引のうち解約 不能のものに係る未経過リース料 1年以内 203,052千円 1年超 548,500千円 合計 751,553千円

(金融商品関係)

第17期事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

資金運用については、安全性の高い金融資産で運用し、デリバティブ取引は行っておらず、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されております。

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

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

預金の一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成27年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません。

((注) 2. 参照)

(単位:千円)

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

(注) 1. 金融資産の時価の算定方法に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬

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

(4) 投資有価証券

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

負債

(1) その他未払金、(2) 未払手数料、(3) 未払費用

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

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	9,285

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

(注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内
現金及び預金	2,594,047	-
未収委託者報酬	729,271	-
未収運用受託報酬	1,359,621	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	1,400	85,480
合計	4,684,341	85,480

第18期事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

資金運用については、安全性の高い金融資産で運用し、デリバティブ取引は行っておらず、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されております。

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

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

預金の一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません。

（（注） 2. 参照）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	991,120	991,120	-
(2) 未収委託者報酬	566,300	566,300	-
(3) 未収運用受託報酬	1,404,563	1,404,563	-
(4) 関係会社短期貸付金	250,000	250,000	-
(5) 投資有価証券	65,361	65,361	-
資産計	3,277,346	3,277,346	-
(1) その他未払金	620,408	620,408	-
(2) 未払手数料	193,297	193,297	-
(3) 未払費用	824,143	824,143	-
負債計	1,637,849	1,637,849	-

(注) 1. 金融資産の時価の算定方法に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(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) 投資有価証券

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

負債

(1) その他未払金、(2) 未払手数料、(3) 未払費用

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

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	9,285

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

(注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内
現金及び預金	991,120	-
未収委託者報酬	566,300	-
未収運用受託報酬	1,404,563	-
関係会社短期貸付金	250,000	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	52,815	10,546
合計	3,264,799	10,546

(有価証券関係)

第17期事業年度 (平成27年3月31日)	第18期事業年度 (平成28年3月31日)
1. その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 金銭信託 貸借対照表計上額 86,880千円 取得原価 86,880千円 差額 - 投資信託受益証券 貸借対照表計上額 5,000千円 取得原価 5,000千円 差額 -	1. その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 金銭信託 貸借対照表計上額 63,361千円 取得原価 63,361千円 差額 - 投資信託受益証券 貸借対照表計上額 2,000千円 取得原価 2,000千円 差額 -
(注) 非上場株式(貸借対照表計上額9,285千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上記「その他有価証券」には含めておりません。	(注) 同 左 2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 投資信託受益証券 売却額 204,000千円 売却益の合計額 2,291千円 売却損の合計額 11,939千円

(退職給付関係)

第17期事業年度(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

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

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

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

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

(3) 退職給付に関連する損益

簡便法で計算した退職給付費用	38,668千円
----------------	----------

第18期事業年度(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

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

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

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	86,880千円
退職給付費用	84,950千円
退職給付の支払額	23,522千円
前払年金費用	21,747千円
制度への拠出金	106,694千円
退職給付引当金の期末残高	<u>63,361千円</u>

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

積立型制度の退職給付債務	699,504千円
年金資産	734,763千円
	<u>35,258千円</u>

非積立制度の退職給付債務	63,361千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	28,103千円
退職給付引当金	63,361千円
前払年金費用	35,258千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	28,103千円

(3) 退職給付に関連する損益

簡便法で計算した退職給付費用	84,950千円
----------------	----------

(ストック・オプション等関係)

第17期事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1. スtock・オプション等に係る当事業年度における費用計上額及び科目名 諸経費 65,393千円	1. スtock・オプション等に係る当事業年度における費用計上額及び科目名 諸経費 151,169千円
2. スtock・オプション等の内容 当社は、親会社であるレグ・メイソン・インクの株式報酬プランに基づき当社の役員等が受領する株式報酬にかかる費用を負担しておりますが、これらの費用については、「ストック・オプション等に関する会計基準」（企業会計基準第8号 平成17年12月27日）及び「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第11号 平成18年5月31日）に準じた方法により会計処理をしております。	2. スtock・オプション等の内容 同 左

(税効果会計関係)

