

【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29年 8 月 3 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29年2月6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28年11月末現在）

（以下略）

（訂正後）

（前略）

委託会社等の概況（平成29年5月末現在）

（以下略）

2【投資方針】

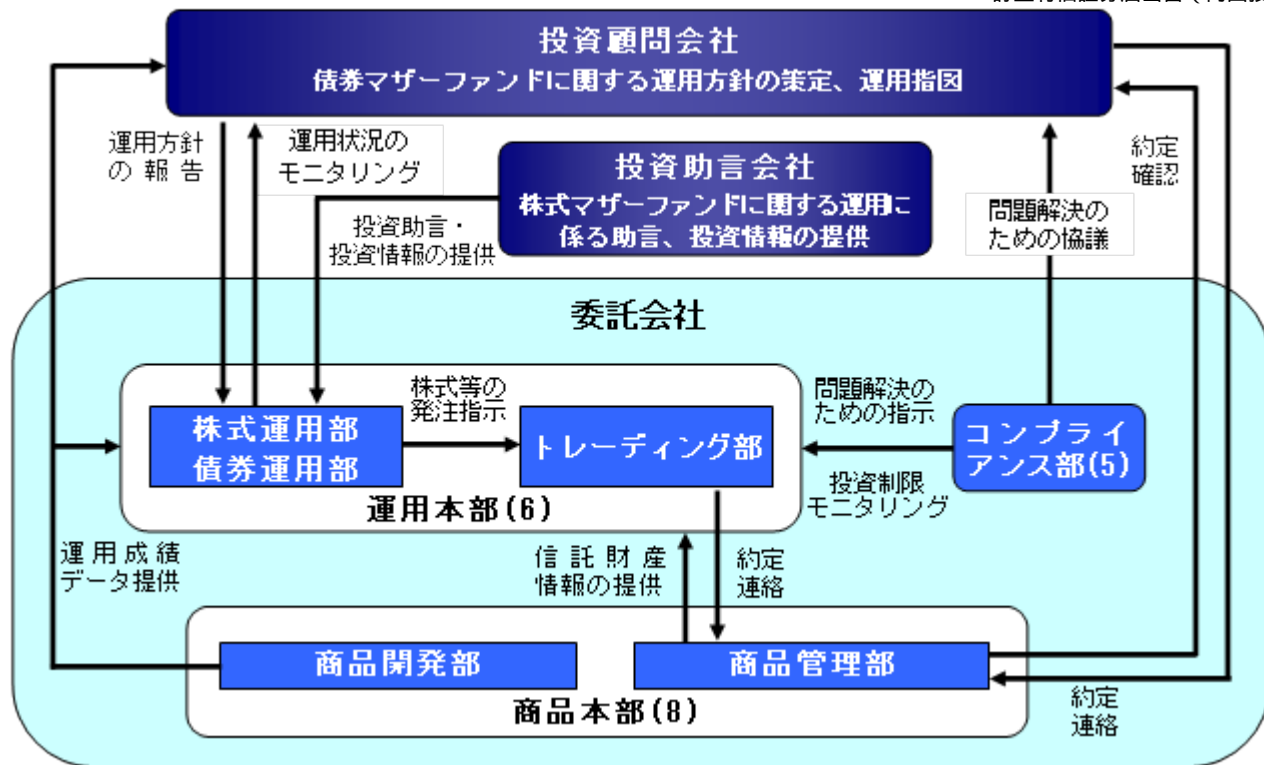
(3)【運用体制】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (3) 運用体制につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

（前略）

ファンドの運用体制



(注) 括弧内は平成29年5月末現在の各部署に属する人数を示します。

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）を投資顧問会社に指示します。

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。

委託会社の株式運用部は、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。

委託会社の債券運用部は、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。運用本部は、投資顧問会社に対して、必要に応じて投資環境の見通し、運用方針等についての情報提供を求めます。

委託会社のコンプライアンス部は、商品開発部で企画・立案されたファンドのガイドラインモニタリング方法に基づき、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かモニタリングを行います。また、投資制限の違反が生じた場合には、ビジネスリスク管理委員会に報告し、問題解決に向けた措置をとるよう投資顧問会社のコンプライアンス部門と協議及び社内に関連部署に指示します。

商品開発部は、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本部及び関連部署並びに必要なに応じて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、運用本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。

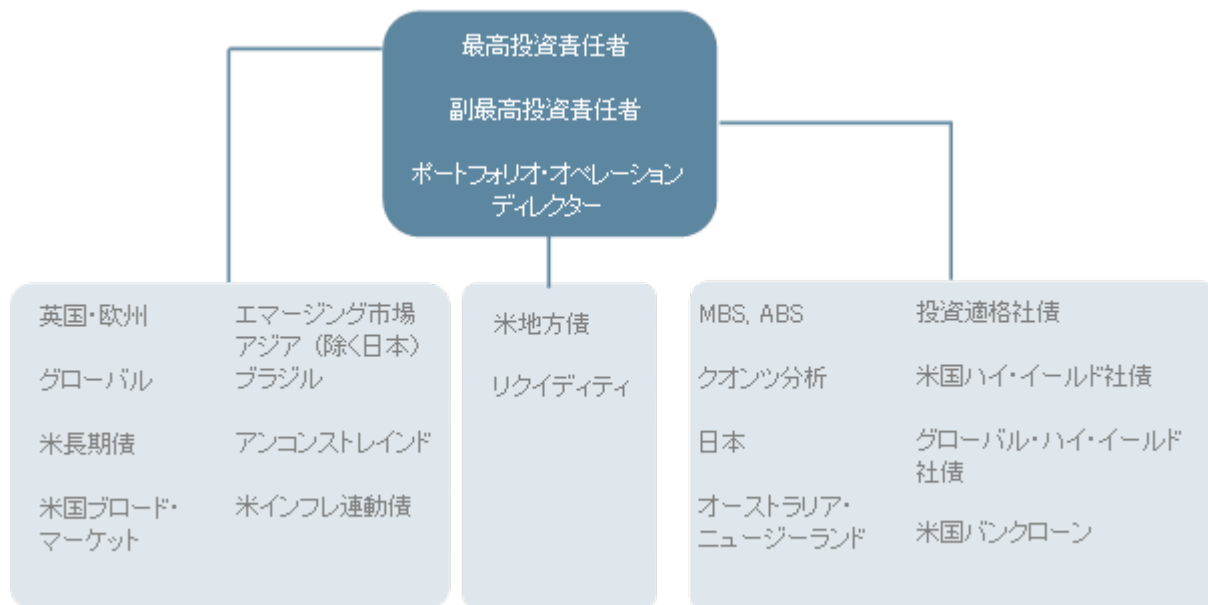
上記の業務については、「証券投資信託委託業務にかかる業務運営規程」及び部門毎に策定した「業務規程」にしたがって業務が遂行されます。

(参考) LM・グローバル債券マザーファンドの投資顧問会社の運用体制

運用体制

(中略)

ウエスタン・アセットのグループ全体の運用体制



上記は、ウエスタン・アセットのグループ全体の運用体制を示したものです。

（中略）

委託会社によるファンドの関係法人に対する管理体制

委託会社は、投資顧問会社へのファンドの運用指図に関する権限の委託及び投資助言会社から投資助言の提供を受けることが適切であるかどうかについてモニタリングを継続的に実施します。具体的には、社内規程に基づき、定期的に投資顧問会社及び投資助言会社の実績、組織、人材、法令等の遵守状況に関する調査を実施するとともに、必要のある場合には関係部署に対する投資顧問会社及び投資助言会社の業務遂行状況に関するヒアリングを行います。調査結果は、委託会社の商品会議に提出され、外部委託及び投資助言契約の継続について審議されます。

委託会社は、受託会社または再信託受託会社に対して、内部統制に関する外部監査人による報告書の提出を求めるほか、担当部署による委託会社独自の確認作業を実施し、受託会社等の業務状況についてモニタリングを行っています。

（注）ファンドの運用体制及び管理体制は、平成29年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(5) 【投資制限】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (5) 投資制限につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

（前略）

（参考）

L M・グローバル債券マザーファンド

(1) 投資方針

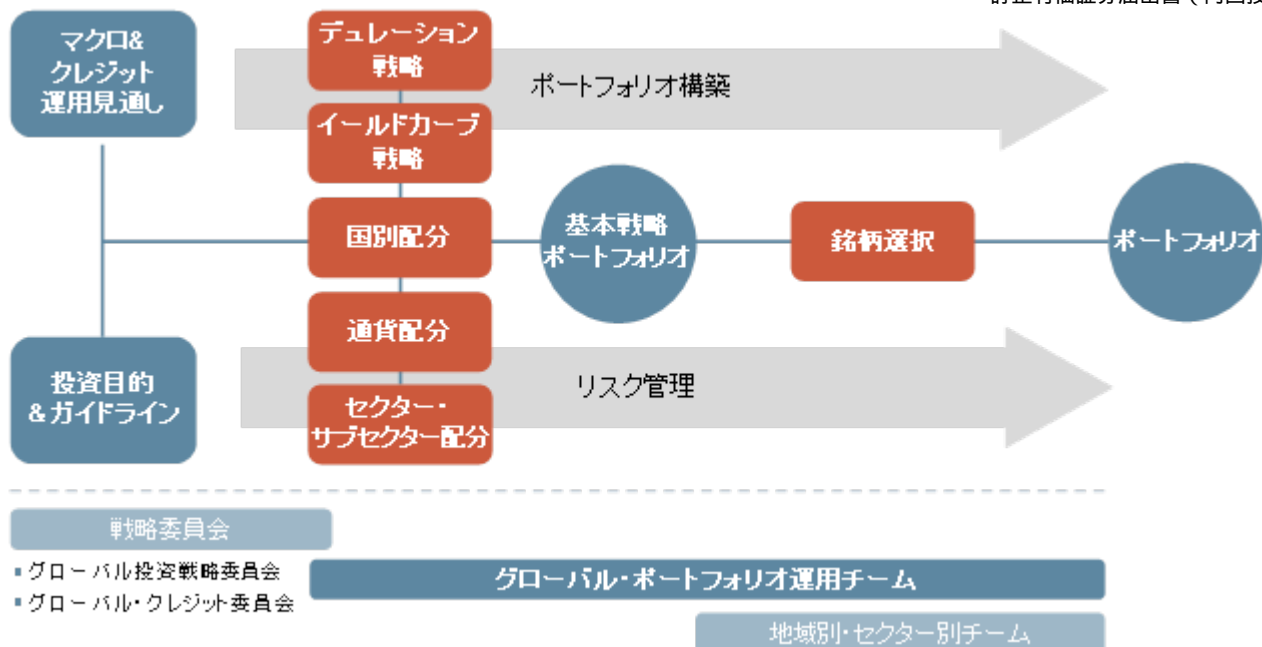
（中略）

運用方法

（中略）

< 投資顧問会社の運用プロセス >

長期的観点に基づくバリュエーション（債券価値）志向の投資を行うことを基本とし、複数の投資戦略に分散することで、信託財産の成長を目指します。



（注）運用プロセスは、今後、変更となる場合があります。

< ウェスタン・アセットの概要 >（平成29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）

L M・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29年5月末現在）

- レグ・メイソン・インクの100%子会社

- 米国ニューヨークとボストンを拠点として、世界中の幅広い投資家にソリューションを提供

- 米国株式、グローバル株式を対象とした投資戦略の他、マルチ・アセット戦略を提供

（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

委託会社では、運用部門から独立したコンプライアンス部門において、関係法令、当ファンドの信託約款及び運用ガイドライン等の遵守状況についてモニタリングを行います。

モニタリングの結果は必要に応じて関係部署及び社内には設置されたビジネスリスク管理委員会に報告が行われ、問題点の把握及び是正勧告等の監督が行われます。

（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 2012年6月～2017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)

(注) 上記は平成28年11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。

(訂正後)

(前略)

(注) 上記は平成29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29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	41,419,566,823	99.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		51,670,114	0.12
合計(純資産総額)		41,471,236,937	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	9,928,691,807	30.61
	カナダ	669,950,307	2.07
	メキシコ	1,804,120,833	5.56
	ドイツ	2,828,171,811	8.72
	イタリア	5,006,938,112	15.44
	フランス	2,149,092,263	6.63
	スペイン	920,285,144	2.84
	ベルギー	1,857,173,242	5.73
	イギリス	2,634,158,543	8.12
	スウェーデン	132,143,540	0.41
	ポーランド	943,804,371	2.91
	オーストラリア	523,825,104	1.61
	クウェート	182,556,718	0.56
	小計	29,580,911,795	91.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,852,218,337	8.79
合計(純資産総額)		32,433,130,132	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	11,915,460,908	36.73
	買建	ドイツ	2,942,027,620	9.07
	売建	アメリカ	5,915,837,635	18.24
	売建	ドイツ	9,758,589,697	30.08
	売建	イギリス	3,503,856,480	10.80

(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	8,429,094,930	60.42
	カナダ	539,772,562	3.87
	ドイツ	482,687,578	3.46
	イタリア	99,433,741	0.71
	フランス	184,842,878	1.33
	オランダ	184,172,684	1.32
	スペイン	722,470,636	5.18
	オーストリア	74,211,265	0.53
	ルクセンブルク	122,967,459	0.88
	フィンランド	251,524,334	1.80
	アイルランド	132,703,611	0.95
	イギリス	946,643,860	6.79
	スイス	296,741,332	2.13
	スウェーデン	144,927,236	1.04
	デンマーク	191,568,410	1.37
	オーストラリア	252,654,383	1.81
	バミューダ	209,163,214	1.50
ニュージーランド	76,947,643	0.55	
イスラエル	205,536,182	1.47	
	小計	13,548,063,938	97.11
投資証券	アメリカ	63,544,573	0.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		339,918,531	2.43
合計(純資産総額)		13,951,527,042	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	11,986,070,692	2.2942	27,498,443,382	2.2919	27,470,875,418	66.24
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	4,640,900,787	3.0461	14,136,647,888	3.0056	13,948,691,405	33.64

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	99.88
合計	99.88

（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 NOTE	26,300,000	11,064.77	2,910,034,531	11,161.44	2,935,461,110	1.875	2022/1/31	9.05