第17期事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1. 繰延税金資産の発生 of 主な原因別内訳 千円	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別内訳 千円
繰延税金資産	繰延税金資産
未払金 161,370	未払金 168,312
役員退職慰労引当金 199,488	退職給付引当金 19,553
退職給付引当金 23,803	未払費用 114,449
未払費用 109,064	有価証券評価損 27,994
有価証券評価損 29,337	長期差入保証金 21,786
長期差入保証金 22,294	繰延税金資産小計 352,096
繰延税金資産小計 545,358	評価性引当額 140,332
評価性引当額 108,628	繰延税金資産合計 211,764
繰延税金資産合計 436,730	繰延税金負債
	前払年金費用 10,880
	繰延税金負債合計 10,880
	繰延税金資産の純額 200,883
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	(%)		(%)
法定実効税率	35.6	法定実効税率	33.1
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入され ない項目	3.5	交際費等永久に損金に算入され ない項目	3.7
住民税均等割	0.3	住民税均等割	0.2
評価性引当金	18.6	評価性引当金	2.8
税率変更による期末繰延税金資産 の減額修正	2.7	税率変更による期末繰延税金資産 及び繰延税金負債の修正	1.3
その他	0.4	その他	0.8
税効果会計適用後の法人税等の 負担率	<u>23.9</u>	税効果会計適用後の法人税等の 負担率	<u>40.3</u>
3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及 び繰延税金負債の金額の修正		3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及 び繰延税金負債の金額の修正	
「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引き下げ等が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の35.6%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.1%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.3%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額は33,513千円減少し、法人税等調整額が同額増加しております。		「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引き下げ等が行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の33.1%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.9%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額は15,371千円、繰延税金負債の金額は789千円それぞれ減少し、法人税等調整額が14,581千円増加しております。	

(資産除去債務関係)

第17期事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 当該資産除去債務の概要

当社は、本社オフィスの賃貸借契約において、建物所有者との間で貸室賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約上の義務に関して資産除去債務を認識しております。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

なお、当該賃貸借契約に関連する差入保証金が計上されているため、当該差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

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

第18期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. 当該資産除去債務の概要

当社は、本社オフィスの賃貸借契約において、建物所有者との間で賃室賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約上の義務に関して資産除去債務を認識しております。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を75ヶ月と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する差入保証金が計上されているため、当該差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首における資産除去債務認識額	66,938千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	-
その他増減額（は減少）	1,658千円
期末における資産除去債務認識額	68,597千円

（セグメント情報等関係）

[セグメント情報]

当社の報告セグメントは投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第17期事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

1. 製品およびサービスごとの情報

（単位：千円）

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第17期事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第17期事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごと負ののれん発生益に関する情報

第17期事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

第18期事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品およびサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業務	投資一任業務	その他	合計
外部顧客への営業収益	10,697,615	2,335,131	250,608	13,283,355

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	2,519,145
LM・オーストラリア債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,444,239

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18期事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第18期事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

報告セグメントごと負ののれん発生益に関する情報

第18期事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

第17期事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）財務諸表提出会社の親会社及び主要会社（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額	科目	期末残高
親会社	レグ・メイソン・ インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	百万米ドル 11	持株 会社	被所有 直接 100%	ストック・ オプション 費用の負担	諸経費 の支払 (注3)	千円 65,393	未払 費用	千円 4,197

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

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容 又は職業	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 13	金融業	-	サービス 契約 投資顧問 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 230	その他 未収 収益	千円 -
							委託調査費 の支払 (注1)	172,056	未払 費用	13,284
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー	米国 カリフォルニア州 バサディナ	米ドル 500	金融業	-	サービス 契約 投資顧問 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 32,252	その他 未収 収益	千円 2,712
							委託調査費 の支払 (注1)	239,437	未払 費用	25,853
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 1	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 1,775,110	未払 費用	千円 220,676
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント(株)	東京都 千代田区	億円 10	金融業	-	役員の兼任 投資顧問 契約 オフィスの賃借	委託調査費 の支払 (注1)	千円 24,280	未払 費用	千円 2,100
							-	-	長期 差入 保証金	125,397
							不動産賃借 料等の支払 (注3)	173,700	前払 費用	14,750
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティブイ・エム・リミターダ	ブラジル サンパウロ州 サンパウロ	百万ブラジル レアル 2	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 536,519	未払 費用	千円 33,069
同一の親会社を持つ会社	QSレグ・メイソン・グローバル・アセット・アロケーション・エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	-	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 2,289	未払 費用	千円 165
同一の親会社を持つ会社	レグ・メイソン・インベストメンツ・(ヨーロッパ)リミテッド	英国 ロンドン市	百万英ポンド 34	金融業	-	役員の兼任 サービス 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 4,461	-	-