2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	22,210,000	12,479.53	2,771,704,168	12,695.81	2,819,741,142	3.625	2044/2/15	8.69
3	イギリス	国債証券	UK TREASURY	12,330,000	21,101.36	2,601,798,304	21,363.81	2,634,158,543	4.250	2040/12/7	8.12
4	ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	14,710,000	12,810.70	1,884,455,031	12,802.54	1,883,254,752	0.500	2026/2/15	5.81
5	ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	14,420,000	12,816.42	1,848,129,205	12,879.14	1,857,173,242	0.800	2025/6/22	5.73
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	11,940,000	14,119.66	1,685,887,404	14,347.64	1,713,109,192	4.500	2039/8/15	5.28
7	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	11,970,000	11,662.20	1,395,966,250	11,936.26	1,428,770,448	0.250	2026/11/25	4.41
8	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	215,514,600	583.33	1,257,170,152	602.45	1,298,372,923	7.750	2042/11/13	4.00
9	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	7,240,000	16,318.63	1,181,469,337	16,117.46	1,166,904,567	5.000	2040/9/1	3.60
10	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	8,470,000	13,020.69	1,102,853,256	12,999.87	1,101,089,497	2.500	2019/5/1	3.39
11	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	7,900,000	12,600.13	995,410,843	12,664.21	1,000,473,333	1.450	2022/9/15	3.08
12	ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	6,830,000	13,781.25	941,259,840	13,834.80	944,917,059	2.000	2022/1/4	2.91
13	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	34,020,000	2,751.37	936,016,856	2,774.26	943,804,371	2.500	2027/7/25	2.91
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	7,090,000	12,417.31	880,387,350	12,509.77	886,943,239	2.000	2025/12/1	2.73
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	6,830,000	11,783.43	804,808,400	11,751.35	802,617,717	3.625	2020/2/15	2.47
16	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	4,340,000	16,147.33	700,794,484	16,597.27	720,321,815	3.250	2045/5/25	2.22
17	アメリカ	国債証券	US T STRIP PRINC	11,970,000	5,455.24	652,993,250	5,622.12	672,967,917		2040/11/15	2.07
18	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	2,940,000	18,010.67	529,513,954	18,007.20	529,411,918	5.150	2044/10/31	1.63
19	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA GOVT	5,240,000	9,806.73	513,873,092	9,996.66	523,825,104	4.750	2027/4/21	1.61
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	3,260,000	13,114.90	427,545,792	13,174.76	429,497,484	2.150	2021/12/15	1.32
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,690,000	15,924.35	428,365,077	15,688.84	422,029,992	4.750	2044/9/1	1.30
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY NOTE	3,645,000	11,532.07	420,344,054	11,489.12	418,778,710	3.125	2019/5/15	1.29
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,990,000	10,046.21	400,843,955	10,232.15	408,263,147	2.500	2046/5/15	1.26
24	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	2,500,000	15,677.56	391,939,196	15,634.92	390,873,226	5.850	2022/1/31	1.21
25	カナダ	国債証券	CANADIAN GOVT	4,270,000	8,719.39	372,318,093	8,901.26	380,084,116	2.250	2025/6/1	1.17
26	メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,694,000	11,725.36	315,881,336	12,340.63	332,456,796	5.550	2045/1/21	1.03
27	カナダ	国債証券	CANADA GOVT INFL INDEX	1,610,000	12,543.86	283,782,682	12,666.82	289,866,191	4.000	2031/12/1	0.89
28	クウェート	国債証券	KUWAIT INTL BOND	1,600,000	10,987.92	175,806,799	11,409.79	182,556,718	3.500	2027/3/20	0.56
29	メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000	10,379.19	166,067,174	10,830.69	173,291,114	4.600	2046/1/23	0.53
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	1,390,000	11,231.52	156,118,196	11,349.12	157,752,872	3.000	2047/2/15	0.49

(注1) 変動利付債券は平成29年5月末現在の利率です。

(注2) 平成29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	91.21
合計	91.21

（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	26,200	15,200.41	398,250,753	17,051.22	446,742,048	3.20
2	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	情報技術	13,900	15,039.51	209,049,306	16,908.08	235,022,379	1.68
3	アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財・ サービス	9,800	19,998.32	195,983,544	20,736.20	203,214,807	1.46
4	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	金融	76,800	2,738.49	210,316,247	2,542.09	195,232,788	1.40
5	アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS INC	情報技術	36,200	4,018.97	145,486,757	5,055.33	183,003,221	1.31
6	イギリス	株式	3I GROUP PLC	金融	135,161	978.67	132,279,367	1,263.89	170,828,804	1.22
7	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・ サービス	9,900	16,079.21	159,184,215	17,074.52	169,037,796	1.21
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	情報技術	1,500	93,753.43	140,630,149	110,535.02	165,802,535	1.19
9	オーストラリア	株式	QANTAS AIRWAYS LTD	資本財・ サービス	397,020	310.87	123,423,592	412.84	163,906,530	1.17
10	アメリカ	株式	AGILENT TECHNOLOGIES INC	ヘルスケア	24,400	5,692.24	138,890,851	6,698.65	163,447,187	1.17
11	イギリス	株式	PERSIMMON PLC	一般消費財・ サービス	46,203	2,931.77	135,456,685	3,489.39	161,220,402	1.16
12	アメリカ	株式	CITIZENS FINANCIAL GROUP	金融	41,100	4,146.57	170,424,241	3,800.38	156,195,618	1.12
13	アメリカ	株式	BEST BUY CO INC	一般消費財・ サービス	23,700	4,896.66	116,050,956	6,577.70	155,891,699	1.12
14	フィンランド	株式	UPM-KYMMENE OYJ	素材	49,392	2,780.19	137,319,564	3,138.41	155,012,544	1.11
15	アメリカ	株式	NORTHROP GRUMMAN CORP	資本財・ サービス	5,400	27,417.10	148,052,375	28,429.06	153,516,933	1.10
16	アメリカ	株式	AMGEN INC	ヘルスケア	8,900	19,587.76	174,331,142	17,071.19	151,933,644	1.09
17	アメリカ	株式	LEAR CORP	一般消費財・ サービス	9,200	15,755.21	144,947,935	16,361.05	150,521,678	1.08
18	スイス	株式	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	情報技術	36,845	3,302.11	121,666,372	4,069.38	149,936,527	1.07
19	アメリカ	株式	CVS HEALTH CORPORATION	生活必需品	17,300	8,848.11	153,072,471	8,518.39	147,368,306	1.06
20	スイス	株式	SIKA AG-BR	素材	210	642,803.84	134,988,808	699,070.50	146,804,805	1.05
21	アメリカ	株式	SIRIUS XM HOLDINGS INC	一般消費財・ サービス	252,000	564.78	142,326,173	580.32	146,240,842	1.05
22	スウェーデン	株式	ELECTROLUX AB-SER B	一般消費財・ サービス	40,934	3,037.98	124,356,919	3,540.50	144,927,236	1.04
23	ドイツ	株式	BAYER AG-REG	ヘルスケア	10,042	12,892.03	129,461,860	14,423.81	144,843,935	1.04
24	スペイン	株式	ENDESA SA	公益事業	52,709	2,490.15	131,253,606	2,720.08	143,372,841	1.03
25	バミューダ	株式	KERRY PROPERTIES LTD	不動産	362,000	338.91	122,686,144	395.16	143,047,920	1.03
26	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア	7,300	18,350.56	133,959,123	19,594.42	143,039,313	1.03
27	イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	生活必需品	12,632	10,399.89	131,371,505	11,274.73	142,422,452	1.02
28	アメリカ	株式	STATE STREET CORP	金融	15,700	8,844.62	138,860,559	9,063.21	142,292,441	1.02

29	アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	生活必需品	16,400	7,870.39	129,074,442	8,671.52	142,212,994	1.02
30	アメリカ	株式	OWENS CORNING	資本財・ サービス	20,200	6,490.05	131,099,018	6,763.01	136,612,842	0.98

(注)平成29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	4.15
	素材	6.05
	資本財・サービス	9.42
	一般消費財・サービス	12.71
	生活必需品	11.88
	ヘルスケア	12.86
	金融	18.57
	情報技術	17.21
	電気通信サービス	1.51
	公益事業	1.72
	不動産	1.03
投資証券		0.46
合計		97.57

【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 1709	買建	908	米ドル	107,316,896.11	11,907,882,792	107,385,192.04	11,915,460,908	36.73
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR 1709	売建	142	米ドル	17,866,022.52	1,982,413,859	17,914,187.5	1,987,758,245	6.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 20YR 1709	売建	177	米ドル	27,134,491.86	3,010,843,217	27,136,312.5	3,011,045,235	9.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	USUL10Y R1709	売建	61	米ドル	8,204,125.34	910,329,747	8,264,547.18	917,034,155	2.83
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 5YR 1706	買建	135	ユーロ	17,845,872.75	2,211,995,927	17,841,600	2,211,466,320	6.82
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 10YR 1706	売建	485	ユーロ	77,991,229.75	9,667,012,927	78,730,050	9,758,589,697	30.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EB 30YR 1706	買建	35	ユーロ	5,861,157.75	726,490,503	5,894,000	730,561,300	2.25
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	UK 10YR 1709	売建	192	英ポンド	24,522,985.04	3,488,394,622	24,631,680	3,503,856,480	10.80

（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29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
第26特定期間末（平成28年11月8日）	41,977,042,332	42,604,081,414	8,237	8,357
第27特定期間末（平成29年5月8日）	42,297,535,577	42,877,690,593	9,024	9,144
平成28年5月末日	47,759,559,579		8,899	
6月末日	43,525,333,746		8,197	
7月末日	44,634,800,088		8,481	

8月末日	43,942,320,912		8,419
9月末日	42,331,437,026		8,204
10月末日	42,110,811,401		8,237
11月末日	43,823,012,265		8,677
12月末日	44,424,913,384		8,992
平成29年 1月末日	42,717,339,924		8,793
2月末日	42,313,440,216		8,783
3月末日	41,851,643,464		8,820
4月末日	41,580,100,920		8,859
5月末日	41,471,236,937		8,970

（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
第26特定期間	平成28年 5月10日～平成28年11月 8日	120
第27特定期間	平成28年11月 9日～平成29年 5月 8日	120

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
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
第26特定期間	平成28年 5月10日～平成28年11月 8日	2.79
第27特定期間	平成28年11月 9日～平成29年 5月 8日	11.01

（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
第26特定期間	111,270,156	3,201,167,985
第27特定期間	410,042,414	4,502,742,700

（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 >

基準価額・純資産の推移(過去10年間)

2007年5月末～2017年5月末



基準価額・純資産総額

基準価額	純資産総額
8,970円	415億円

分配の推移

2017年1月	20円
2017年2月	20円
2017年3月	20円
2017年4月	20円
2017年5月	20円
直近1年間累計	240円
設定来累計	5,940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	66.24
LM・グローバル株式マザーファンド受益証券	日本	33.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.12
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	30.61
イタリア	15.44
ドイツ	8.72
イギリス	8.12
その他	28.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	8.79
合計(純資産総額)	100.00

その他投資資産	比率(%)
先物等	-13.32

■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 NOTE	1.875	2022年1月31日	9.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3.625	2044年2月15日	8.69
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4.250	2040年12月7日	8.12
ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	0.500	2026年2月15日	5.81
ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	0.800	2025年6月22日	5.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	4.500	2039年8月15日	5.28
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	0.250	2026年11月25日	4.41
メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	7.750	2042年11月13日	4.00
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	5.000	2040年9月1日	3.60
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	2.500	2019年5月1日	3.39

■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	60.88
イギリス	6.79
スペイン	5.18
カナダ	3.87
ドイツ	3.46
スイス	2.13
オーストラリア	1.81
その他	13.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	2.43
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	3.20
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	情報技術	1.68
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財・サービス	1.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	金融	1.40
アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS INC	情報技術	1.31
イギリス	株式	3I GROUP PLC	金融	1.22
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス	1.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	情報技術	1.19
オーストラリア	株式	QANTAS AIRWAYS LTD	資本財・サービス	1.17
アメリカ	株式	AGILENT TECHNOLOGIES INC	ヘルスケア	1.17

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。

※2017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28年11月9日から平成29年5月8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28年11月 8日現在	当期 平成29年 5月 8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	54,643,883	175,937,537
親投資信託受益証券	41,901,448,625	42,284,510,135
未収入金	200,000,000	-
流動資産合計	42,156,092,508	42,460,447,672
資産合計		
	42,156,092,508	42,460,447,672
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	101,927,216	93,741,816
未払解約金	34,814,907	27,976,887
未払受託者報酬	2,446,412	2,381,665
未払委託者報酬	39,492,082	38,446,924
未払利息	115	456
その他未払費用	369,444	364,347
流動負債合計	179,050,176	162,912,095
負債合計		
	179,050,176	162,912,095
純資産の部		
元本等		
元本	50,963,608,411	46,870,908,125
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,986,566,079	4,573,372,548
（分配準備積立金）	636,952,325	388,072,931
元本等合計	41,977,042,332	42,297,535,577
純資産合計		
	41,977,042,332	42,297,535,577
負債純資産合計		
	42,156,092,508	42,460,447,672

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自	平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自	平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8日
営業収益				
受取利息		260		1,087
有価証券売買等損益		986,724,346		4,783,061,510
営業収益合計		986,724,086		4,783,062,597
営業費用				
支払利息		17,731		21,607
受託者報酬		16,690,886		16,038,467
委託者報酬		269,438,625		258,906,598
その他費用		2,292,353		2,280,934
営業費用合計		288,439,595		277,247,606
営業利益又は営業損失()		1,275,163,681		4,505,814,991
経常利益又は経常損失()		1,275,163,681		4,505,814,991
当期純利益又は当期純損失()		1,275,163,681		4,505,814,991
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()		7,129,573		30,607,425
期首剰余金又は期首欠損金()		7,585,556,388		8,986,566,079
剰余金増加額又は欠損金減少額		512,056,168		569,276,581
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		512,056,168		569,276,581
剰余金減少額又は欠損金増加額		17,992,669		51,135,600
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		17,992,669		51,135,600
分配金		627,039,082		580,155,016
期末剰余金又は期末欠損金()		8,986,566,079		4,573,372,548

(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28年11月 9日 至 平成29年 5月 8日
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。

(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28年11月 8日現在	当期 平成29年 5月 8日現在
1. 特定期間の末日における受益権の総数 50,963,608,411口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 46,870,908,125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 8,986,566,079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 4,573,372,548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 0.8237円 (一万口当たり純資産額) (8,237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 0.9024円 (一万口当たり純資産額) (9,024円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期 自 平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	当期 自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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28年 5月10日から 平成28年 6月 8日まで の計算期間	平成28年11月 9日から 平成28年12月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	101,746,231円	75,576,589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	3,066,749,371円	2,882,497,142円
分配準備積立金額	949,530,894円	628,080,853円
当ファンドの分配対象収益額	4,118,026,496円	3,586,154,584円
当ファンドの期末残存口数	53,510,222,009口	50,266,269,636口
1万口当たり収益分配対象額	769.56円	713.43円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	107,020,444円	100,532,539円
	平成28年 6月 9日から 平成28年 7月 8日まで の計算期間	平成28年12月 9日から 平成29年 1月10日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	31,886,720円	79,161,621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	3,035,378,158円	2,825,617,897円
分配準備積立金額	934,170,437円	590,968,629円
当ファンドの分配対象収益額	4,001,435,315円	3,495,748,147円
当ファンドの期末残存口数	52,956,871,373口	49,270,379,192口
1万口当たり収益分配対象額	755.59円	709.50円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	105,913,742円	98,540,758円
	平成28年 7月 9日から 平成28年 8月 8日まで の計算期間	平成29年 1月11日から 平成29年 2月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	69,199,807円	20,105,389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	3,010,349,308円	2,774,182,556円
分配準備積立金額	852,726,346円	560,630,789円
当ファンドの分配対象収益額	3,932,275,461円	3,354,918,734円
当ファンドの期末残存口数	52,515,620,695口	48,364,985,592口
1万口当たり収益分配対象額	748.77円	693.66円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	105,031,241円	96,729,971円
	平成28年 8月 9日から 平成28年 9月 8日まで の計算期間	平成29年 2月 9日から 平成29年 3月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	97,794,068円	77,163,455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	2,984,923,755円	2,755,923,496円
分配準備積立金額	809,557,948円	477,239,023円
当ファンドの分配対象収益額	3,892,275,771円	3,310,325,974円
当ファンドの期末残存口数	52,065,698,832口	47,988,185,450口
1万口当たり収益分配対象額	747.55円	689.81円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	104,131,397円	95,976,370円
	平成28年 9月 9日から 平成28年10月11日まで の計算期間	平成29年 3月 9日から 平成29年 4月10日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	36,860,991円	53,943,543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	2,953,287,480円	2,717,605,732円
分配準備積立金額	794,267,898円	451,803,609円
当ファンドの分配対象収益額	3,784,416,369円	3,223,352,884円
当ファンドの期末残存口数	51,507,521,204口	47,316,781,186口
1万口当たり収益分配対象額	734.73円	681.22円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	103,015,042円	94,633,562円