同一の親会社を持つ会社	クリアブリッジ・インベストメンツ・エルエルシー	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク	-	金融業	-	サービス 契約 投資顧問 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 246,425	その他 未収 収益	千円 22,340
							委託調査費 の支払 (注1)	632,619	未払 費用	69,369
同一の親会社を持つ会社	QSバッテリー マーチ・ ファイナンシャル・ マネジメント・ インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 70,748	未払 費用	千円 5,579
同一の親会社を持つ会社	レグ・メイソン& カンパニー・ エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	サービス 業	-	サービス 契約	調査費・ 諸経費の 支払 (注3)	千円 76,269	前払 費用	千円 9,218
									未払 費用	4,849
同一の親会社を持つ会社	ブランディワイン・ グローバル・ インベストメント・ マネジメント・ エルエルシー	米国 ペンシルバニア州 フィラデルフィア	-	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 1,111,348	未払 費用	千円 612,713
同一の親会社を持つ会社	レグ・メイソン・ アセット・ マネジメント・ オーストラリア・ リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 47	金融業	-	役員の兼任	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 45,989	その他 未収 収益	千円 3,811
						サービス 契約 投資顧問 契約				
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・ アセット・ マネジメント・ カンパニー・ ピーティーイー・ リミテッド	シンガポール	百万SGドル 38	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 5,976	未払 費用	千円 160

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

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

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

レグ・メイソン・インク（ニューヨーク証券取引所に上場）

第18期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要会社（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又 は出資金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額	科目	期末残高
親会社	レッグ・メイソン・ インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	百万米ドル 10	持株 会社	被所有 直接 100%	資金の 貸付 ストック・ オプション 費用の負担	貸付金の 貸付	千円 250,000	関係会社 短期貸 付金	千円 250,000
							諸経費 の支払 (注3)	151,169	未払 費用	5,668

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

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又 は出資金	事業の 内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額	科目	期末残高
同一の親 会社を持 つ会社	ウェスタン・ アセット・ マネジメント・ カンパニー・ リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 13	金融業	-	サービス 契約 投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 134,706	未払 費用	千円 9,774
同一の親 会社を持 つ会社	ウェスタン・ アセット・ マネジメント・ カンパニー・	米国 カリフォルニア州 パサディナ	米ドル 500	金融業	-	サービス 契約 投資顧問 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 31,410	その他 未収 収益	千円 2,396
							委託調査費 の支払 (注1)	338,428	未払 費用	29,056
同一の親 会社を持 つ会社	ウェスタン・ アセット・ マネジメント・ カンパニー・ ピーティーワイ・ リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 1	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 1,784,098	未払 費用	千円 209,104
同一の親 会社を持 つ会社	ウェスタン・ アセット・ マネジメント(株)	東京都 千代田区	億円 10	金融業	-	役員の兼任 投資顧問 契約 オフィスの 賃借	委託調査費 の支払 (注1)	千円 20,675	未払 費用	千円 1,501
							長期差入 保証金の 返金	125,397	-	-
							不動産賃借 料等の支払 (注3)	49,021	-	-
同一の親 会社を持 つ会社	ウェスタン・ アセット・ マネジメント・ カンパニー・ ディーティーブイ エム・リミターダ	ブラジル サンパウロ州 サンパウロ	百万ブラジル レアル 2	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 317,511	未払 費用	千円 21,676
同一の親 会社を持 つ会社	QS インベスターズ ・エルエルシー	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク	-	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 56,191	未払 費用	千円 3,869