	平成28年10月12日から 平成28年11月 8日まで の計算期間	平成29年 4月11日から 平成29年 5月 8日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	18,657,677円	74,727,442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	2,922,314,322円	2,692,165,619円
分配準備積立金額	720,221,864円	407,087,305円
当ファンドの分配対象収益額	3,661,193,863円	3,173,980,366円
当ファンドの期末残存口数	50,963,608,411口	46,870,908,125口
1万口当たり収益分配対象額	718.39円	677.16円
1万口当たり分配金額	20.00円	20.00円
収益分配金金額	101,927,216円	93,741,816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	当期
	自 平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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、投資証券の価格変動リスク、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	当期
	自 平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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す。	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28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8日
期首元本額	54,053,506,240円	50,963,608,411円
期中追加設定元本額	111,270,156円	410,042,414円
期中解約元本額	3,201,167,985円	4,502,742,700円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	前期	当期
	平成28年11月 8日現在	平成29年 5月 8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	284,472,382	1,661,245,605
合計	284,472,382	1,661,245,605

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	12,181,911,178	27,947,740,624	
		LM・グローバル株式マザーファンド	4,706,598,441	14,336,769,511	
	小計	銘柄数：2 組入時価比率：100.0%	16,888,509,619	42,284,510,135 100.0%	
合計				42,284,510,135	

(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28年11月 8日現在	平成29年 5月 8日現在
資産の部		
流動資産		
預金	718,454,827	2,551,809,662
コール・ローン	286,301,227	179,589,287
国債証券	31,004,100,948	28,843,208,509
コール・オプション（買）	-	210,256
プット・オプション（買）	-	519,494
派生商品評価勘定	465,538,229	106,352,304
未収入金	-	2,615,832
未収利息	227,004,627	230,665,919
前払費用	7,986,840	27,151,390
差入委託証拠金	544,943,854	1,056,459,289
流動資産合計	33,254,330,552	32,998,581,942
資産合計	33,254,330,552	32,998,581,942
負債の部		
流動負債		
コール・オプション（売）	-	972,382
プット・オプション（売）	-	3,604,035
派生商品評価勘定	119,874,357	131,973,397
未払金	-	210,256
未払解約金	52,288,842	-
未払利息	603	466
流動負債合計	172,163,802	136,760,536
負債合計	172,163,802	136,760,536
純資産の部		
元本等		
元本	15,169,713,377	14,323,974,670
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,912,453,373	18,537,846,736
元本等合計	33,082,166,750	32,861,821,406
純資産合計	33,082,166,750	32,861,821,406
負債純資産合計	33,254,330,552	32,998,581,942

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28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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・オプション取引 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28年11月 8日現在		平成29年 5月 8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	15,169,713,377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	14,323,974,670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)	2.1808円 (21,808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)	2.2942円 (22,942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28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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。	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、債券先物オプション取引を行っております。債券先物取引、債券先物オプション取引は金利変動リスクを有しております。
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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>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。</p>	同左
----------------------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

項目	自 平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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>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。</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>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。</p> <p>派生商品評価勘定、コール・オプション（買）、コール・オプション（売）、プット・オプション（買）、プット・オプション（売） 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>

（その他の注記）

1 元本の移動等

項目	自 平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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	16,734,630,795円	15,169,713,377円
同期中における追加設定元本額	104,612,053円	611,870,475円
同期中における解約元本額	1,669,529,471円	1,457,609,182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）	1,896,503,876円	1,590,504,561円
LM・グローバル債券ファンドVA（適格機関投資家専用）	434,600,370円	378,146,406円
LM・グローバル・プラス（毎月分配型）	12,616,319,526円	12,181,911,178円
LM・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	222,289,605円	173,412,525円
計	15,169,713,377円	14,323,974,670円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成28年11月 8日現在	平成29年 5月 8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	99,059,869	5,791,291
合計	99,059,869	5,791,291

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28年11月 8日現在				平成29年 5月 8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	20,942,021,006	-	20,822,146,649	119,874,357	17,297,164,514	-	17,353,441,259	56,276,745
売建	22,662,524,448	-	22,196,986,219	465,538,229	20,280,494,816	-	20,362,392,654	81,897,838
債券先物オプション取引								
買建								
コール	-	-	-	-	3,742,556,800 (244,948)	-	210,256	34,692
プット	-	-	-	-	7,250,309,400 (1,039,654)	-	519,494	520,160
売建								
コール	-	-	-	-	1,317,254,160 (5,962,701)	-	972,382	4,990,319
プット	-	-	-	-	930,073,600 (2,606,240)	-	3,604,035	997,795

合計	43,604,545,454	-	43,019,132,868	345,663,872	50,817,853,290	-	37,721,140,080	22,183,421
----	----------------	---	----------------	-------------	----------------	---	----------------	------------

(注) 時価の算定方法

A 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。

B 外国オプション取引について

- 1) 外国オプション取引の残高表示は、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。
- 3) 契約額等のうち、()内はオプション料であります。

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	KUWAIT INTL BOND	1,600,000.00	1,628,544.00	
		UNITED MEXICAN STATES	2,694,000.00	2,954,159.58	
		UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,541,296.00	
		US T STRIP PRINC	11,970,000.00	5,870,447.10	
		US TREASURY BOND	11,940,000.00	15,146,076.62	
		US TREASURY BOND	22,210,000.00	24,894,286.82	
		US TREASURY BOND	3,990,000.00	3,599,883.97	
		US TREASURY BOND	1,390,000.00	1,393,257.81	
		US TREASURY NOTE	5,575,000.00	5,774,916.04	
		US TREASURY NOTE	6,830,000.00	7,229,394.90	
		US TREASURY NOTE	26,300,000.00	26,313,355.39	
米ドル小計			96,099,000.00	96,345,618.23 (10,862,004,999)	
カナダドル	国債証券	CANADA GOVT INFL INDEX	1,610,000.00	3,466,135.53	
		CANADIAN GOVT	4,270,000.00	4,568,686.50	
カナダドル小計			5,880,000.00	8,034,822.03 (663,033,513)	
メキシコペソ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	215,514,600.00	220,633,071.75	
メキシコペソ小計			215,514,600.00	220,633,071.75 (1,312,766,776)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM GOVT	14,420,000.00	14,776,895.00	
		BUNDES REPUBLIC DE	14,710,000.00	15,038,180.10	
		BUONI POLIENNALI	8,470,000.00	8,883,251.30	
		BUONI POLIENNALI	3,260,000.00	3,461,435.40	
		BUONI POLIENNALI	7,900,000.00	8,072,931.00	
		BUONI POLIENNALI	11,040,000.00	11,137,041.60	
		BUONI POLIENNALI	7,240,000.00	9,451,892.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,690,000.00	3,431,041.20	
		FRANCE O.A.T.	11,970,000.00	11,397,834.00	
		FRANCE O.A.T.	4,340,000.00	5,700,069.20	
		SPAIN GOVT	2,500,000.00	3,154,425.00	
		SPAIN GOVT	2,940,000.00	4,259,913.00	
		ユーロ小計			91,480,000.00
英ポンド	国債証券	UK TREASURY	12,330,000.00	18,104,508.90	

英債券小計			12,330,000.00	18,104,508.80 (2,645,068,750)	
スウェーデン コロナ	国債証券	SWEDEN GOVT	8,870,000.00	10,304,633.80	
スウェーデンコロナ小計			8,870,000.00	10,304,633.80 (131,899,312)	
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT	37,520,000.00	34,438,857.60	
ポーランドズロチ小計			37,520,000.00	34,438,857.60 (1,013,191,190)	
合計 (外貨建証券の邦貨換算額)				28,843,208,509 (28,843,208,509)	

(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 11銘柄	100.0%	37.6%
カナダドル	国債証券 2銘柄	100.0%	2.3%
メキシコペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	4.6%
ユーロ	国債証券 12銘柄	100.0%	42.3%
英ポンド	国債証券 1銘柄	100.0%	9.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	100.0%	3.5%

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28年11月 8日現在	平成29年 5月 8日現在
資産の部		
流動資産		
預金	166,054,838	197,682,437
金銭信託	136,624	998,419
コール・ローン	328,311,740	294,668,599
株式	13,795,382,967	13,775,310,988
投資証券	243,800,321	61,508,125
未収配当金	6,131,600	9,491,285
流動資産合計	14,539,818,090	14,339,659,853
資産合計	14,539,818,090	14,339,659,853
負債の部		
流動負債		
未払解約金	150,000,000	-
未払利息	692	764
流動負債合計	150,000,692	764
負債合計	150,000,692	764
純資産の部		
元本等		
元本	5,926,165,154	4,707,474,710
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,463,652,244	9,632,184,379
元本等合計	14,389,817,398	14,339,659,089
純資産合計	14,389,817,398	14,339,659,089
負債純資産合計	14,539,818,090	14,339,659,853

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28年11月 9日 至 平成29年 5月 8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式・投資証券 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. 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。 (2) 投資証券 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
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28年11月 8日現在		平成29年 5月 8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	5,926,165,154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	4,707,474,710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)	2.4282円 (24,282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)	3.0461円 (30,461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28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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、投資証券の価格変動リスク、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	自 平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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	株式、投資証券 （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
-----------	---	----

（その他の注記）

1 元本の移動等

項目	自 平成28年 5月10日 至 平成28年11月 8日	自 平成28年11月 9日 至 平成29年 5月 8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	6,217,456,322円	5,926,165,154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	291,291,168円	1,218,690,444円
元本の内訳		
L M・グローバル株式ファンドV A（適格機関投資家専用）	879,344円	876,269円
L M・グローバル・プラス（毎月分配型）	5,925,285,810円	4,706,598,441円
計	5,926,165,154円	4,707,474,710円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成28年11月 8日現在	平成29年 5月 8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	685,720,896	522,515,531
投資証券	27,777,026	4,779,612
合計	657,943,870	517,735,919

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。

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	7,300	140.77	1,027,621.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,400	56.64	1,382,016.00	
	ALASKA AIR GROUP INC	10,500	85.24	895,020.00	
	ALPHABET INC-CL A	1,500	950.28	1,425,420.00	
	ALTRIA GROUP INC	14,800	70.92	1,049,616.00	
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	56,000	14.20	795,200.00	
	AMGEN INC	8,900	163.81	1,457,909.00	
	ANTHEM INC	3,200	180.30	576,960.00	
	APACHE CORP	22,000	49.29	1,084,380.00	
	APPLE INC	26,200	148.96	3,902,752.00	
	APPLIED MATERIALS INC	36,200	41.83	1,514,246.00	
	AVERY DENNISON CORP	7,000	84.17	589,190.00	
	BANK OF AMERICA CORP	76,800	23.74	1,823,232.00	
	BARRICK GOLD CO	44,200	16.15	713,830.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	20,000	55.95	1,119,000.00	
	BEST BUY CO INC	23,700	51.62	1,223,394.00	
	BIG LOTS INC	19,400	49.62	962,628.00	
	BIOGEN INC	3,100	262.15	812,665.00	
	BOEING CO/THE	9,800	185.01	1,813,098.00	
	CAMPBELL SOUP CO	9,900	57.40	568,260.00	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	18,200	65.20	1,186,640.00	
	CDW CORP/DE	13,100	58.76	769,756.00	
	CISCO SYSTEMS INC	31,800	34.39	1,093,602.00	
	CITIGROUP INC	13,700	60.24	825,288.00	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	41,100	36.97	1,519,467.00	
	CITRIX SYSTEMS INC	11,800	87.48	1,032,264.00	

CNO FINANCIAL GROUP INC	31,700	21.17	671,089.00
CORELOGIC INC	12,300	42.85	527,055.00
CVS HEALTH CORPORATION	17,300	81.06	1,402,338.00
DELTA AIR LINES INC	14,500	48.70	706,150.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	9,200	91.21	839,132.00
EBAY INC	17,400	33.50	582,900.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,400	246.42	591,408.00
EXELON CORP	24,300	34.34	834,462.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	15,100	61.58	929,858.00
EXXON MOBIL CORPORATION	5,700	82.02	467,514.00
F5 NETWORKS INC	6,600	128.57	848,562.00
FACEBOOK INC-A	13,900	150.24	2,088,336.00
FOOT LOCKER INC	10,300	76.76	790,628.00
GILEAD SCIENCES INC	6,700	67.80	454,260.00
HANOVER INSURANCE GROUP INC/	11,200	86.47	968,464.00
HOME DEPOT INC	9,900	155.73	1,541,727.00
ICON PLC	12,900	85.96	1,108,884.00
INGREDION INC	7,900	120.61	952,819.00
INVESTORS BANCORP INC	48,600	13.45	653,670.00
JM SMUCKER CO/THE	7,700	126.08	970,816.00
JOHNSON & JOHNSON	9,000	123.51	1,111,590.00
LEAR CORP	9,200	140.84	1,295,728.00
LOWE'S COS INC	11,400	86.00	980,400.00
MARATHON OIL CORP	71,600	14.29	1,023,164.00
MERCK & CO. INC.	15,500	63.97	991,535.00
MGIC INVESTMENT CORP	111,600	10.50	1,171,800.00
MICROSOFT CORP	11,600	69.00	800,400.00
MORGAN STANLEY	13,700	43.08	590,196.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,600	84.44	979,504.00
NEUSTAR INC-CLASS A	24,300	33.15	805,545.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,400	248.91	1,344,114.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	59,200	18.09	1,070,928.00
NUCOR CORP	12,200	60.47	737,734.00
OWENS CORNING	20,200	62.27	1,257,854.00
PEPSICO INC	7,800	113.22	883,116.00
PFIZER INC	16,500	33.48	552,420.00
QUALCOMM INC	14,000	54.93	769,020.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	252,000	4.89	1,232,280.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	17,300	58.40	1,010,320.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,600	138.61	1,053,436.00
STATE STREET CORP	15,700	83.60	1,312,520.00
STEEL DYNAMICS INC	35,700	35.82	1,278,774.00
TARGET CORP	12,300	57.32	705,036.00

	TERADYNE INC	23,400	35.60	833,040.00	
	TIME WARNER INC	6,900	98.37	678,753.00	
	TORO CO	14,500	66.67	966,715.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	11,900	63.33	753,627.00	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	4,100	122.84	503,644.00	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	7,300	174.12	1,271,076.00	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	6,800	85.89	584,052.00	
	WAL-MART STORES INC	16,400	76.50	1,254,600.00	
	WELLCARE HEALTH PLANS INC	6,200	170.86	1,059,332.00	
	XEROX CORP	133,400	7.07	943,138.00	
米ドル小計		1,836,500		80,898,917.00	(9,120,543,903)
カナダドル	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,800	108.67	1,608,316.00	
	METRO INC	27,800	46.41	1,290,198.00	
	SAPUTO INC	27,400	45.06	1,234,644.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	34,700	48.82	1,694,054.00	
カナダドル小計		104,700		5,827,212.00	(480,861,534)
ユーロ	ALLIANZ SE-REG	4,347	174.60	758,994.89	
	ASSICURAZIONI GENERALI	57,796	15.25	881,389.00	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	120,287	7.80	938,238.60	
	BAYER AG-REG	10,042	115.43	1,159,238.43	
	BNP PARIBAS	15,438	67.88	1,047,931.44	
	CAIXABANK S.A	243,564	4.42	1,078,744.95	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	60,671	16.62	1,008,534.03	
	ENDESA SA	52,709	22.59	1,190,959.85	
	EURONEXT NV	13,512	48.99	662,020.44	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	92,671	10.28	952,657.88	
	GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	32,737	20.57	673,400.09	
	HANNOVER RUECK SE	8,558	115.45	988,021.10	
	NESTE OYJ	21,539	38.65	832,482.35	
	REPSOL SA	55,457	14.59	809,117.63	
	SOCIETE GENERALE SA	28,752	51.88	1,491,653.76	
UPM-KYMMENE OYJ	49,392	24.55	1,212,573.60		
ユーロ小計		867,472		15,685,958.04	(1,940,039,290)
英ポンド	3I GROUP PLC	135,161	8.17	1,104,265.37	
	ANGLO AMERICAN PLC	61,706	10.30	635,880.33	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	121,852	3.56	434,280.52	
	PERSIMMON PLC	46,203	23.91	1,104,713.73	
	PETROFAC LTD	45,215	8.02	362,850.37	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	12,632	71.70	905,714.40	
	TESCO PLC	421,872	1.79	756,838.36	