同一の親会社を持つ会社	クリアブリッジ・インベストメンツ・エルエルシー	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク	-	金融業	-	役員の兼任 サービス 契約 投資顧問 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 180,865	その他 未収 収益	千円 10,337
							委託調査費 の支払 (注1)	729,432	未払 費用	48,857
同一の親会社を持つ会社	レグ・メイソン&カンパニー・エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	サービス 業	-	サービス 契約	調査費・ 諸経費の 支払 (注3)	千円 85,720	前払 費用	千円 13,168
									未収 入金	801
									未払 費用	11,162
同一の親会社を持つ会社	ブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 ペンシルバニア州 フィラデルフィア	-	金融業	-	役員の兼任 投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 1,019,248	未払 費用	千円 307,158
同一の親会社を持つ会社	レグ・メイソン・アセット・マネジメント・オーストラリア・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 55	金融業	-	役員の兼任 サービス 契約 投資顧問 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 38,332	その他 未収 収益	千円 2,587
							委託調査費 の支払 (注1)	646,508	未払 費用	58,682

(取引条件及び取引条件の決定方針等)

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

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

レグ・メイソン・インク (ニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

第17期事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
--------------------------------------	--------------------------------------

1株当たり純資産額	36,535円44銭	1株当たり純資産額	26,673円65銭
1株当たり当期純利益金額	11,910円49銭	1株当たり当期純利益金額	8,536円06銭
(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下の通りであります。		(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下の通りであります。	
当期純利益	932,234千円	当期純利益	668,117千円
普通株式に帰属しない金額	-	普通株式に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益	932,234千円	普通株式に係る当期純利益	668,117千円
期中平均株式数	78千株	期中平均株式数	78千株
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

(重要な後発事象)

第17期事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第18期事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況 1 名称、資本金の額及び事業の内容につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

(1)受託会社

名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

資本金の額

平成28年3月末現在 324,279百万円

事業の内容

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

（参考）再信託受託会社の概要

名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

資本金の額

平成28年3月末現在 10,000百万円

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、兼営法に基づき信託業務を営んでいます。

(2)投資顧問会社

ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド

a. 資本金の額

平成28年3月末現在 13百万米国ドル（1,464百万円）（米国ドルの円貨換算は、便宜上、平成28年3月末現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米国ドル＝112.68円）によります。）

b. 事業の内容

英国において資産運用業務を営んでいます。

ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー

a. 資本金の額

平成28年3月末現在 500米国ドル（56千円）（米国ドルの円貨換算は、便宜上、平成28年3月末現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米国ドル＝112.68円）によります。）

b. 事業の内容

米国において資産運用業務を営んでいます。

(3)投資助言会社

名称

QSインベスターズ・エルエルシー

資本金の額

平成28年3月末現在、該当なし。

事業の内容

米国において資産運用業務を営んでいます。

(4)販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成28年3月末現在	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、兼営法に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	
株式会社広島銀行	54,573	
株式会社みなと銀行	27,484	
株式会社鹿児島銀行	18,130	
株式会社京葉銀行	49,759	
株式会社愛知銀行	18,000	
株式会社東北銀行	13,233	
株式会社栃木銀行	27,408	
株式会社山陰合同銀行	20,705	
株式会社京都銀行	42,103	
株式会社七十七銀行	24,658	
株式会社熊本銀行	33,847	
株式会社伊予銀行	20,948	
株式会社親和銀行	36,878	
株式会社東日本銀行	38,300	
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村証券株式会社	10,000	
株式会社S B I証券	47,937	
東海東京証券株式会社	6,000	
楽天証券株式会社	7,495	
高木証券株式会社	11,069	
いよぎん証券株式会社	3,000	
ごうぎん証券株式会社	3,000	
フィデリティ証券株式会社	7,658	
京都信用金庫*	12,624	信用金庫法に基づき金融業を営んでいます。

* 受益権の新規の募集の取扱いは行いません。

(注) 京都信用金庫の資本金の額は出資の総額を記載しております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月24日

レッジ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた監査法人

指定社員

業務執行社員

公認会計士 鶴田光夫

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているレッジ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第18期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、レッジ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（レッジ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社）が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成28年7月11日

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松村 洋季指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 宮田 八郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているLM・グローバル・プラス（毎月分配型）の平成27年11月10日から平成28年5月9日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、LM・グローバル・プラス（毎月分配型）の平成28年5月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社（レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社）が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。