	WM MORRISON SUPERMARKETS	264,600	2.39	632,658.60	
英ポンド小計		1,109,241		5,937,201.68 (867,425,165)	
スイスフラン	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	36,845	34.00	1,252,730.00	
	SIKA AG-BR	210	6,490.00	1,362,900.00	
スイスフラン小計		37,055		2,615,630.00 (297,920,257)	
スウェーデンクローナ	ELECTROLUX AB-SER B	40,934	270.50	11,072,647.00	
スウェーデンクローナ小計		40,934		11,072,647.00 (141,729,881)	
ノルウェークローネ	SUBSEA 7 SA	72,602	139.50	10,127,979.00	
ノルウェークローネ小計		72,602		10,127,979.00 (132,777,804)	
デンマーククローネ	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,079	621.00	7,501,059.00	
デンマーククローネ小計		12,079		7,501,059.00 (124,742,611)	
オーストラリアドル	FORTESCUE METALS GROUP LTD	223,495	4.82	1,077,245.90	
	QANTAS AIRWAYS LTD	397,020	4.52	1,794,530.40	
オーストラリアドル小計		620,515		2,871,776.30 (239,707,167)	
ニュージーランドドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	258,805	3.65	945,932.27	
ニュージーランドドル小計		258,805		945,932.27 (73,574,611)	
香港ドル	KERRY PROPERTIES LTD	362,000	28.70	10,389,400.00	
香港ドル小計		362,000		10,389,400.00 (150,438,512)	
イスラエルシェケル	BANK HAPOLIM BM	119,145	23.37	2,784,418.65	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	216,687	17.37	3,763,853.19	
イスラエルシェケル小計		335,832		6,548,271.84 (205,550,253)	
合計 (外貨建証券の邦貨換算額)		5,657,735		13,775,310,988 (13,775,310,988)	

(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

次表の通りです。

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
米ドル	投資証券	VEREIT INC	69,500	545,575.00	
米ドル小計			69,500	545,575.00 (61,508,125)	

合計		61,508,125	
(外貨建証券の邦貨換算額)		(61,508,125)	

(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	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 79銘柄	99.3%		66.3%
	投資証券 1銘柄		0.7%	
カナダドル	株式 4銘柄	100.0%		3.5%
ユーロ	株式 16銘柄	100.0%		14.0%
英ポンド	株式 8銘柄	100.0%		6.3%
スイスフラン	株式 2銘柄	100.0%		2.2%
スウェーデンクローナ	株式 1銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	100.0%		1.0%
デンマーククローネ	株式 1銘柄	100.0%		0.9%
オーストラリアドル	株式 2銘柄	100.0%		1.7%
ニュージーランドドル	株式 1銘柄	100.0%		0.5%
香港ドル	株式 1銘柄	100.0%		1.1%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%		1.5%

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29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	41,535,707,956 円
負債総額	64,471,019 円
純資産総額（ - ）	41,471,236,937 円
発行済口数	46,231,722,131 口
1万口当たり純資産額 （ / ×10,000 ）	8,970 円

（参考）LM・グローバル債券マザーファンド

資産総額	32,555,802,349 円
負債総額	122,672,217 円
純資産総額（ - ）	32,433,130,132 円
発行済口数	14,151,243,114 口
1万口当たり純資産額 （ / ×10,000 ）	22,919 円

（参考）LM・グローバル株式マザーファンド

資産総額	14,051,527,664 円
負債総額	100,000,622 円
純資産総額（ - ）	13,951,527,042 円
発行済口数	4,641,777,056 口
1万口当たり純資産額 （ / ×10,000 ）	30,056 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28年11月末現在）

（以下略）

（訂正後）

(1)資本金の額（平成29年5月末現在）

（以下略）

2【事業の内容及び営業の概況】

（訂正前）

（前略）

(2)平成28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	63	1,483,470
合 計	63	1,483,470

（訂正後）

（前略）

(2)平成29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	69	1,813,975
合 計	69	1,813,975

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19期事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任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18期事業年度 (平成28年3月31日)	第19期事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	991,120	1,609,592
立替金	-	325
前払費用	71,675	75,130
未収委託者報酬	566,300	803,621
未収運用受託報酬	1,404,563	2,790,504
その他未収収益	15,322	18,203
繰延税金資産	211,764	272,130
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	1,890
未収利息	362	20
流動資産計	3,518,260	5,571,419
固定資産		
有形固定資産		
建物	200,137	182,349
器具備品	15,768	10,390
有形固定資産計	215,906	192,740
無形固定資産		
ソフトウェア	37,094	30,753
無形固定資産計	37,094	30,753
投資その他の資産		
投資有価証券	74,647	154,657
長期差入保証金	125,533	119,596
前払年金費用	35,258	31,289
投資その他の資産計	235,439	305,544
固定資産計	488,440	529,038
資産合計	4,006,700	6,100,457

(単位：千円)

	第18期事業年度 (平成28年3月31日)	第19期事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	20,513	20,858
未払金	946,928	1,242,377
未払手数料	193,297	286,834
未払消費税等	133,222	271,450
その他未払金	620,408	684,092
未払費用	2 824,143	2 1,912,310
未払法人税等	-	420,505
前受金	53,125	48,841
流動負債計	1,844,711	3,644,894
固定負債		
退職給付引当金	63,361	63,372
役員退職慰労引当金	-	1,671
繰延税金負債	10,880	9,580
固定負債計	74,242	74,624
負債合計	1,918,953	3,719,519
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	837,746	1,130,938
利益剰余金計	861,341	1,154,532
株主資本合計	2,087,746	2,380,938
純資産合計	2,087,746	2,380,938
負債純資産合計	4,006,700	6,100,457

(2) 【損益計算書】

(単位：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)	第19期事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	10,697,615	12,219,762
運用受託報酬	2,335,131	3,586,315
その他営業収益	250,608	192,177
営業収益計	13,283,355	15,998,255
営業費用		
支払手数料	3,788,445	4,487,854
広告宣伝費	79,452	61,912
公告費	665	917
調査費	5,225,403	6,801,825
調査費	176,822	178,649
委託調査費	5,047,039	6,621,626
図書費	1,541	1,549
委託計算費	240,948	267,104
営業雑経費	189,522	242,166
通信費	51,864	47,811
印刷費	125,556	183,110
協会費	11,561	10,685
諸会費	540	559
営業費用計	9,524,438	11,861,780
一般管理費		
給料	1,650,619	1,755,094
役員報酬	107,190	117,338
給料・手当	998,021	1,041,413
賞与	545,408	596,342
交際費	35,305	18,379
旅費交通費	80,064	65,088
租税公課	25,618	46,821
不動産賃借料	251,590	252,697
退職給付費用	84,950	114,446
役員退職慰労引当金繰入額	13,248	1,671
固定資産減価償却費	47,514	44,009
業務委託費	171,426	190,477
諸経費	1	247,722
一般管理費計	2,630,175	2,736,408
営業利益	1,128,742	1,400,066

(単位: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)	第19期事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取利息	424	300
受取配当金	13,829	1,550
雑収入	-	278
その他	-	37
営業外収益計	14,254	2,166
営業外費用		
為替差損	14,538	26,829
投資有価証券売却損	9,647	1,061
営業外費用計	24,186	27,890
経常利益	1,118,810	1,374,343
特別損失		
固定資産除却損	188	24
特別損失計	188	24
税引前当期純利益	1,118,621	1,374,318
法人税、住民税及び事業税	214,657	492,793
法人税等調整額	235,846	61,666
法人税等合計	450,504	431,127
当期純利益	668,117	943,191

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

第19期事業年度（自 平成28年4月 1日 至 平成29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	837,746	861,341	2,087,746	2,087,746
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	650,000	650,000	650,000	650,000
当期純利益	-	-	-	943,191	943,191	943,191	943,191
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	293,191	293,191	293,191	293,191
当期末残高	1,000,000	226,405	23,594	1,130,938	1,154,532	2,380,938	2,380,938

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 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数理債務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>

注記事項

(貸借対照表関係)

第18期事業年度 (平成28年3月31日)	第19期事業年度 (平成29年3月31日)
<p>1 固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 188,723千円 器具備品 192,301千円</p>	<p>1 固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 212,110千円 器具備品 196,628千円</p>
<p>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。</p> <p>未払費用 5,668千円</p>	<p>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。</p> <p>未払費用 8,288千円</p>

(損益計算書関係)

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)	第19期事業年度 (自平成28年4月1日至平成29年3月31日)
<p>1 関係会社との取引 諸経費 151,169千円</p>	<p>1 関係会社との取引 諸経費 133,662千円</p>

(株主資本等変動計算書関係)

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

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

第19期事業年度（自平成28年4月1日 至平成29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28年6月27日 定時株主総会	普通株式	250,000	3,194.0	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日
平成28年11月29日 取締役会	普通株式	400,000	5,110.5	平成28年 9月30日	平成28年 12月5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29年6月28日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	600,000	7,665.7	平成29年 3月31日	平成29年 6月29日

(リース取引関係)

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）	第19期事業年度 （自平成28年4月1日 至平成29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 203,052千円 1年超 548,500千円 合計 751,553千円	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 345,448千円 合計 548,500千円

（金融商品関係）

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

第19期事業年度（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29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	1,609,592	1,609,592	-
(2) 未収委託者報酬	803,621	803,621	-
(3) 未収運用受託報酬	2,790,504	2,790,504	-
(4) 投資有価証券	145,372	145,372	-
資産計	5,349,091	5,349,091	-
(1) その他未払金	684,092	684,092	-
(2) 未払手数料	286,834	286,834	-
(3) 未払費用	1,912,310	1,912,310	-
負債計	2,883,237	2,883,237	-

(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	1,609,592	-
未収委託者報酬	803,621	-
未収運用受託報酬	2,790,504	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	63,372
合計	5,203,718	63,372

(有価証券関係)

第18期事業年度 (平成28年3月31日)	第19期事業年度 (平成29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 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。	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 63,372千円 取得原価 63,372千円 差額 - 投資信託受益証券 貸借対照表計上額 82,000千円 取得原価 82,000千円 差額 - (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	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 10,000千円 売却益の合計額 -千円 売却損の合計額 1,061千円

(退職給付関係)

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	<u>28,103千円</u>
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	<u>28,103千円</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	84,950千円
----------------	----------

第19期事業年度（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、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	63,361千円
退職給付費用	114,446千円
退職給付の支払額	-千円
前払年金費用	3,968千円
制度への拠出金	110,466千円
退職給付引当金の期末残高	<u>63,372千円</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	816,207千円
年金資産	847,497千円
	<u>31,289千円</u>
非積立制度の退職給付債務	63,372千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	<u>32,082千円</u>
退職給付引当金	63,372千円
前払年金費用	31,289千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	<u>32,082千円</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	114,446千円
----------------	-----------

(ストック・オプション等関係)

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)	第19期事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1.ストック・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	1.ストック・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 133,662千円
2.ストック・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.ストック・オプション等の内容 同 左

(税効果会計関係)

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)	第19期事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳	1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳
千円	千円
繰延税金資産	繰延税金資産
未払金 168,312	未払金 182,600
退職給付引当金 19,553	役員退職慰労引当金 511
未払費用 41,986	退職給付引当金 19,404
未払事業税 2,220	未払費用 44,309
ストック・オプション費用 70,242	未払事業税 22,692
有価証券評価損 27,994	ストック・オプション費用 50,893
長期差入保証金 21,786	有価証券評価損 27,776
繰延税金資産小計 352,096	長期差入保証金 22,693
評価性引当額 140,332	繰延税金資産小計 370,882
繰延税金資産合計 211,764	評価性引当額 98,751
	繰延税金資産合計 272,130
繰延税金負債	繰延税金負債
前払年金費用 10,880	前払年金費用 9,580
繰延税金負債合計 10,880	繰延税金負債合計 9,580
繰延税金資産の純額 200,883	繰延税金資産の純額 262,549
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 33.1	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。
(調整)	
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 0.2	
評価性引当金 2.8	
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 0.8	
税効果会計適用後の法人税等の負担率 40.3	

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み、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	<u>68,597千円</u>

第19期事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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み、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	68,597千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	-
その他増減額（は減少）	5,516千円
期末における資産除去債務認識額	74,113千円

(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。

第19期事業年度（自平成28年4月1日 至平成29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	12,219,762	3,586,315	192,177	15,998,255

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・オーストラリア高配当株ファンド（毎月分配型）	3,185,876
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	1,808,377

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19期事業年度（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。

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19期事業年度（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。

報告セグメントごと負ののれん発生益に関する情報

第19期事業年度（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。

(関連当事者情報)

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）

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	-	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	-	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	-	金融業	-	サービス 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
						投資顧問 契約	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	-	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	委託調査費 の支払 (注1)	千円 20,675	未払 費用	千円 1,501
						投資顧問 契約	長期差入 保証金の 返金	125,397	-	-
						オフィスの 賃借	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	-	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	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
						サービス 契約	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	-	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	-	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)

第19期事業年度(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	-	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 回収	千円 250,000	-	千円 -
							諸経費 の支払 (注3)	133,662	未払 費用	8,288

(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	-	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 98,556	未払 費用	千円 7,707

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	-	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 27,437	その他 未収 収益	千円 2,338
							委託調査費 の支払 (注1)	412,786	未払 費用	39,161
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	-	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 1,469,170	未払 費用	千円 211,022
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	委託調査費 の支払 (注1)	千円 5,003	未払 費用	千円 7
							不動産賃借 料等の支払 (注3)	6,221	-	-
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	-	金融業	-	投資顧問 契約	委託調査費 の支払 (注1)	千円 267,308	未払 費用	千円 24,895
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 42,493	未払 費用	千円 3,517
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 135,311	その他 未収 収益	千円 12,403
							委託調査費 の支払 (注1)	604,065	未払 費用	58,250
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	-	サービス業	-	サービス 契約	調査費・ 諸経費等 の支払 (注3)	千円 69,263	前払 費用	千円 12,691
									未収 入金	1,890
									未払 費用	5,623
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 2,102,097	未払 費用	千円 1,180,015

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	-	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 26,551	その他 未収 収益	千円 2,170
							委託調査費 の支払 (注1)	1,620,144	未払 費用	247,464
同一の親会社を持つ会社	エントラスト パーマル リミテッド	英国 ロンドン市	-	金融業	-	サービス 契約	その他営業 収益の受取 (注2)	千円 2,877	その他 未収 収益	千円 1,290

(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・諸経費等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18期事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)		第19期事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	26,673円65銭	1株当たり純資産額	30,419円55銭
1株当たり当期純利益金額	8,536円06銭	1株当たり当期純利益金額	12,050円48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。 当期純利益 668,117千円 普通株式に帰属しない金額 - 普通株式に係る当期純利益 668,117千円 期中平均株式数 78千株		(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 943,191千円 普通株式に帰属しない金額 - 普通株式に係る当期純利益 943,191千円 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18期事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第19期事業年度 (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。	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29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29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29年3月末現在 9百万米ドル（1,009百万円）

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29年3月末現在 9百万米ドル（1,009百万円）

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。

ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニーはレグ・メイソン・インクの子会社であり、平成29年3月末現在の資本金の額を開示していないため、上記の資本金の額はレグ・メイソン・インクの資本金の額を記載しております。なお、米ドルの円貨換算は、便宜上、平成29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米ドル＝112.19円）によります。

(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29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29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。
野村證券株式会社	10,000	
株式会社S B I証券	48,323	
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	8,157	
ほくほくT T証券株式会社	1,250	
七十七証券株式会社	3,000	
京都信用金庫*	12,510	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29年6月21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

PwC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

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グ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第19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、レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成29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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年7月10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 櫻井 雄一郎指定有限責任社員
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28年11月9日から平成29年5月8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29年5月8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. XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。